

# 汇安成长优选灵活配置混合型证券投资 基金

## 招募说明书（更新）摘要

2020 年第 1 号

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二零二〇年四月

## 【重要提示】

1、本基金根据 2017 年 12 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]2408 号）进行募集。本基金合同已于 2018 年 2 月 13 日生效。

2、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。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

4、本基金投资股指期货、国债期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应

证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

5、本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

6、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易的可转换债券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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）。

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。

7、基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货、国债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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

8、本基金初始募集面值为人民币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。

9、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他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

10、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。

11、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述50%比例的除外。

12、本招募说明书所载内容截止日为2020年2月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基

金托管人复核。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：汇安基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室

办公地址：北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

法定代表人：何斌(代行职务)

成立时间：2016 年 4 月 25 日

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：赵庆玲

联系电话：(010) 56711600

汇安基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2016]860 号文批准设立。

### （二）主要成员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

何斌先生，董事长。22 年证券、基金行业从业经验。东北财经大学国民经济计划学学士，先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部，曾任国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长、副总经理。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司董事长。

戴樱女士，董事。5 年证券、基金行业从业经验，2004 年毕业于上海对外贸易学院，国际贸易专业学士学位。曾就职于上海贝尔阿尔卡特股份有限公司，任采购部经理助理；上海樱琦干燥剂有限公司，任公司董事；上海上贝资产管理有限公司合伙人。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司金融机构部总经理。

刘强先生，董事。5 年证券、基金行业从业经验，美国注册管理会计师(CMA)，东北财经大学审计学学士。历任阿尔卡特深圳公司财务总监，霍尼韦尔深圳公司财务总监，阿特维斯（中国）财务及信息技术总监，北京刚正国际投资有限公司副总经理。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有

限责任公司副总经理。

李海涛先生，独立董事。美国耶鲁大学管理学院金融学博士。曾任密西根大学 Ross 商学院金融学教授、长江商学院金融学访问学者，现任长江商学院副院长及杰出院长讲习教授。

余剑峰先生，独立董事。2008年毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院，金融学博士，教授学位。曾于2014秋任清华大学五道口金融学院访问教授；2015年至2016年任香港中文大学（深圳）经管学院金融学教授、执行副院长；2008年至2017年明尼苏达大学卡尔森管理学院金融学助理教授、副教授（终身教授）、正教授、Piper Jaffray 讲席教授；2016年至今任清华大学五道口金融学院建树讲席教授；2017年至今任清华大学国家金融研究院资产管理研究中心主任；2019年至今任清华大学金融科技研究院副院长。

黄磊先生，独立董事。中国人民大学经济学博士，教授。曾任山东财经大学金融学院院长；曾任山东省政协、山东省政协常委、山东省政协经济组召集人、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员；曾任教育部金融类专业教学指导委员会委员。现任山东财经大学教授委员会主任委员、山东财经大学学术委员会副主任委员、区域金融优化与管理协同创新中心（山东）主任。

## 2、基金管理人监事

王丽英女士，监事。4年证券、基金从业经验。毕业于中央财经大学会计学学士，2011年6月至2017年6月在北京居然之家投资控股集团有限公司集团总部以及其名下子公司担任财务经理。2017年7月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司综合管理部副总监（财务）。

## 3、高级管理人员

何斌先生，董事长，代行总经理职务。（简历请参见董事会成员）

郭冬青先生，督察长。21年证券、基金从业经验。南开大学经济学硕士。历任中石化集团财务部经济师、广发证券投行部高级经理、华安证券投行部副总经理、大商集团副总经理、中航证券董事总经理、北京国金鼎兴投资有限公司副总经理。2017年11月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司督察长。

窦星华先生，常务副总经理。14年证券、基金从业经验，CFA。英国杜伦大学金融学硕士。历任标准普尔信息服务（北京）有限公司指数分析师，交银施罗

德基金管理有限公司产品经理，华安基金管理有限公司产品部总经理助理，盛世景资产管理股份有限公司产品总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司任产品及创新业务部总经理，现任汇安基金管理有限责任公司常务副总经理。

刘强先生，副总经理。（简历请参见董事会成员）

郭兆强先生，副总经理。23年证券、基金从业经验，保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾任山西证券投行部综合经理、中德证券高级副总裁，东北证券北京分公司深圳市场部副总经理，从事投资银行业务。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

王俊波先生，副总经理。16年证券、基金从业经验。中国人民大学金融学硕士。历任中国平安产险营销策划经理，嘉实基金券商业务部主管，兴业证券资产管理有限公司市场部执行总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

#### 4、本基金基金经理

戴杰，复旦大学数学本科、硕士，7年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资部先后担任数量分析师和投资经理。2016年10月24日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2017年3月22日至2019年4月19日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月23日至2019年3月8日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月19日至2019年3月8日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月27日至2018年8月9日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年7月26日至2019年10月14日，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月17日至今，任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年11月22日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年2月13日至今，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年4月11日至今，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年4月30日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2019年10月30日至今，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2019年12月24日至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

何斌先生，董事长，代行总经理职务。（简历请参见董事会成员）。

钟敬棣先生，固定收益首席投资官。25年银行、基金行业从业经验，硕士。2005年4月加入嘉实基金，先后任固定收益研究员、投资经理。2008年5月加入建信基金，先后任基金经理、投资部副总监、固定收益首席投资官、公司投资决策委员会委员，曾管理建信稳定增利、双息红利、安心保本等债券型基金，多次被评为金牛基金。2018年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益首席投资官，董事总经理。

邹唯先生，首席投资官。20年证券、基金行业从业经历。理科硕士。历任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长，中信产业基金金融投资部董事总经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司，现任首席投资官，董事总经理。

仇秉则先生，固定收益研究部总监。CFA，CPA，中山大学经济学学士，14年证券、基金行业从业经历，曾任普华永道中天会计师事务所审计经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016年6月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益研究部总监一职，从事信用债投资研究工作。

窦星华先生，常务副总经理。（简历请参见高级管理人成员）。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币34,932,123.46万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至2018年12月，中国工商银行资产托管部共有员工202人，平均年龄



33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

汇安基金管理有限责任公司直销中心

传真：021-80219047

邮箱：DS@huianfund.cn

地址：上海市虹口区东大名路 501 号上海白玉兰广场 36 层 02 单元

联系人：于擎玥

电话：021-80219027

#### 2、其他销售机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(2) 兴业银行股份有限公司

办公地址：上海市江宁路 168 号上海兴业大厦

法定代表人：高建平

客服电话：95561/4008895561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(3) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客服服务电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(4) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客户服务电话：95566

网址：<http://www.boc.cn/>

(5) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

法定代表人：其实

客户服务电话：95021/400-1818-188

网址：<http://fund.eastmoney.com/>

(6) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（7）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

（8）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（9）洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室

法定代表人：任淑桢

客服电话：4006706863

网址：[www.hongtaiwealth.com](http://www.hongtaiwealth.com)

（10）万联证券股份有限公司

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：张建军

客服电话：4008888133

公司官网：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

（11）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客服服务电话：95523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（12）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：021-61618888

（13）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

（14）嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

（15）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

（16）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服热线：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

（17）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（18）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：祖国明

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（19）扬州国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

法定代表人：刘晓光

客服电话：400-021-6088

网址：<https://www.gxjlc.cn/>

（20）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp>

（21）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

网址：<http://www.huilinbd.com>

（22）广发银行股份有限公司

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：400-830-8003

网址：<http://www.cgbchina.com.cn/>

（23）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/newsite/>

（24）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：4009908826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

（25）中信证券（山东）有限公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95549

网址：[www.zxzqsd.com.cn](http://www.zxzqsd.com.cn)

（26）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

网址：<http://www.jianfortune.com/>

（27）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服服务电话：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

（28）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

网址：[www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

（29）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

（30）深圳新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 270

法定代表人：洪弘

客服电话：4001661188

网址：<http://www.xinlande.com.cn/>

（31）泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

客服电话：0411-88891212

网址：[http://www.taichengcaifu.com/new\\_tccf/](http://www.taichengcaifu.com/new_tccf/)

（32）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

网址：[www.cmschina.com](http://www.cmschina.com)

（33）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

法定代表人：王苏宁

电话：95118

网址：[www.jr.jd.com](http://www.jr.jd.com)

（34）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

网址：<http://www.yixinfund.com/>

（35）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

法定代表人：何之江

客服电话：4000-188-288

网址：<https://stock.pingan.com>

（36）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

法定代表人：王军辉

客服电话：4006-802-123

网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金，并在管理人网站公示。

## （二）登记机构

名称：汇安基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室

办公地址：北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

法定代表人：何斌(代行职务)

电话：010-56711600

传真：010-56711640

联系人：刚晨升

## （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

注册地址：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：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

## （四）审计基金财产的会计师事务所

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 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真电话：021-23238800



联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

## 四、基金的名称

汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金。

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金。

## 六、基金的投资目标

本基金在深入的基本面研究的基础上，精选具有良好成长潜力的上市公司，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易的可转换债券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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）。

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：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0-95%；每

个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货、国债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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、基金的投资策略

本基金通过合理稳健的资产配置策略，将基金资产在权益类资产和债券类资产之间灵活配置，同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略，紧跟当下国民经济发展过程中各行业的成长机会和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。

本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券类资产投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略等。

### 1、资产配置策略

本基金管理人在大类资产配置过程中，结合定量和定性分析，从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例，以争取降低单一行业投资的系统性风险冲击。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率，居民消费价格指数（CPI），生产者价格指数（PPI），货币供应量（M0，M1，M2）的增长率等指标。

本基金考虑的政策面因素包括但不限于货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度等。

### 2、股票投资策略

#### （1）行业配置策略

本基金管理人在进行行业配置时，将根据管理人对行业基本面的分析，观察行业收入增速、利润增速、毛利率变化等因素，选取有较大成长空间、处于快速增长期的行业进行配置。与此同时，本基金投资组合构建时将充分分散行业权重，避免单一行业持有权重过大，降低基金组合净值波动风险。

## （2）精选个股策略

本基金采取量化选股策略精选个股。

首先，本基金将进行定量筛选，选择收入增速在全市场中排名前 50%或者上一年度公司利润增速在全市场中排名前 50%的股票；然后由研究员从基本面角度出发进行筛选，构建成长型股票池。研究员也可以从基本面角度出发经严格论证之后将符合成长股特征的股票加入股票池。

其次，本基金将主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越业绩比较基准的业绩水平。

**超额收益模型：**该模型通过构建多因子量化系统，综合评估估值、市场趋势、盈利、企业质量、投资者情绪等多个因素，全方位给资产做量化评分，尽量投资评分较高的资产，回避评分较低的资产。基金管理人将针对本基金偏成长的股票池特点，利用量化模型分析挑选在成长股中更有选股能力的因子，以构建更加贴近本基金特点的超额收益模型。

**风险模型：**该模型用于控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括市值偏离、行业集中度等，力求相对于业绩比较基准的偏离风险控制一定范围内。

**成本模型：**该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易损耗，以控制基金换手率，达到最优投资效果。

## 3、债券类资产投资策略

在进行债券类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

### （1）利率预期策略

本基金通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分

析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

### （2）信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

### （3）套利交易策略

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下，比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

### （4）可转换债券投资策略

本基金着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

#### （5）资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### （6）中小企业私募债投资策略

本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。

#### 4、股指期货投资策略

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的。基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

#### 5、国债期货投资策略

本基金参与国债期货交易以套期保值为目的。在风险可控的前提下，通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上，将审慎地获取相应的超额收益，通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加，以及国债期货与债券的多空比例调整，获取组合的稳定收益。

#### 6、权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合：

本基金采取现金套利策略，兑现部分标的证券的投资收益，并通过购买该证券认购权证的方式，保留未来股票上涨所带来的获利空间。

根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。

## 九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	143,047,340.82	93.70
	其中：股票	143,047,340.82	93.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,341,382.14	6.12
8	其他资产	283,813.10	0.19
9	合计	152,672,536.06	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,105,217.15	47.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	966,788.00	0.64
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,205,784.00	4.12
G	交通运输、仓储和邮政业	5,622,750.00	3.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,668,062.00	2.43
J	金融业	34,904,756.28	23.15
K	房地产业	8,165,192.00	5.42
L	租赁和商务服务业	4,869,062.00	3.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,592,966.04	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,946,763.35	3.94
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	143,047,340.82	94.88

## 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	134,900	11,528,554.00	7.65
2	600036	招商银行	213,500	8,023,330.00	5.32
3	600519	贵州茅台	6,174	7,303,842.00	4.84
4	000333	美的集团	101,600	5,918,200.00	3.93
5	000001	平安银行	359,500	5,913,775.00	3.92
6	600009	上海机场	71,400	5,622,750.00	3.73
7	000860	顺鑫农业	97,500	5,136,300.00	3.41
8	000568	泸州老窖	54,300	4,706,724.00	3.12
9	600809	山西汾酒	48,700	4,368,390.00	2.90
10	600048	保利地产	262,800	4,252,104.00	2.82

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

### 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	57,690.05
2	应收证券清算款	99,620.42
3	应收股利	-
4	应收利息	2,088.15
5	应收申购款	124,414.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	283,813.10

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 12 月 31 日，所列数据未经审计。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、基金合同生效以来（截至 2019 年 12 月 31 日）的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

汇安成长优选混合 A

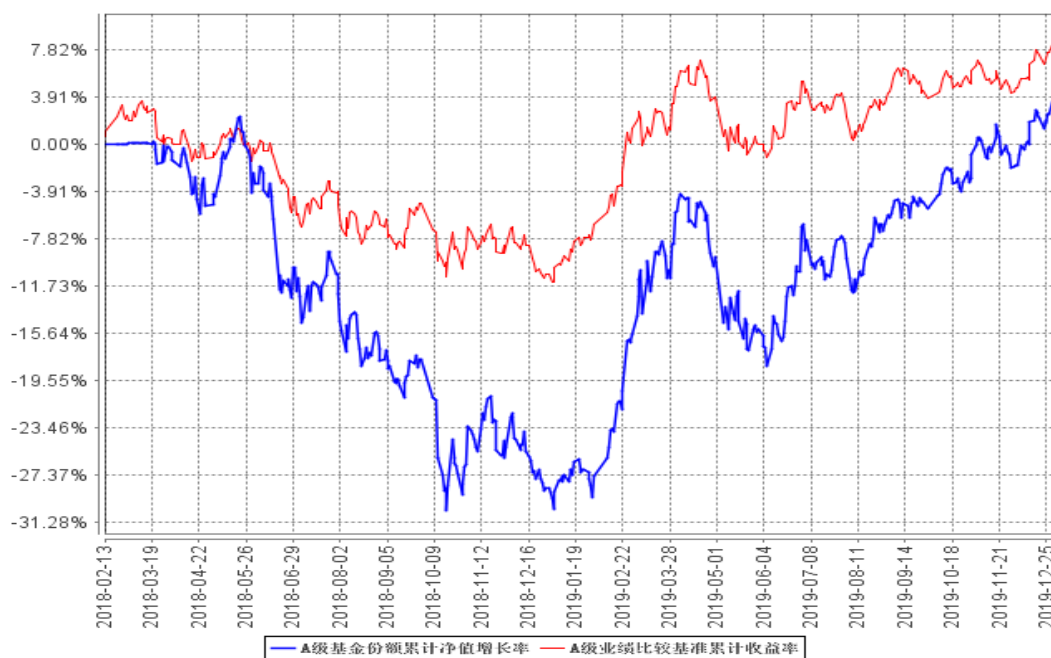
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2018.2.13 至 2018.12.31	-28.38%	1.41%	-10.69%	0.74%	-17.69%	0.67%
2019.1.1 至 2019.12.31	45.59%	1.25%	21.85%	0.71%	23.74%	0.54%

汇安成长优选混合 C

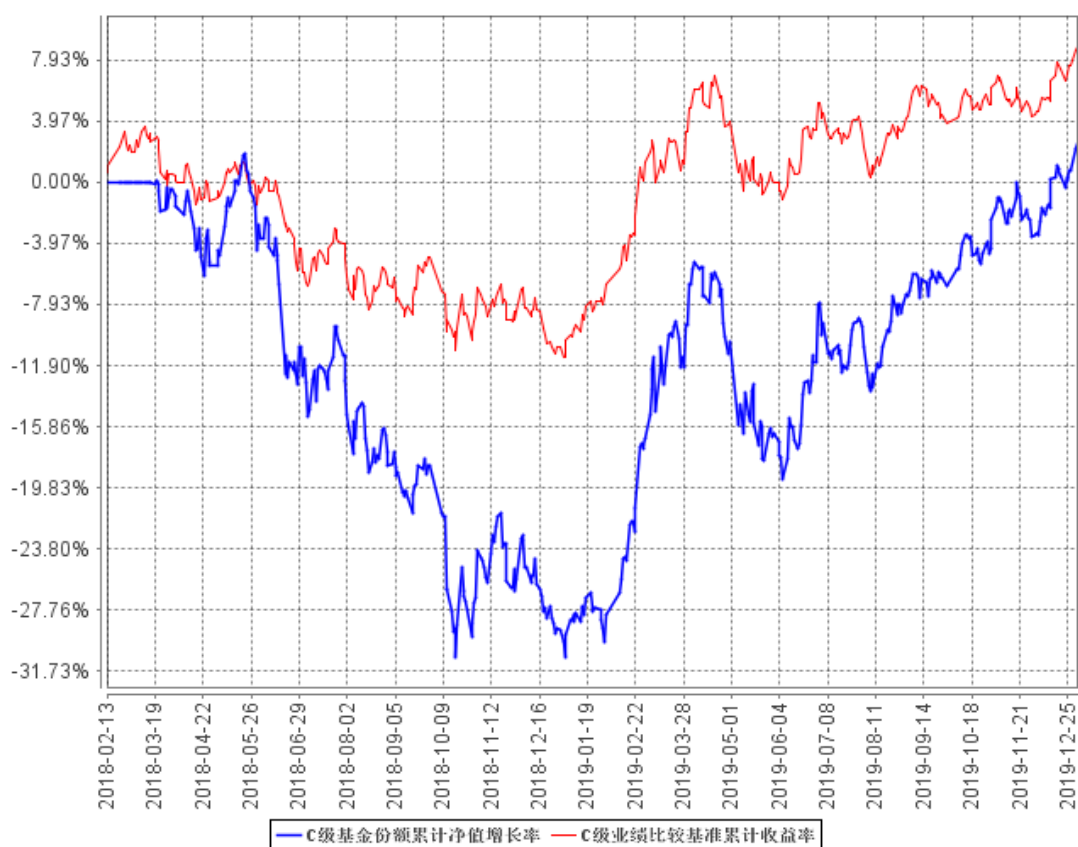
阶段	净值增 长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2018.2.13 至 2018.12.31	-29.02%	1.41%	-10.69%	0.74%	-18.33%	0.67%
2019.1.1 至 2019.12.31	44.42%	1.25%	21.85%	0.71%	22.57%	0.54%

## 2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

## 十三、基金的费用概览

### （一）申购费与赎回费

#### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。若 A 类份额投资者有多笔申购，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	A 类基金份额申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1,000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类份额投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

#### 2、赎回费用

本基金的 A 类基金份额、C 类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减，赎回费率见下表：

持有基金份额期限期间	A 类基金份额赎回费率	C 类基金份额赎回费率
7 日以下	1.50%	1.50%
7 日（含）至 30 日	0.75%	0.50%
30 日（含）至 180 日	0.50%	0
180 日以上（含 180 日）	0	0

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对持续持有期少于 30 日的 A 类基金份额投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日（含 30 日）但少于 3 个月的 A 类基金份额投资人收取的赎回费的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月（含 3 个月）但少于 6 个月的 A 类基金份额投资人收取的赎回费的 50% 计入基金财产。对于持续持有 C 类基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。未计

入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。（前述所指的 1 个月为 30 日）。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （三）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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、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。

### （四）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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

在通常情况下，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80% 年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4、上述“（三）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法律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。

### （五）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。

#### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产需要缴纳的增值税，由基金管理人按照税务机关的要求进行核算，从基金财产中支付。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《流动性风险管理规定》及其它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
第三部分 基金管理人	更新了基金管理人的相关信息。
第四部分 基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
第五部分 相关服务机构	更新了相关服务机构的信息。
第八部分 基金份额的申购与赎回	更新了“基金转换的开始日及时间、适用基金范围及转换业务规则”
第九部分 基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
第十部分 基金的业绩	更新了基金业绩，已经托管人复核。
第二十二部分 其他应披露事项	更新了披露了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

汇安基金管理有限责任公司  
二零二〇年四月二十五日