

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2014年第2号)

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司
二〇一四年十二月

重要提示

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照相关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2010年9月11日《关于核准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募集的批复》(证监许可【2010】1203号)核准。本基金基金合同自2010年11月18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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会备案。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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认同基金合同的约定和接受,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。基金投资人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。

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。

本招募说明书摘要截止日为2014年11月18日,有关财务数据截止日为2014年9月30日,净值表现截止日为2014年6月30日。

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:上海浦东新区世纪大道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:中国证监会证监基金字【1998】20号
- 6.联系电话:(021)38969999
- 7.联系人:王艳
- 8.客户服务电话:40088-50099
- 9.网址:www.huawen.com.cn
- (二)注册资本及股权结构

持股比例	持股比例及股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气(集团)总公司	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的姓名、从业经历、学历及兼职情况等。

(1)董事会

朱学华先生,大专学历。历任上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理并兼任海际和大证券有限责任公司董事长,现任华安基金管理有限公司董事长、法定代表人,党总支书记,同时代行公司总经理职务。

冯祖新先生,研究生学历。历任上海市经济委员会信息中心副主任、主任,上海市工业投资公司副总经理、总经理,上海工业投资(集团)有限公司副总裁、党委副书记。现任上海工业投资(集团)有限公司执行董事(法定代表人)、总裁、党委书记。

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,上海东方上市公司博览中心副总经理。现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理,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长、长江养老保险股份有限公司董事、史带财产保险股份有限公司董事、上海国际信托有限公司监事。

董耀华先生,大学学历,高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科、副处长、处长,上海市审计局财政审计处处长,现任上海电气(集团)总公司财务总监。

王松先生,研究生学历,高级经济师。历任建设银行总行投资部职员,国泰证券有限公司北京办事处副主任、发行一部副经理、债券部总经理,国泰君安证券股份有限公司债券业务一部总经理、固定收益证券总部总经理、固定收益证券总部总监、总裁助理,现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

独立董事:

萧灼基先生,研究生学历,教授。历任全国政协委员,政协经济委员会委员,北京大学经济学院教授,博士生导师,北京市、云南省、吉林省、成都市、武汉市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社长、主编。

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规划科科长、上海市第一律师事务所律师、上海市金茂律师事务所律师、上海市律师协会副会长。现任上海市金融律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生,研究生学历,教授。现任上海商学院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公司委员会、享受国务院政府津贴。

(2)监事会

张志红女士,经济学博士。历任上海证券监管机构副处长,中国证监会上海监管局机构监管一处处长、上市公司监管一处处长,长城证券有限责任公司副总经理、党委委员、纪委书记、合规总监,现任国泰君安证券总裁助理、投行业务委员会副总裁、华安基金管理有限公司监事会主席。

陈毓女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部副科长、科长,现任上海国际信托有限公司投资管理总部高级经理。

柳彬先生,硕士研究生,高级经济师。历任上海良工阀门厂副厂长、上海机电工业管理局规划处处长,上海电机(集团)有限公司董事,上海电气(集团)总公司副总裁,兼:上海电气资产管理有限公司总裁、上海机电股份有限公司党委书记、总经理,上海集友机械股份有限公司董事长,上海工业装备研究所所长。现任中国电器工业协会工业锅炉分会五届理事常务理事。

章立卫先生,大学学历,会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科长、外经处会计主管,英国 SONOFEC 公司(长仕伦敦)业务经理,上海有色金属总公司房产公司财务部经理、办公室主任,上海工业投资(集团)有限公司财务部业务主管、副经理,现任上海工业投资(集团)有限公司财务部副经理。

李梅清女士,大学学历,经济师。历任上海新亚(集团)股份有限公司财务部副经理,上海新亚(集团)有限公司财务部副经理,锦江国际(集团)有限公司计划财务部副经理及上市公司副经理,上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

汪宝山先生,大学学历,经济师。历任建行上海市分行团委书记、直属党委书记,建行宝山宝钢支行副行长、建行上海市分行办公室副主任,国泰证券公司综合管理部总经理,公司专职党委副书记兼行政管理部总经理,公司专职党委副书记并兼上海营业总部总经理,国泰君安证券专职董事、党委书记、机关党委书记,公司党委办公室主任,工会主席,国泰君安投资管理股份有限公司董事长、党委书记、国泰君安证券股份有限公司党委委员。

赵敏女士,研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

请慧女士,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、集中交易部总监助理,现任华安基金管理有限公司集中交易部总监。

(3)高级管理人员

朱学华先生,大专学历。历任上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理并兼任海际和大证券有限责任公司董事长,现任华安基金管理有限公司董事长、法定代表人,同时代行公司总经理职务。

尚志民先生,研究生学历,17年证券、基金从业经验。曾在上海证券研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司先后担任公司研究发展部高级研究员,1999年月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理,2000年7月至2001年9月同时担任安顺证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理,2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理,2006年9月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。

秦军先生,研究生学历,15年证券、基金从业经验,曾任中国航空工业规划设计研究院建设监理部总经理助理,中咨华安投资管理有限公司北京分公司总经理,嘉实基金管理有限公司总经理助理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生,研究生学历,26年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海大学会计师事务所会计、中国诚信证券评估师协会上海分公司副总经理、上海虹汇(集团)有限公司财务部副部长(主持工作)、上海虹信投资管理有限公司副总经理兼上海鑫鑫投资有限公司财务总监、华安基金管理有限公司督察长,现任华安基金管理有限公司副总经理。

章威先生,博士研究生学历,13年证券、基金从业经验。曾任上海证券有限责任公司研究发展部中心门总经理,中国证监会上海监管局信息调研处处长,中国证监会上海监管局科技工作处处长,现任华安基金管理有限公司督察长。

2.本基金基金经理

现任基金经理:

牛勇先生,复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),10年证券金融从业经历,曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年6月加入华安基金管理有限公司后历任投资管理部与金融工程部高级金融工程师,2009年7月至2010年9月担任MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2010年9月起担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010年9月起同时担任华安MSCI中国A股指数增强证券投资基金的基金经理。2010年11月起同时担任本基金及联接基金的基金经理。2012年6月起同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理。

历任基金经理:

徐之彦先生,自2010年11月18日至2012年12月22日担任本基金基金经理。

陈宜宣先生,自2010年11月18日至2012年12月22日担任本基金基金经理。

3.本公司采用集体投资决策制度,投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

朱学华先生,董事长、党总支书记、代行公司总经理职务

尚志民先生,副总经理、首席投资官

章国富先生,基金投资决策部高级投资部高级总监、基金经理

杨明先生,投资研究部高级总监

陈之先生,指数投资部高级总监

贺 蔚先生,指数收益部副总监、基金经理

陈辉女士,基金投资决策部副总监、基金经理

上述人员均不存在关联关系。

4.业务人员的准备情况

截至2014年9月30日,公司目前共有员工298人,主要来自国内外证券公司等金融机构,其中91.7%以上具有三年证券业务五年金融从业工作经历,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。公司业务涉及投资研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

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
成立日期:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-66106799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2013年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工176人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有以上学历或高级职称。

(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丰富、成熟、健全的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、养老金资产、企业年金基金、ODI资产、ODI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、ODI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,以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年12月,中国工商银行共托管证券投资基金368只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《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》等海内外权威财经媒体评选的41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)基金份额发售机构及其联系人

1、申购赎回代办证券公司(简称“一级交易商”):

- (1) 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:上海市银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
电话:(021)38676798
传真:(021)38676798
客户服务电话:400-8889-666
网址:www.gtja.com

(2) 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:北京市朝阳区朝门内大街188号
法定代表人:王常青
电话:(010)65183888
传真:(010)65182261
客户服务电话:400-8888-108,95587
网址:www.csc108.com

(3) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路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国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
电话:(0755)82130832转8121
传真:(0755)82133852
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(4) 招商证券股份有限公司
注册地址: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38—45层
法定代表人:肖吕林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82944669
客户服务热线:95565
网站:www.newone.com.cn

(5) 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:陈有安
电话:(010)66568847
传真:(010)66568536
客户服务电话:4008-888-888-988
网址:www.chinastock.com.cn

(6) 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:王开国
电话:(021)23219000
传真:(021)63410627
客户服务电话:400-8888-001,95553
网址:www.htsec.com

(7) 申银万国证券股份有限公司
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:陈健刚
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
客户服务电话:(021)96250505
网址:www.sywg.com

(8) 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
上海市浦东新区民生路1199弄东方大道1号广场1号楼
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419667
客户服务电话:95662
网址:www.xyzq.com.cn

(9) 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:杨泽汉
电话:400-8888-999
客户服务电话:95579
网址:www.cjzc.com

(10) 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:牛兴证
电话:(0755)82565651
传真:(0755)82565656
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

(11) 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:余维佳
电话:023-63786433
传真:023-63786477
客户服务电话:40080-96096
网址:www.swsc.com.cn

(12) 山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心A座26—30层
法定代表人:侯巍
电话:(0351)8686966
传真:(0351)8686667
客户服务电话:95573
网址:www.sxjq.net

(13) 东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)B座12、15层
法定代表人:魏庆华
电话:(010)66555171
传真:(010)66555397
客户服务电话:(010)66555835
网址:www.dxzq.net.cn

(14) 东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市工业园区星阳街5号
办公地址:苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
电话:(0512)62915555
传真:(0512)62938832
客户服务电话:40080001555
网址:www.dwzq.com.cn

(15) 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
客户服务电话:400-900-8899
网址:www.cindasc.com

(16) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层、32层、36层、40层
法定代表人:潘鑫军
电话:(021)63325888
传真:(021)63326010
客户服务电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

(17) 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14、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14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:(0755)83516094
传真:(0755)83516199
客户服务电话:400-6666-888
公司网站:www.cgws.com

(18) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:张捷
电话:(021)53519888
传真:(021)53519888
客户服务电话:4008918918
网址:www.shzq.com

(19) 国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市金融一街8号
办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号,国联金融大厦7-9楼
法定代表人:朱惠明
电话:(0510)82231662
传真:(0510)82290162
客户服务电话:(0510)82588168
网址:www.glsc.com.cn

(20) 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新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:李海荣
电话:(0471)4913998
传真:(0471)4930707
客户服务电话:(0471)4961259
网址:www.cnht.com.cn

(21) 齐鲁证券有限公司
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
传真:(0531)68889752
客户服务电话:95536
网址:www.qlzq.com.cn

(22) 中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩大道1619号南昌国际金融中心A座41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号南昌国际金融中心A座41层
法定代表人:王宜四
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
客户服务电话:4008968667
网址:www.avicsec.com

(23) 德邦证券股份有限公司

注册地址:上海市曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人:魏文举
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008898128
网址:www.tebon.com.cn

(24) 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155号7-8层
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路155号7-8层
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
客户服务电话:96326
网址:www.hfzq.com.cn

(25) 红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人:况雨桐
电话:(0871)3577930
传真:(0871)3578827
客户服务电话:(0871)63577930
网址:www.hongtaazq.com

(26) 日信证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
办公地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
电话:(0471)6292587
传真:(0471)6292477
网址:www.rxzq.com.cn

(27) 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:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:(0451)82233863
传真:(0451)82227121
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn

(28) 华证证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心67层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心67层
法定代表人:陈林
电话:(021)50122107
传真:(021)50122078
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhtstock.com

(29) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
电话:(027)87618889
传真:(027)87618863
客户服务电话:(028)86712334
网址:www.tfzq.com

(30) 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市江干区解放东路29号迪凯银座22、23楼
办公地址:浙江省杭州市江干区解放东路29号迪凯银座22、23楼
法定代表人:沈强
联系电话:(0571)87112510
传真号码:(0571)85783771
客户服务电话:95548
网址:www.bjzq.com.cn

二、二级市场交易代办证券公司
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。
(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:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
电话:(021)68870676
客户服务电话:95579
联系人:李健

(三) 律师事务所和经办律师
名称: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
负责人:韩炯
电话:(021)31258666
传真:(021)31258606
联系人:秦悦民

经办律师:秦悦民、王利民
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼
首席合伙人:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:傅琛慧
经办会计师:李健、傅琛慧

四、基金名称

五、基金的类型

本基金名称:上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

本基金类型:股票型基金,指数基金。

运作方式:交易型、开放式。

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

六、基金的投资目标

本基金主要投资标的指数的成份股、备选成份股。为更好实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股、新股、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,权证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。

(一) 投资策略

本基金采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份股票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择投资非成份股证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

(二) 投资管理

1. 投资决策依据
(1) 法律法规和《本基金合同》的有关规定;
(2) 标的指数编制、调整等相关规定;
(3) 对证券市场发展趋势的研究与判断。

2. 投资决策机制
本基金管理人实行三级决策体系下的基金投资决策制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资执行小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明确和运作规范。投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,投资执行小组是基金投资决策机构和中间桥梁,投资执行小组由基金经理、研究发展部、固定收益机构的人员及业务骨干组成。基金经理采取适当的方法,以降低运营成本、控制投资风险。

3. 投资管理程序
研究支持、投资决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机结合共同构成本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1) 研究支持:金融工程部依托公司整体研究平台,整合外部研究机构的研究成果开展标的指数跟踪,通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析,进行基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策:投资决策委员会依据金融工程部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建:根据标的指数的构成,结合研究支持,基金经理以完全复制指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低运营成本、控制投资风险。

(4) 交易执行:集中交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5) 绩效评估:金融工程部定期和不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估,并对风险隐患提出预警。绩效评估能够确定组合是否实现了投资目标,组合实际的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数的变动,结合成份股本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,采取适当的跟踪策略对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(7) 合规监控:合规与监察稽核部对整个投资管理流程进行实时监控。
基金管理人应确保基金运作符合法律法规规定和实际需要,对上述投资管理程序做出调整,并在基金招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数,即上证龙头企业指数。

如果中证指数有限公司变更或停止上证龙头企业指数的编制及发布,或上证龙头企业指数由其他指数替代、或由其他编制方法导致重大变更导致上证龙头企业指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后,有权变更本基金的标的指数,并相应地变更业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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、基金投资组合报告

基金管理人的董事及董事兼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2014年10月20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。

本报告投资组合报告所载数据截至2014年6月30日。