

华安中证民企成长交易型开放式指数  
证券投资基金  
更新的招募说明书摘要  
(2020 年第 3 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

二〇二〇年三月

## 重要提示

本基金于2019年3月27日经中国证券监督管理委员会《关于准予华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]512号）注册，进行募集。本基金的基金合同自2019年7月26日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险等等。本基金是股票型基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金；本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金初始面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

投资人申购的基金份额当日起可卖出，投资人赎回获得的股票当日起可卖出。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及申购、赎回对价的交收方式已经认可。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。本次招募说明书摘要根据《关于国内市场A股ETF收费调整的通知》以及基金合同的有关规定更新指数许可使用费，相关信息更新截止日为2020年3月17日。除特别说明外，本招募说明书摘要其他所载内容截止日为2020年1月18日。

## 目录

一、基金管理人 .....	2
二、基金托管人 .....	8
三、相关服务机构 .....	10
四、基金的名称 .....	12
五、基金的类型 .....	12
六、基金的投资目标 .....	12
七、基金的投资方向 .....	12
八、基金的投资策略 .....	13
九、基金的业绩比较基准.....	15
十、风险收益特征 .....	15
十一、费用概览 .....	15
十二、对招募说明书更新部分的说明.....	18

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层
- 4、法定代表人：朱学华
- 5、成立日期：1998 年 6 月 4 日
- 6、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号
- 7、联系电话：（021）38969999
- 8、联系人：王艳
- 9、客户服务中心电话：40088-50099
- 10、网址：www.huaan.com.cn

### 二、注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5 亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

### 三、主要人员情况

## 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

### (1) 董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited 董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资管理有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、权益投资部总经理、战略投资部总经理等职

务。现任国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

#### 独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

#### （2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部

高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

### （3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，20年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，17年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士，硕士研究生学历，18年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生，硕士研究生学历，24年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾JP摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，15年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，19年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

## 2、本基金基金经理

苏卿云先生，厦门大学会计学硕士，伦敦商学院金融硕士。注册金融分析



师(CFA)。曾任职于上海证券交易所，从事基金研究发展工作。2016年7月加入华安基金，任职于指数与量化投资部。2016年12月起担任华安日日鑫货币市场基金基金经理。2017年6月至2018年11月担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)基金经理。2017年10月起担任华安沪深300指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2017年12月起上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金、上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2018年9月起任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018年10月起任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2018年11月起任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年1月起，担任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年3月起，担任华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童威先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

崔莹先生，基金投资部助理总监

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

5、业务人员的准备情况：

截至2019年3月31日，公司目前共有员工361人（不含香港公司），其中57%具有硕士及以上学历，92%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业

务板块组成。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

成立时间：1988 年 8 月 15 日

法定代表人：周杰

注册资本：95.8472 亿元人民币

联系电话：021-23219000

联系人：张贞妮

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）成立于 1988 年，是国内最早成立的大型证券公司之一。海通证券 A 股于 2007 年在上海证券交易所挂牌上市并完成定向增发，H 股于 2012 年 4 月在香港联合交易所挂牌上市，公司注册资本金增至 95.84 亿元。

海通证券设基金托管部，现有员工具有多年金融从业经历，丰富的证券相关业务经验。全员具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，硕士以上学历占 60%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

#### 2、主要人员情况

周杰先生,工学硕士,2016 年 10 月 28 日至今担任公司董事长,2016 年 7 月至今担任公司党委书记。1992 年 2 月至 1996 年 6 月在上海万国证券有限公司投资银行部工作;1996 年 6 月至 2001 年 12 月先后担任上海上实资产经营有限公司投资部经理、副总经理、董事长兼总经理;2001 年 12 月至 2003 年 4 月担任上海实业医药科技(集团)有限公司董事兼总经理;2002 年 1 月至 2016 年 7 月,先后担任上海实业控股有限公司(于香港联交所上市,股份代号:0363)执行董事兼行政总裁、执行董事兼常务副总裁、副董事长兼行政总裁;2004 年 8 月至 2016 年 7 月,先后担任上海上实(集团)有限公司策划总监、执行董事兼副总裁、执行董事兼常务副总裁、总裁兼党委副书记;2010 年 3 月至 2012 年 5 月担任上海医药集团股份有限公司(于上交所上市,股份代号:601607;于香港联交所上市,股份代号:02607)监

事长,2012年6月至2013年6月、2016年5月至2016年7月担任上海医药集团股份有限公司董事长兼党委书记;2009年1月至今担任中芯国际集成电路制造有限公司(于纽约证券交易所上市,股份代号:SMI;于香港联交所上市,股份代号:00981)非执行董事。周先生2016年至今任上海证券交易所监事、薪酬委员会主任,2016年至今任上海证券同业公会会长,2017年至今任上海金融业联合会副理事长,2016年至今任上海上市公司协会理事会副会长,2016年至今任中国互联网金融协会会员代表,2017年至今任上海金融理财师协会会长,2017年至今任上海市仲裁委仲裁员。

陈春钱先生,海通证券总经理助理,负责公司经纪业务。陈先生还兼任公司经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与IT治理委员会委员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于1988年7月获安徽财经学院经济学硕士学位并于1995年7月获厦门大学经济学博士学位,拥有17年的证券业工作及管理经验。1997年10月至1998年1月,担任公司深圳分公司业务部负责人;1998年1月至2000年3月,担任国际业务部副总经理;2000年3月至2000年12月,担任深圳分公司副总经理;2000年12月至2006年5月,担任投资管理部(深圳)总经理;2006年5月至2013年2月,担任销售交易总部总经理,其间2007年11月至2009年3月兼任机构业务部总经理。

凌如水先生,海通证券基金托管部总经理,拥有证券从业资格与基金从业资格。自1995年已有23年金融从业经历。先后从事过银行证券投资、证券经纪业务管理、证券财富管理、资产托管业务管理等工作。其中1995年至2001年在交通银行绍兴分行证券部,负责证券投资业务。2001年至2013年分别在海通证券上虞营业部担任总经理等职务,在此期间其管理的证券营业部连续七年荣获“十佳营业部”荣誉。2013年至今分别在海通证券企业及私人客户部和基金托管部担任副总经理、总经理,负责公司专业机构客户财富管理业务和资产托管业务管理。

### 3、基金托管业务经营情况

海通证券于2013年12月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格,是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司,海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人

的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、网下现金发售和网下股票发售直销机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

法定代表人：朱学华

电话：（021）38969999

传真：（021）58406138

联系人：王艳

客户服务电话：40088-50099

网址：www.huaan.com.cn

##### 2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

##### 3、网上现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

4、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

负责人：周明

联系人：严峰

电话：(0755) 25946013

传真：(0755) 25987122

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陈颖华

经办律师：安冬、陈颖华

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 5 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心

11 楼

首席合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：魏佳亮

经办会计师：单峰、魏佳亮

## 四、基金的名称

本基金名称：华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：本基金为股票型证券投资基金。基金的运作方式为交易型开放式，存续期间为不定期。

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 七、基金的投资方向

基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不得低于非现金基金财产的 80%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

## 八、基金的投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。

### 1、组合复制策略

本基金主要采取复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

### 3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。



#### 4、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 6、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

#### 7、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关

投资策略，并在招募说明书更新中公告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证民企成长指数收益率。

本基金为交易型开放式指数基金，将紧密跟踪标的指数中证民企成长指数，努力追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。因此，选择本基金业绩比较基准为：中证民企成长指数收益率。

本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），经基金管理人与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

## 十、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 十一、费用概览

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市费及年费；
- 9、标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，不满一个季度的，根据实际使用天数支付。指数许可使用费适用比例费率时，计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

具体就每个计费季度而言，当季度日均基金资产净值(日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同)大于人民币 5000 万元时，指数许可使用费不足 3.5 万元的，按照 3.5 万元收取。

当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，指数许可使用的按照按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。

指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，按季支付。

指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

由于中证指数有限公司保留变更或提高指数许可使用费的权利，如果指数许可使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法及费率。

上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费和标的指数许可

使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

章节	主要更新内容
十五、基金的费用与税收	更新了基金的指数许可使用费的相关信息。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年三月二十日