

汇安趋势动力股票型证券投资基金 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 2018 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予汇安趋势动力股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]135 号）进行募集。本基金合同已于 2018 年 4 月 25 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、本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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：

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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、应收申购款等。

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。

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，本基金份额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（简称“汇安基金”）

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年任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、本基金的基金经理

邹唯，理科硕士，20年证券、基金行业从业经历，曾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，担任首席投资官，董事总经理。2018年4月27日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理；2018年9月7日至今，任汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金经理；2019年1月25日至今，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理；2019年8月28日至今，任汇安行业龙头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；（简历请参见本基金的基金经理）。

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。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017 共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关

法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并

通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。

资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段

妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）汇安基金管理有限责任公司直销中心

汇安基金管理有限责任公司直销中心

传真：021-80219047

邮箱：DS@huiianfund.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：陈四清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2）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/>

（3）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/>

（4）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

（5）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

（6）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

（7）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/>

（8）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

（9）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/>

(10) 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>

(11) 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>

(12) 阳光人寿保险股份有限公司

办公地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场1层

法定代表人：李科

客服电话：95510

网址：<http://fund.sinosig.com/>

(13) 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/>

(14) 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/>

(15) 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

（16）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

（17）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

（18）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/>

（19）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

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

（20）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：杨雅琴

客服电话：400-8189-598

网址：www.hongtaiwealth.com

（21）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

（22）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

（23）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

（24）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/>

（25）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/

（26）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

（27）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/>

（28）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：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、徐莘

（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

汇安趋势动力股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金主要投资于在现行趋势下具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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：本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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、应收申购款等。

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

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。

2、行业配置策略

本基金基于主题研究方法，通过对社会、经济、科技、资源等企业运营环境中主要驱动力的分析，领先市场识别和把握未来趋势的变化和影响，并选取在全球重大趋势里受益的领域进行投资。

3、股票配置策略

本基金以自上而下的主题投资为主线，从事实出发聚焦未来需求的变化是投资配置的核心。股票投资策略主要包括主题生成策略、主题库动态维护、主题配置策略等，对在全球趋势中受益的公司的投资价值进行综合评估，选择趋势价值被低估的上市公司进行投资。

（1）主题生成策略

本产品基于全球精选的主题研究与国内商情推理研究，通过分析人口、社会、科技、环境等主要驱动力，识别经济中结构性变化的拐点，从而把握经济变迁、企业前景有深入影响的长期趋势。

（2）主题库动态维护

主题生成后即进入主题库。主题库中所有主题按生命周期的四个阶段进行划分：主题萌芽（动量）、主题确认（成长）、主题实现（价值）和主题衰退（退出）。主题萌芽期投资主题影响力并不明显，在主题形成期，主题影响力不断增强并在主题实现期达到鼎盛，最后随着主题的衰退逐步减弱。

本基金在主题萌芽期开始对主题进行布局，在确认期加大投资，在市场共识开始形成的实现期实现收益并逐步退出。新主题的生成和主题库的动态维护每季度进行一次。

（3）主题配置策略

本基金根据上述主题生命周期市场活跃度，同时结合催化剂强度、宏观环境等因素，精选 6-8 个主题进行投资，并对主题赋以权重。每月月末对主题库中所有主题进行打分，选取得分前 6 名的主题作为下期投资的方向，如果得分第 7、8 位主题与得分第 6 主题分数相差不超过 5 分，则可扩充当期主题最多至 8 个。单一主题在股票仓位中的权重控制在 10%-25%范围内，主题之间的相关性较低，6-8 个主题可以起到分散主题选择风险的作用。

（4）股票选择策略

在主题生成阶段，已经形成了对应的股票池。每月的投资主题形成后，基金经理和主题研究团队会对这些主题对应的股票池进行更深入的分析，并对这些公司和主题之间的相关程度进行区分。

相关度主要通过上市公司目前产品布局的分析得出，通常主题相关的产品最近一期收入占比超过 30%即为高相关，某些情况下会加入对公司未来发展方向的分析，并调整相关度得分。在个股上，尽量采取分散化和平均化的投资，降低个股选择的

4、债券投资组合策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

（1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取超额收益。

5、流通受限证券投资策略

本基金在策略设计层面已尽量避免投资流通受限证券。如遇必要情况，本基金将以价值投资理念和方法分析拟投资的流通受限证券的内在价值。对潜在投资目标公司所处行业的周期性、景气度、成长性、发展现状及未来趋势等进行审慎研究，精选上行行业中具有核心竞争力、具有持续成长能力的上市公司；在价值精选的基础上，严格执行成本控制和边际法则，通过内在价值比较和市场相对价值比较确定安全边际。

6、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

7、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，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

8、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，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股

指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

九、基金的业绩比较基准

中证 800 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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 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	6,769,550.00	88.15
	其中：股票	6,769,550.00	88.15
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	756,210.26	9.85
8	其他资产	153,909.42	2.00
9	合计	7,679,669.68	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	141,750.00	1.97
B	采矿业	666,207.00	9.28
C	制造业	2,103,996.00	29.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	289,100.00	4.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,598.00	3.50
J	金融业	2,459,561.00	34.24
K	房地产业	857,338.00	11.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,769,550.00	94.25

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	000002	万科 A	19,100	614,638.00	8.56
2	600585	海螺水泥	9,800	537,040.00	7.48
3	600030	中信证券	20,200	511,060.00	7.12
4	600036	招商银行	12,600	473,508.00	6.59
5	601318	中国平安	5,400	461,484.00	6.43
6	600837	海通证券	21,200	327,752.00	4.56
7	002142	宁波银行	11,100	312,465.00	4.35
8	601872	招商轮船	35,000	289,100.00	4.03
9	002624	完美世界	5,700	251,598.00	3.50
10	600048	保利地产	15,000	242,700.00	3.38

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持有股指期货。

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

i.11.1 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	6,086.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266.66
5	应收申购款	147,556.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,909.42

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：

汇安趋势动力股票 A

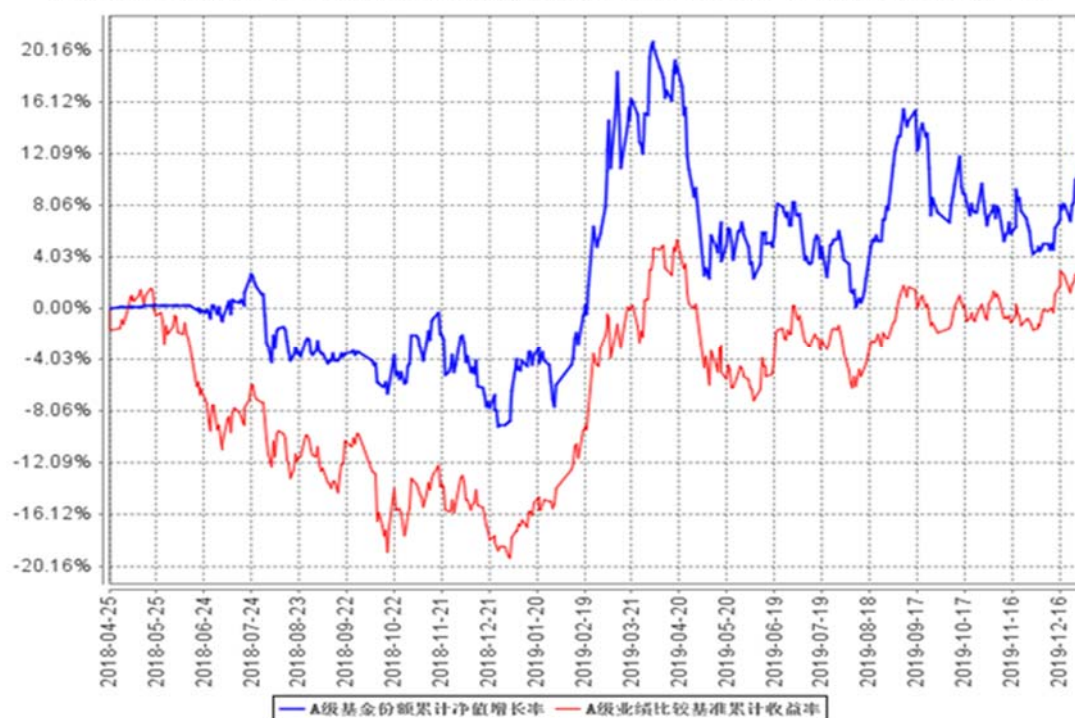
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018 年 4 月 25 日 （基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	-9.21%	0.77%	-18.61%	1.13%	9.40%	-0.36%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	24.83%	1.36%	27.73%	1.01%	-2.90%	0.35%

汇安趋势动力股票 C

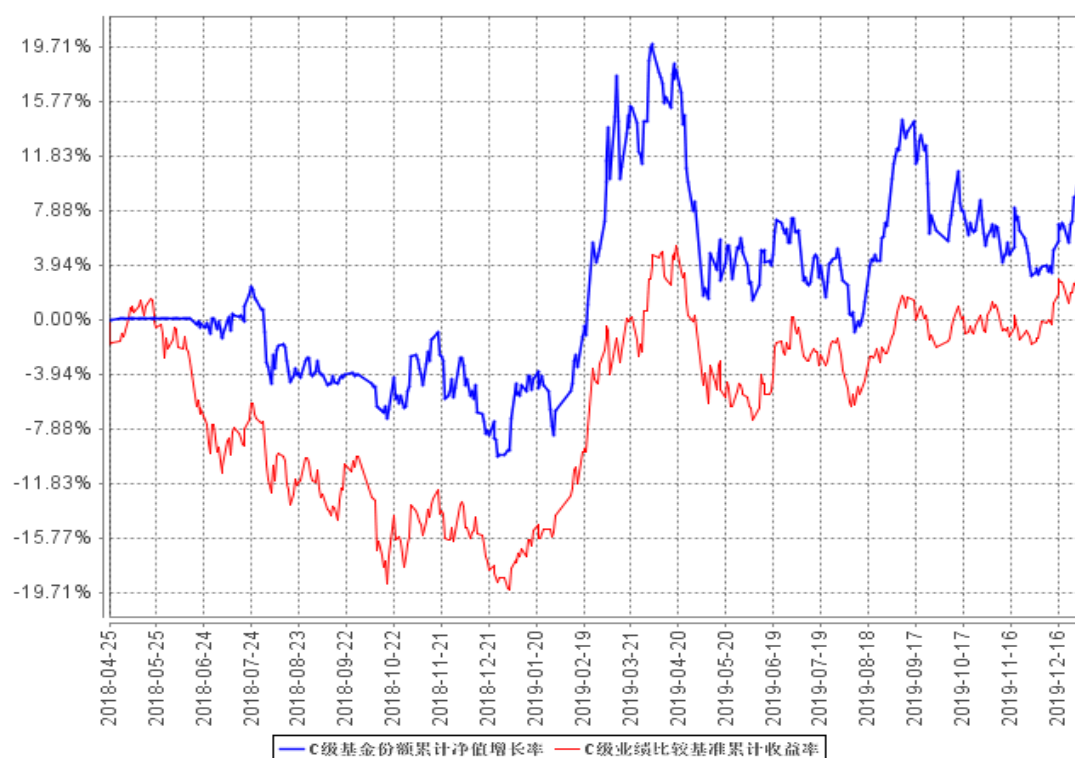
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018 年 4 月 25 日 （基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	-9.72%	0.77%	-18.61%	1.13%	8.89%	-0.36%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	24.12%	1.36%	27.73%	1.01%	-3.61%	0.35%

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类基金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	1.50%
100 万 ≤ M < 200 万	1.00%
200 万 ≤ M < 500 万	0.60%
M ≥ 500 万	按笔收取，1,000 元/笔

本基金A类基金份额的申购费用由A类基金份额投资者承担，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：

持有期间（Y）	A类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
Y < 7 天	1.50%	1.50%
7 天 ≤ Y < 30 天	0.75%	0.50%
30 天 ≤ Y < 6 个月	0.50%	0%
6 个月 ≤ Y < 1 年	0.25%	
Y ≥ 1 年	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。对于A类基金份额，持有期限不满30天的，收取的赎回费全额计入基金财产；持有期满30天不满90天的，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；持有期满90天但不满6个月的，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；持有期满6个月但不满1年的，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产；对于C类基金份额，持有期限不满30天的，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。

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。

（二）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费用及维护费用；
- 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。

（三）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0.50%。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类基金份额的基金资产净值的0.50%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：

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取并付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。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“（二）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。

（四）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。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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