

## 汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年02月05日

送出日期：2024年02月06日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	上证券商	基金代码	510200
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	基金托管人	兴业证券股份有限公司
基金合同生效日	2020年04月09日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2020年05月08日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个交易日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
陈思余	2023年10月25日	2017年04月05日	
	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止《基金合同》等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

## 二、基金投资与净值表现

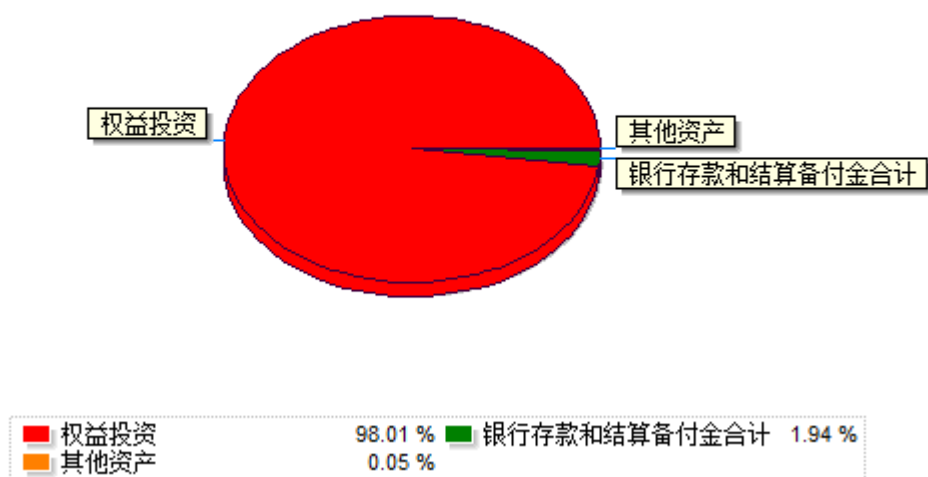
## (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，力求实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、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、超短期融资券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、货币市场工具、股票期权、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。

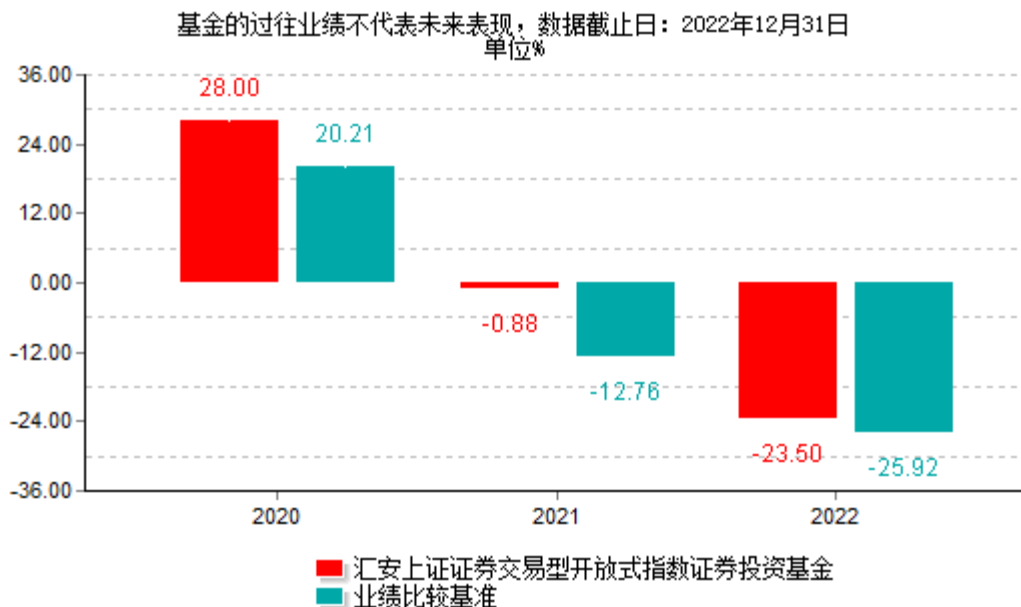
	<p>在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。因法律法规的规定而受限的情形除外。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成分股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。当出现特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可采取其他指数投资技术进行基金投资组合的适当调整，以实现紧密跟踪标的指数的投资目标。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、资产支持证券的投资策略</p> <p>4、衍生品投资策略</p> <p>5、融资及转融通证券出借</p> <p>6、存托凭证投资策略</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金的标的指数为上证证券行业指数，业绩比较基准为上证证券行业指数收益率。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2023年06月30日



（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日为2020年4月9日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

#### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.50%
托管费	0.10%

1、本基金以下费用，按实际发生额从基金资产扣除：

- （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）基金上市费及年费；
- （6）基金的银行汇划费用；
- （7）基金的相关账户的开户及维护费用；
- （8）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。

## 2、指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数供应商签署的指数使用许可协议的约定，从基金财产中支付。指数许可使用费自基金合同生效日起累计，累计计提的指数许可使用费取以下A)、B)中的孰高者：

A) 按照指数使用许可协议规定的费率，以前一日基金资产净值为基础计算并进行计提金额的累计值：

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

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

B) 按照指数使用许可协议规定的每季度指数许可使用费收取下限。当季日均基金资产净值（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）大于人民币5000万元时，本基金季度指数许可使用费下限金额为35000元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算（当季指数许可使用费下限金额=35000÷当季天数×基金当季存续天数）。当季日均基金资产净值小于或等于人民币5000万元时，无指数许可使用费收取下限。

指数许可使用费按日计提，逐日累计至每个季季末，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起3个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费，无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

## 四、 风险揭示与重要提示

### （一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、投资于本基金的主要风险：市场风险、信用风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特有风险、流动性风险、基金管理人职责终止风险及其他风险。

2、投资于本基金的特定风险：

（1）指数化投资风险

1) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，从而导致标的指数波动，使基金收益水平发生变化。当标的指数下跌时，本基金将面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2) 标的指数的流动性风险

当市场流动性不足或本基金标的指数成份股出现停牌等投资受限情况时，本基金将可能无法获得足够数量的股票或进行股票的立即变现，从而导致本基金的跟踪误差扩大及流动性风险的增加。

3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能导致基金投资组合回报与标的指数回报发生偏离：

a、基金为应对日常赎回保留的少量现金、投资运作过程中发生的交易成本以及基金管理费、托管费等费用将使基金投资组合与标的指数产生跟踪误差；

b、标的指数成份股调整，或成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，本基金在相应的组合调整中将可能出现暂时性的跟踪误差的扩大；

c、标的指数成份股因出现停牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差；

d、在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力如跟踪技术手段、买入卖出时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

#### 4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 5) 标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

#### 6) 标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更标的指数并调整基金的业绩比较基准，基金投资组合将随之调整，届时基金的风险收益特征将可能发生变化，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 7) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

### (2) 基金运作的特有风险

#### 1) 上市交易风险

本基金在基金合同生效后，基金份额可在上海证券交易所上市交易，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足而产生本基金上市份额的流动性风险；另外，在不符合上市交易要求或本基金所约定的特定情况下，本基金基金份额存在暂停上市或终止上市的可能。

#### 2) 基金份额二级市场交易价格折/溢价交易风险

尽管基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

### 3) 参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算还可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

### 4) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

a、基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

b、停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

c、若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

d、在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分ETF份额的风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

### 5) 投资者申购失败的风险

基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

### 6) 投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

### 7) 基金份额赎回对价的变现风险

基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

### 8) 基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

#### 9) 第三方服务机构的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

申购赎回代理机构因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

- (3) 金融衍生品投资风险
- (4) 资产支持证券投资风险
- (5) 参与融资与转融通业务的风险
- (6) 存托凭证投资风险

### （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

### 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.huianfund.cn](http://www.huianfund.cn)][010-56711690]

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书、上市交易公告书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

### 六、 其他情况说明

无。