上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2014年第1号

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2012年9月13日证监许可[2012]1224号文核准募集。本基金基金合同于2013年3月28日正式生效。

基金管理人保证本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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为发起式基金，在基金募集时，基金管理人股东将运用其自有资金认购本基金的金额不低于1000万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人股东认购的基金份额持有期限满三年后，基金管理人股东将根据自身情况决定是否继续持有，届时，基金管理人股东有可能赎回其认购的本基金份额。另外，在基金合同生效之日起三年后的对应日，如果本基金的资产规模低于2亿元，基金合同将自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。基金管理人股东的认购行为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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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管理风险，某一基金的特定风险等。本基金是股票基金，风险和收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2014年3月28日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2013年12月31日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座12层
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：杨明辉
联系人：崔雁巍
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元，公司股权结构如下：

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
合计	100%

（二）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基本情况
杨明辉先生：董事长，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事总经理、党委委员。曾任纺织部北京纺织机械研究所工程师、室副主任，中信兴业信托投资公司纺织处项目经理，中国国际信托投资公司证券部项目经理，中信证券北京营业部副总经理，中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁并兼任中信证券董事、中信信托董事、信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁。
杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。
胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。
徐刚先生：董事，博士，经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人，兼任中信万通证券、中信期货、前海股权交易中心、青岛蓝海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部，曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部，担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。
葛小波先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、计划财务部行政负责人。曾任中信证券股份有限公司投资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部（现交易与衍生产品业务部）行政负责人。
滕天鸣先生：董事、总经理，硕士。曾任机构理财部总经理、公司总经理助理、公司副总经理等。
朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师、系副主任，兼任北京建设（香港上市）及华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信三家内地上市公司的独立董事，中国金融学会常务理事。
贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。
谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任北京超图软件股份有限公司（上市公司）、同方环境股份有限公司、北京双杰电气股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会财务成本分会第七届理事会副会长。曾任清华大学经济管理学院会计学讲师、副教授。
吴志军先生：副总经理，学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。
林浩先生：副总经理、投资决策委员会主席，硕士。曾任公司总经理助理等。
方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。
李红源先生：监事会召集人，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。
罗楚良先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东省农村经济开发投资公司总经理（法定代表人）、党委副书记，兼任山东高速投资控股有限公司法定代表人、总经理，山东高速环球融资租赁有限公司法定代表人、执行董事兼总经理，山东高速路桥集团股份有限公司董事。曾任山东省交通厅政策法规处副主任科员、主任科员，山东省交通厅外事外经处副处长，山东基建股份有限公司董事、副总经理，山东高速股份有限公司董事、常务副总经理。
吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。
刘义先生：监事，工商管理硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、养老金业务总监。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司工会主席、党办主任、养老金部总经理等。
查尔斯?西姆斯先生：监事，学士，注册会计师。现任万信基金公司总裁兼首席执行官，IGM基金公司联席总裁兼首席执行官。曾任职于加拿大多伦多市的Coopers and Lybrand公司，曾任富勤谭普顿投资公司在加拿大多伦多分支机构的首席财务官和销售与营销主管，富勤谭普顿投资公司加和福尼亚州国际总部副总裁、公司行政总裁，另外，曾任职于FundSERV公司董事会，并曾担任加拿大投资基金协会（IFIC）董事会成员、理事会成员。
康茜女士：监事，法学和金融学双学士。现任华夏基金管理有限公司纪律检查委员会委员、法律监察部总经理，兼任华夏资本管理有限公司常务副总经理。曾任中国工商银行北京分行法律部、证券监管部门主任科员，华夏基金管理有限公司成都分公司总经理。
刘文灿先生：监事，工商管理硕士。现任华夏基金管理有限公司人力资源总监。曾任原北京市二商局干部，中国国际贸易促进委员会干部，华夏基金管理有限公司财务部总经理、办公室主任、稽核总监等。
王芬华女士：监事，经济学学士。现任华夏基金管理有限公司人力资源部副总经理。曾任北京NTT DATA人力资源部职员，华夏基金管理有限公司人力资源部总经理助理等。
2、本基金基金经理
张弘弢先生，硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等，现任数量投资部副总经理，华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012年8月21日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年12月25日起任职）、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）。
3、本公司投资决策委员会（股票投资）成员
滕天鸣先生：华夏基金管理有限公司董事、总经理。
林浩先生：华夏基金管理有限公司副总经理。
阳耀先生：华夏基金管理有限公司投资总监、股票投资部副总经理，华夏兴华混合型证券投资基金基金经理、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理。
王海雄先生：华夏基金管理有限公司首席投资官，华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理、华夏回报证券投资基金基金经理、华夏回报二号证券投资基金基金经理。
童汀先生：华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理，华夏成长证券投资基金基金经理。
谭琦先生：华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理，华夏红利混合型证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
孙彬先生：华夏基金管理有限公司投资研究部总监，华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）基金经理、华夏大盘精选证券投资基金基金经理。
4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）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：王洪章
成立时间：2004年9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：010-67595096
中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋升恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250，010，977，486股（包括240，417，319，880股H股及9，593，657，606股A股）。
截至2013年12月31日，中国建设银行资产总额153，632.10亿元，较上年增长9.95%；客户贷款和垫款总额85，900.57亿元，增长14.35%；客户存款总额122，230.37亿元，增长7.76%。营业收入5，086.08亿元，较上年增长10.39%，其中，利息净收入增长10.29%，净利息收益率(NIM)为2.74%；手续费及佣金净收入1，042.83亿元，增长11.52%，占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制，成本收入比为29.65%。实现利润总额2，798.06亿元，较上年增长11.28%；净利润2，151.22亿元，增长11.12%。资产质量保持稳定，不良贷款率0.99%，拨备覆盖率268.22%；资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%，保持同业领先。
中国建设银行在中国内地设有分支机构14，650个，服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户，与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系；在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、纽约曼哈顿市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。
2013年，本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外102项奖项，多项综合排名进一步提高，在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5，较上年上升2位；在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中，位列第2，较上年上升13位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。
中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220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
杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
郑绍平，投资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，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。
黄秀蓬，投资托管业务部副总经理，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。
（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、QFII、企业年金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2013年12月31日，中国建设银行已托管349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。中国建设银行自2009年至2012年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构
1、申购赎回代理券商
（1）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：芮敏祺
网址：www.gtja.com
客户服务电话：400-888-8666
（2）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：400-888-8108
传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc.com.cn
（3）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：95536
（4）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：黄健
网址：www.newone.com.cn
客户服务电话：400-888-8111，95565
（5）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
电话：020-87555888
传真：020-87555417
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
（6）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010-60833722
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com
客户服务电话：95548
（7）中国银河证券股份有限公司
住所：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：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn
客户服务电话：400-888-8888
（8）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号10楼
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-63410456
联系人：金芸、李笑鸣
网址：www.htsec.com
客户服务电话：021-962503，400-888-8001或拨打各城市营业网点咨询电话
（9）申银万国证券股份有限公司
住所：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：储晓明
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李清怡
网址：www.sywg.com
客户服务电话：95523、400-889-5523
（10）安信证券股份有限公司
住所：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、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn
客户服务电话：400-800-1001
（11）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人：沈强
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
联系人：李珊
网址：www.bigsun.com.cn
客户服务电话：95548
（12）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：深圳市深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人：吴万善
电话：0755-82492193
传真：025-51863323（南京）、0755-82492962（深圳）
联系人：庞晓芸
网址：www.htsc.com.cn
客户服务电话：95597
（13）中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn
客户服务电话：0532-96577
（14）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
电话：010-63081000
传真：010-63080978
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：400-800-8899
（15）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169081
传真：021-22169134
联系人：刘晨
网址：www.ebscn.com
客户服务电话：95525、400-888-8788
（16）中国国际金融有限公司
住所：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27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65058065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166
（17）中国中投证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
联系人：刘毅
网址：www.china-invs.cn
客户服务电话：400-600-8008，95532
2、二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。
3、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销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。
（二）登记结算机构
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
法定代表人：金颖
联系人：陈文祥
电话：021-68419095
传真：021-68870311
（三）律师事务所
名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人：王立华
联系电话：010-57763888
传真：010-57763777
联系人：吴冠雄
经办律师：王立华、吴冠雄
（四）会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层
办公地址：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
执行事务合伙人：吴港平
联系电话：010-58153000
传真：010-85188298
联系人：边卓群
经办注册会计师：边卓群、濮晓达

四、基金的名称

本基金名称：上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式。

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，以期获得与标的指数收益相似的回报。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、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。
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。
基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。
为有效管理投资组合，基金可投资于股指期货、权证等衍生工具。
本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。
未来，根据市场情况，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为标的指数。本基金的标的指数为上证能源行业指数。
若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

十一、基金投资组合报告

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根据本基金合同规定，于2014年1月16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2013年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。
（一）报告期末基金资产组合情况
金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	138,985,998.23	96.63
	其中：股票	138,985,998.23	96.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,618,279.14	3.21
6	其他各项资产	228,783.95	0.16
7	合计	143,833,061.32	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	112,045,200.18	78.04
C	制造业	7,792,125.51	5.43
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	3,608,821.44	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	15,539,851.10	10.82
	合计	138,985,998.23	96.81

（三）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
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	1,292,910	20,453,836.20	14.25
2	600256	广汇能源	1,778,015	15,539,851.10	10.82
3	601857	中国石油	1,956,033	15,081,014.43	10.50
4	600028	中国石化	3,178,316	14,238,855.68	9.92
5	600583	海油工程	1,123,028	8,714,697.28	6.07
6	601808	中海油服	348,140	7,770,484.80	5.41
7	601699	潞安环能	517,074	5,517,179.58	3.84
8	601898	中煤能源	1,055,155	5,033,089.35	3.51
9	600348	阳泉煤业	695,941	4,913,343.46	3.42
10	600123	兰花科创	395,617	4,221,233.39	2.94

（四）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。
（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
（八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
2、本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。
（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1、本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
3、本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
（十）投资组合报告附注
1、2013年11月24日中国石化公告了中国政府派出的事故调查组调查的有关情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，中国石化系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。
2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、期末其他各项资产构成
单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,444.60
2	应收证券清算款	222,372.50
3	应收股利	-
4	应收利息	966.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,783.95

4、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。
5、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不存在流通受限情况。
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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做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。

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
2013年3月28日至2013年12月31日	-21.80%	1.38%	-30.30%	1.51%	8.50%	-0.13%

十三、费用概览

（一）基金运作费用的种类
基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：
1、基金管理人的管理费。
2、基金托管人的托管费。
3、基金上市初费及年费。
4、标的指数许可使用费
5、基金财产拨划支付的银行费用。
6、基金收益分配中发生的费用。
7、基金合同生效后的基金信息披露费用。
8、基金份额持有人大会费用。
9、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费。
10、基金的证券交易或结算产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费及其他类似性质的费用等）。
11、基金的开户费用、账户维护费用
12、依法可以在基金财产中列支的其他费用。
在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。
（二）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。
（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
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
2、基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
3、标的指数许可使用费
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指数许可方签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计提，按季支付。计算方法如下：
H＝E×0.03%÷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。
标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币1万元。
基金合同生效当年不足3个月的按3个月收费。
如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。
4、除管理费、托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。
（四）不列入基金费用的项目
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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于2013年11月12日刊登的本基金招募说明书（更新）进行了更新，主要更新内容如下：
（一）更新了“三、基金管理人”中相关内容。
（二）更新了“五、相关服务机构”中相关内容。
（三）更新了“九、基金份额的申购与赎回”中“申购赎回清单的格式”。
（四）更新了“十、基金的投资”中“基金投资组合报告”相关内容，该部分内容均按有关规定编制。
（五）更新了“十一、基金的业绩”的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
（六）更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”中相关内容。
（七）更新了“二十三、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二〇一四年五月九日

华安基金管理有限公司
关于安顺证券投资基金终止上市的提示性公告

华安基金管理有限公司已于2014年5月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）发布了《关于安顺证券投资基金终止上市的公告》。为了保障安顺证券投资基金持有人的利益，现发布安顺证券投资基金终止上市的提示性公告。

一、终止上市基金的基本信息
基金简称：基金安顺
交易代码：500009
基金类型：契约型封闭式基金