

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  
更新的招募说明书摘要

(2020 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二〇年三月

## 重要提示

本基金于2018年6月8日经中国证券监督管理委员会《关于准予华安中证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注册的批复》（证监许可[2018]947号）注册，进行募集。本基金基金合同自2019年1月15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：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、流动性风险、本基金的特定风险等。

本基金为ETF联接基金，目标ETF为华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金。本基金对目标ETF的投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。在本基金目标ETF未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。本基金属于目标ETF的联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

本基金份额发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于发售面值，本基金投资者有可能出现亏损。

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基金法律文件，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。

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。

本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：（1）在基金的投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申购、赎回目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及其他销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。

本基金并不保证和目标ETF业绩表现完全一致，与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）投资比例要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需保留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。（2）申购赎回的影响。目标ETF按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

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仅根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》、《托管协议》，对所涉章节进行了更新，相关信息更新截止日为2020年2月28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2019年7月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日。

## 目录

一、基金管理人 .....	2
二、基金托管人 .....	7
三、相关服务机构 .....	9
四、基金的名称 .....	28
五、基金的类型 .....	28
六、基金的投资目标 .....	28
七、基金的投资方向 .....	28
八、基金的投资策略 .....	29
九、基金的业绩比较基准.....	31
十、基金的风险收益特征.....	32
十一、基金的投资组合报告.....	32
十二、基金的业绩 .....	36
十三、费用概览 .....	37
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	41

## 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 号上海国金中心二期 31—32 层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998 年 6 月 4 日
- 5、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
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：（021）38969999
- 11、客户服务电话：40088-50099
- 12、联系人：王艳
- 13、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、上海上国投资管理咨询有限公司监事。

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、总裁办公室主任、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，硕士研究生，11 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。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）的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任华安沪深 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及其联接基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安 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的基金经理。2018 年 11 月，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月起，同时担任本基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安沪深 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。2019 年 5 月起，同时担任华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司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

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至 2019 年 6 月 30 日，公司目前共有员工 358 人（不含香港公司），其中 57.5% 具有硕士及以上学位，92.7% 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、基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 二、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 三、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”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。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金销售机构

##### 1、直销机构

(1) 华安基金管理有限公司上海业务部

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

电话：(021) 38969973

传真：(021) 58406138

联系人：姚佳岑

(2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 522 室

电话：(010) 57635999

传真：(010) 66214061

联系人：刘雯

(3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路 8 号高德置地夏广场 D 座 504 单元

电话：(020) 38082891

传真：(020) 38082079

联系人：赵安平

(4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街 88 号长安国际中心 A 座 706 室

电话：(029) 87651812

传真：(029) 87651820

联系人：翟均

(5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段 19 号威斯顿联邦大厦 12 层 1211K-1212L

电话：(028) 85268583

传真：(028) 85268827

联系人：张晓帆

(6) 华安基金管理有限公司沈阳业务部

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：杨贺

(7) 华安基金管理有限公司深圳业务部

地址：深圳福田区金田路 2030 号卓越世纪中心 3 号楼 2008 室

邮编：518000

电话：0755-82755911

联系人：唐硕

(8) 华安基金管理有限公司江苏业务部

地址：南京市中山南路 49 号商茂世纪广场 19D2

电话：025-86890489

联系人：李展

(9) 华安基金管理有限公司华东业务部

地址：福建福州鼓楼区五四路 151 号宏远帝豪国际大厦 2307 室

电话：0591-87831775

联系人：王枫

联系人：谢伯恩

## 2、其他销售机构

(1) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：400-700-9665

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

(2) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：4000-766-123

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

(3) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼

法定代表人：其实

电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(4) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

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

(5) 上海长量基金销售有限公司

注册地址: 浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人: 张跃伟

客户服务电话: 400-820-2899。

网址: [www.e-rich.com.cn](http://www.e-rich.com.cn)

(6) 海银基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人: 刘惠

客户服务电话: 400-808-1016

网址: <http://www.fundhaiyin.com>

(7) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

客户服务电话: 400-046-6788

网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(8) 北京虹点基金销售有限公司

地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人: 董浩

客户服务电话: 400-068-1176

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

(9) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 胡学勤

客服电话: 400-866-6618

网址: [www.lu.com](http://www.lu.com)

(10) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道 1 号宝利国际广场南塔 12 楼

法定代表人: 肖雯

客户服务电话: 020-89629066

网站: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(11) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场

法定代表人: 李兴春

客户服务电话: 4000676266

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

(12) 深圳市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 2704 办公地

址: 深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人: 马勇

客户服务电话: 4001161188

网址: [https:// 8.jrj.com/](https://8.jrj.com/)

(13) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

地址: 北京市宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人: 彭运年

客户服务电话: 4008909998

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

(14) 泰信财富投资管理有限公司

地址: 北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间

法定代表人: 李静

客户服务电话: 400-168-7575

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



(15)上海中正达广基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客户服务电话：400-6767-523

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

(16)北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客户服务电话：010-82350618

公司网址：[www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

(17)奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务电话：400-684-0500

公司网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(18)深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 7 层

法定代表人：赖任军

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(19)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

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

邮编:100102

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：4000618518

网站：<https://danjuanapp.com/>

（20）上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

公司网站：<https://www.wg.com.cn/>

（21）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：021-50810673

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

（22）济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心 A 座 46 层济安财富

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）

公司网站：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

（23）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

客服电话：个人业务:95118 企业业务：400-088-8816

公司网址：<http://fund.jd.com/>

（24）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

公司网站：[www.jiyufund.com.cn/](http://www.jiyufund.com.cn/)

客户服务电话：400-820-5369

（25）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客户服务电话：4008-588-588

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

（26）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26 层、27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：（010）65051166

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

（27）宏信证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

办公地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客服电话：4008-366-366

网址：<http://www.hxzq.cn>

（28）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

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：0755-23835888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(29) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：王少华

客户服务电话：400-818-8118

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

(30) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

法定代表人：丁益

客户服务电话：400-6666-888

公司网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(31) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：张永衡

客户服务电话：95396

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

(32) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：何沛良

客户服务电话：0769-961122

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

(33) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

法定代表人：庞介民

客户服务电话：0471-4960762

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

(34) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客户服务电话：40080-96096

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

(35) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

办公地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(36) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；

上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际东塔 21 楼

法定代表人：杨华辉

客户服务电话：95562

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

(37) 浦领基金销售有限公司（原众升财富（北京）基金销售有限公司）

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人：李招弟

电话：400-876-9988

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(38) 嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

办公地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：夏林生

客户服务电话：0573-96528

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

(39) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、10、18、19、35、36、38、39-44 楼

法定代表人：孙树明

客户服务热线：95575

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

(40) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：陈照星

客户服务电话：0769-95328

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

(41) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

客服电话：95397

公司网站：<http://www.tpyzq.com>

(42) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

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

(43) 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：冯鹤年

客户服务电话：4006198888

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

(44) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

客户服务电话：40066-62288

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

(45) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市雁塔区高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法人代表：李刚

办公地址：西安市雁塔区高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

客户服务电话：95325

公司网址：<http://www.kysec.cn>

(46) 湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

客户服务电话：95351/400-888-1551

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

(47) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20

楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：4008000562

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

（48）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（49）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

办公地址：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

客户服务电话：（021）96250500

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

（50）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号

法定代表人：杨德红

客户服务电话：95521

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

（51）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

办公地址：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：95551/4008-888-888

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

（52）第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼



办公地址：广东省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

客户服务电话：95358

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

（53）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：王连志

客户服务电话：4008001001

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

（54）中信期货有限公司

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

客户服务电话：400-990-8826

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

（55）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

客户服务电话：95531

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

（56）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

客户服务电话：95525、4008888788

网站：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（57）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

客户服务电话：400-698-9898

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

（58）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：张建军

客户服务电话：400-8888-133

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

（59）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东楼 2 层

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

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

（60）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95321

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

（61）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(62) 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客户服务电话：95318

网址：www.hazq.com

(63) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

客户服务电话：95579

网址：www.cjsc.com.cn

(64) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：4008888001/95553

网址：www.htsec.com

(65) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(66) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

法定代表人：何之江

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(67) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918

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

(68) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

客户服务电话：0931-4890619

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

(69) 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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

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

(70) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心  
西面一层大堂和三、四层

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心  
西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

客服电话：0752-95564

网址：<http://www.lxsec.com>

(71) 上海通华财富基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 层

法定代表人：马刚

客服电话：95156

公司网址：www.tonghuafund.com

(72) 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

联系电话：025-66046166

(73) 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

住所：浙江省绍兴市柯桥区笛扬路 1363 号

法定代表人：俞俊海

联系电话：0575-81105323

传真号码：0575-81168501

(74) 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

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809

法定代表人：戎兵

网址：<http://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

(75) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

(76) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谱

联系电话：021-50701053

详见基金份额发售公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

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

法定代表人：朱学华

电话：（021）38969999

传真：（021）33627962

联系人：赵良

客户服务中心电话：40088-50099

## 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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507  
单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张青萌

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

#### 四、基金的名称

本基金名称：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

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

#### 六、基金的投资目标

通过投资于目标 ETF，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

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及其备选成份股，

把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。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）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、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）、同业存单、货币市场工具、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）。

基金管理人在履行适当程序后，本基金将根据法律法规的规定参与融资。

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：投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围会做相应调整。

## 八、基金的投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。



### 1、资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额，该部分资产占基金资产净值的比例不低于 90%。为更好地实现投资目标，本基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，且可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、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），其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

### 2、目标 ETF 投资策略

本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

### 3、股票投资策略

根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。

### 4、债券投资策略

基于流动性管理的需要，本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

### 5、股指期货投资策略

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

#### 6、权证投资策略

本基金在实现权证投资时，将通过权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。

#### 7、资产支持证券的投资策略

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。

#### 8、参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资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。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证 500 行业中性低波动指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。

由于本基金为 ETF 联接基金，投资组合中本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，并且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，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。因此，本基金业绩比较基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。其中，若变更业绩比较基准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业绩比较基准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。若业绩比较基准的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、基金的风险收益特征

本基金属于目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 15 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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 6 月 30 日。

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	36,370,109.18	92.86
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	2,641,079.34	6.74
8	其他各项资产	154,173.24	0.39
9	合计	39,165,361.76	100.00

### 2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	500 低波 ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	36,370,109.18	93.66

### 3 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 4 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 5 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投资。

#### 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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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。

#### 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 9 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投资。

#### 10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 10.1 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。

##### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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。

## 11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 11.2 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。

## 12 投资组合报告附注

12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	33,990.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	542.26
5	应收申购款	119,640.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,173.24

### 12.4 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。

## 12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2019 年 6 月 30 日）

#### 1. 华安中证 500 低波 ETF 联接 A

阶段	份 额 净 值 增 长 率①	份 额 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
自基金合同生效日（2019 年 1 月 15 日）至 2019 年 6 月 30 日	8.76%	1.60%	15.13%	1.71%	-6.37%	-0.11%

#### 2. 华安中证 500 低波 ETF 联接 C

阶段	份 额	份 额 净	业 绩 比	业 绩 比 较	①—③	②—④
----	-----	-------	-------	---------	-----	-----

	净 值 增 长 率①	值增长 率标准 差②	较 基 准 收 益 率 ③	基准收益 率标准差 ④		
自基金合同生效日（2019年1月15日）至2019年6月30日	8.20%	1.60%	15.13%	1.71%	-6.93%	-0.11%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

### 十三、费用概览

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

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

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

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 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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。

### （二）与基金销售有关的费用

#### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在投资者申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申

购费。

本基金对通过直销机构申购 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。通过直销机构申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率为每笔 500 元。其他投资人申购本基金 A 类基金份额的申购费率随申购金额的增加而递减；投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示：

费用种类	单笔申购金额（M，元）	申购费率
A类基金份额	M<100万	1.2%
	100万≤M<300万	0.8%
	300万≤M<500万	0.5%
	M≥500万	每笔1000元
C类基金份额	0	

申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## 2、赎回费用

本基金 A 类及 C 类基金份额的赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

份额类别	持有期限（Y）	赎回费率
A类基金份额	Y<7天	1.5%
	7天≤Y<1年	0.5%
	1年≤Y<2年	0.25%
	Y≥2年	0
C类基金份额	Y<7天	1.5%
	7天≤Y<30天	0.50%
	Y≥30天	0

注：1年指365天，2年为730天，依此类推。

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，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全

额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者，本基金将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

4、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。

### （三）其他费用

- 1、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 2、《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；
- 3、基金份额持有人大会费用；
- 4、基金的证券、期货交易费用；
- 5、基金的银行汇划费用；
- 6、基金的开户费用、账户维护费用；
- 7、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。

### （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的各纳税主体，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：

本次基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》和《托管协议》，更新了招募说明书重要提示、绪言、释义、基金管理人、相关服务机构、基金份额的申购、赎回与转换、基金资产的估值、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、基金合同的变更、终止与基金财产的清算、基金合同内容摘要、基金托管协议内容摘要、招募说明书存放及查阅方式等相应的内容，详见更新的招募说明书。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年三月七日