

中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
重要提示
 本基金经2013年6月6日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】750号文核准募集。本基金基金合同于2013年8月23日正式生效。
 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。
 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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。
 投资有风险，投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、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，基金管理人存在基金投资管理过程中产生的基金管理人风险，本基金的特有风险等。
 本基金是跟踪中证金融地产指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数变动的风险、基金投资组合回报与标的指数的跟踪偏离的风险、基金资产净值下跌的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金估值调整对价的价格折损风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。
 本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金标的指数的组成成分证券横跨沪深及上海两个证券交易所，本基金的申购、赎回流程采用组合证券“深圳+上海申购、赎回”的模式进行，其申购、赎回流程与组合证券“深圳或上海申购、赎回”的ETF产品有所不同。通常情况下，投资者的申购、赎回申请在T+1日确认，申购所得ETF份额及赎回所得组合证券在T+2日可用，如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，则应同时并在使用深圳A股账户与上海A股账户。且该两个账户的证件号码及名称须与同一投资者所有，同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的非托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。

本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（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引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。
 本摘要根据基金招募说明书及本基金的基金招募说明书编写，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。本基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受，并接受《基金法》、基金合同及其他有关规范性文件约束。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书更新截止日为2015年8月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日，有关基金管理人内容截止于招股公告日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人简介
 名称：汇添富基金管理股份有限公司
 住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
 办公地址：上海市黄浦区99号震旦国际大楼22楼
 法定代表人：李文
 成立日期：2005年2月3日
 批准设立机关：中国证监会
 批准设立文号：证监基金字[2005]5号
 注册资本：人民币1亿元
 联系人：李婧
 联系电话：（021）28932888
 股东名称及其持股比例：

东方证券股份有限公司	47%
文汇新民联合报业集团	26.5%
东航金融控股有限公司	26.5%

（二）主要人员情况
 1. 董事会成员
 李文先生，董事长，国籍：中国，1967 年出生，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长、汇添富资本管理有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行厦门市支行银行监管一处、二处副处长，东方证券股份有限公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。
 肖顺喜先生，董事，国籍：中国，1963年出生，复旦大学EMBA。现任东航金融控股有限公司总经理、东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股（香港）有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理，东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。
 李翔先生，董事，国籍：中国，1971 年出生，复旦大学新闻学学士。现任上海报业集团经营管理办公室主任，历任文汇报经济部副主任，主任，文汇报专刊部主任，文汇报联合报业集团经济管理编辑部主任、主任。
 张晖先生，董事、总经理，国籍：中国，1971年出生，上海财经大学数量经济学硕士。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主任，曾任中国证券监督管理委员会第十和第十一届发行审核委员会委员，现任汇添富基金管理股份有限公司总经理。

韦夫杰（Jeffrey R. Williams）先生，独立董事，国籍：美国，1963年出生，哈佛大学商学院工商管理硕士，哈佛大学肯尼迪政府学院艾什门士治理与创新中心高级研究学者。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长，美国运通银行台湾分行副总裁，台湾美国运通国际股份有限公司副总裁，渣打银行台湾分行总裁，深圳发展银行行长，哈佛大学中心董事总经理。
 林志军先生，独立董事，国籍：中国香港，1965年出生，厦门大学经济学博士，加拿大Saskatchewan大学工商管理学硕士。现任万科科技大学商学院教授、教授、博导，历任福建省科学技术委员会财务处会计，五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured)，香港大学商学院访问教授，香港都会大学商学院会计与法律系教授、博导，系主任。
 杨薇女士，独立董事，国籍：中国，1971年出生，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员，《第一财经日报》创刊编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人，《波士堂》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者，《第一财经日报》编委，2002—2003年期间受邀成为约翰·霍普金斯大学访问学者。

2. 监事会成员
 任理良先生，监事会主席，国籍：中国，1963年出生，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称，现任上海报业集团上海上投资产管理股份有限公司副总经理。历任文汇报新民联合报业集团财务处主管，文汇报新民联合报业集团上海新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。
 王如富先生，国籍：中国，1973年出生，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司证券事务代表、董事会办公室主任。历任申银万国证券股份有限公司证券事务代表、董事会办公室主任，立信证券计划财务部综合计划部主管、发展计划部办公室主任，金信证券计划发展部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券股份有限公司证券战略部高级研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海龙先生，国籍：中国，1978年出生，国际金融硕士。现任东航金融控股有限公司总经理兼东航集团财务管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。
 王静女士，职工监事，国籍：中国，1977年出生，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金融控股有限公司研究发展部。

林旋女士，职工监事，国籍：中国，1977年出生，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室、汇添富。

陈杰先生，职工监事，国籍：中国，1979年出生，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室总监助理。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

3. 高管人员
 李文先生，董事。（简历请参见上述董事会成员介绍）
 张晖先生，董事、总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）
 刘灿辉先生，副总经理，国籍：中国，1967年出生，大学本科，历任中国软件件开发工程经理，招银电银有限公司证券投资基金部负责人，华夏基金管理有限公司资深高级经理，招商基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理，2008年7月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理、首席营运官、汇添富资本管理有限公司董事。

雷儒捷先生，副总经理，国籍：中国，1971年出生，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

姜淼女士，副总经理，国籍：中国，1971年出生，金融经济硕士。曾在赛格国际信托投资公司任职，华夏证券股份有限公司，嘉实基金管理有限公司，招商基金管理有限公司，华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资理财、证券业务研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，副总经理，国籍：中国，1972年出生，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理。

李鹏先生，督察长，国籍：中国，1978年出生，上海财经大学经济学博

士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4. 基金经理
 （1）现任基金经理
 吴振翔先生，国籍：中国，1977年出生，中国科学技术大学管理学博士，中国科学院数学与系统科学院应用数学专业硕士，9年证券从业经验。曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员，上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理，数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理，2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2013年8月23日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理，2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费多因子股票基金的基金经理。

过蓓蓓女士，国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，4年证券从业经验。曾任国泰基金管理有限公司金融工程助理分析师，量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015年8月3日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理，2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。

（2）历任基金经理
 汪洋先生，2013年9月13日至2015年1月6日任汇添富中证金融地产ETF基金的基金经理。
 5. 投资决策委员会
 主席：张晖先生（总经理）
 成员：韩贤旺先生（研究总监）、陈晓刚（股票投资副总监）、王翔（股票投资副总监）、陆文斌（固定收益投资总监）
 6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

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
 住所：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：姜建清
 注册资本：人民币6149, 018, 546, 827元
 联系人：刘为民
 电话：010-63405799

（二）主要人员情况
 截至2015年3月末，中国工商银行托管部共有员工203人，平均年龄30岁，96%以上为理工科以上学历，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事业单位提供安全、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、安心账户资金、企业年金基金、QDII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、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2015年3月，中国工商银行共托管证券投资基金428只。自2003年以来，先后获得香港《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》等海内外权威媒体评选的45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
 1. 直销机构
 （1）汇添富基金管理股份有限公司直销中心
 住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
 办公地址：上海市峨山路91弄61号1幢陆家嘴软件园10号楼3楼
 法定代表人：李文
 电话：（021）28932823
 传真：（021）28932988
 联系人：廖晓晓
 客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）
 网址：www.99fund.com
 （2）汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）
 2. 申购赎回代理券商
 1) 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36层、28层A02单元
 办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
 法定代表人：牛冠兴
 开放式基金咨询电话：0755-82585308
 开放式基金业务传真：0755-82568365
 联系人：陈剑虹
 统一客服热线：4008001001
 公司网站地址：www.essence.com.cn
 2) 长城证券有限责任公司
 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
 邮政编码：518034
 法定代表人：黄耀华
 电话：0755-83516289
 传真：0755-83515667
 3) 东北证券股份有限公司
 注册地址：长春市自由大路1138号
 办公地址：长春市自由大路1138号
 法定代表人：杨正中
 联系人：安岩岩
 电话：0431-85096517
 客户服务电话：4008000686/431-85096733
 网址：www.nescn.com
 4) 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-29层
 法定代表人：潘鑫军
 联系人：胡月茹
 电话：021-63325888
 传真：021-63326729
 客户服务热线：95503
 东方证券网站：www.dfzq.com.cn
 5) 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：袁长清（代行）
 联系人：袁芳芳
 电话：021-22169999
 传真：021-22169134
 客户服务电话：95525、4008888788、10108998
 公司网址：www.ebscn.com
 6) 国都证券有限责任公司
 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：常松
 开放式基金咨询电话：400-818-8118
 网址：www.guodu.com
 7) 国信证券股份有限公司
 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
 基金业联系人：何如
 基金业务联系人：齐晓燕
 电话：0756-82130833
 传真：0756-82133962
 全国统一客户服务热线：95536
 公司网址：www.guosen.com.cn
 8) 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
 注册资本：96.95亿元人民币
 电话：021-23219000
 传真：021-23219100
 联系人：李笑鸣
 客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
 公司网址：www.htsec.com
 9) 平安证券股份有限公司
 注册地址：深圳市福田区金田路4018号国际交易广场8楼
 办公地址：深圳市福田区金田路4018号国际交易广场8楼（518048）
 法定代表人：杨宇翔
 全国免费业务咨询电话：95511-8
 开放式基金业务传真：0755-82400862
 联系人：郑 舒 瑶（zhengshuyi001@pingan.com.cn，0755-22626391）
 网址：http://www.pingan.com
 10) 齐鲁证券有限公司
 注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

（2015年第二期）
 办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
 法定代表人：李玮
 联系人：吴阳
 电话：0631-68889155
 传真：0631-6889185
 客服电话：95538
 网址：www.qizq.com.cn
 11) 上海证券有限责任公司
 注册地址：上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼
 法定代表人：龚德雄
 联系人：张瑾
 客户服务电话：（021）962518, 4008918918（全国热线）
 公司网站：www.962518.com
 12) 申银万国证券股份有限公司
 注册地址：上海市常熟路171号
 办公地址：上海市常熟路171号
 法定代表人：陈健
 电话：021-33898888
 传真：021-33888224
 客服电话：95523或400895523
 电话委托：95523
 网址：www.sygw.com
 13) 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
 客户服务电话：4008-096-096
 公司网站：www.swsc.com.cn
 14) 湘财证券有限责任公司
 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 法定代表人：林俊波
 电话：021-68634518
 传真：021-68695680
 联系人：赵小娟021-68634510-8620
 客服电话：400-888-1561
 公司网址：www.xscs.com
 15) 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号国际企业大厦C座
 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
 法定代表人：陈有安
 开放式基金咨询电话：4008-888-888
 开放式基金业务传真：010-66568990
 联系人：田薇
 联系电话：010-66568430
 网址：www.chinastock.com.cn
 16) 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
 法定代表人：姜建清
 电话：0755-82943666
 传真：0755-82943636
 联系人：林思迎
 客户服务电话：95555、4008888111
 公司网站：www.newone.com.cn
 17) 中国国际金融有限公司
 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层27及28层
 办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层27及28层
 邮政编码：100022
 注册资本：1.25亿美元
 法定代表人：金立群
 电话：010-65051166
 传真：010-85679535
 18) 中国中投证券有限责任公司
 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋19层及24层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04、18层至21层
 法定代表人：龙增来
 联系人：刘锐
 电话：0755-82023442
 传真：0755-82026539
 网址：www.china-invsc.com
 客服电话：400-600-8008、95532
 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：北京市朝阳区门内大街188号
 法定代表人姓名：王常青
 基金业务对外联系人：权恒
 联系电话：400-8888-108
 联系传真：010-65182261
 公司网址：www.csc.com.cn
 客服电话：400-8888-108
 20) 中信万通证券有限责任公司
 法定代表人：杨宝林
 注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号苗岭大厦15层（1507-1510室）
 办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层（296061）
 基金业务联系人：吴志超
 电话：0632-85022326
 传真：0632-85022605
 客户服务电话：0632-96577
 公司网址：www.zxwt.com.cn
 21) 中信证券股份有限公司
 住址：深圳市福田区深南大道708号招商银行大厦A层
 法定代表人：王东明
 电话：010-84588888
 传真：010-84865660
 联系人：陈忠
 公司网站：www.ccit.com.cn
 22) 中信证券（浙江）有限责任公司
 公司注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
 公司办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
 法人代表：沈强
 邮政编码：310052
 联系人：王需需
 联系电话：95548
 公司网站：www.bigsun.com.cn
 23) 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楼
 办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
 法定代表人：朱科敏
 客服电话：95531；400-8888-588
 传真：021-50498825
 网址：www.longone.com.cn
 24) 方正证券股份有限公司
 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 法定代表人：雷杰
 全国统一客服热线：95571
 方正证券网站：www.foundersc.com
 25) 华宝证券有限责任公司
 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
 法定代表人：陈林
 电话：021-6877-8056
 传真：021-6877-8113
 客户服务电话：400-820-9898
 网址：www.cnhsstock.com
 2、二级市场交易代理券商
 包括具有经纪业务资格及深圳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要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。
 二、登记机构
 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
 注册资本：96.95亿元人民币
 电话：021-23219000
 传真：021-23219100
 联系人：李笑鸣
 客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
 公司网址：www.chinastock.com.cn
 3) 平安证券股份有限公司
 注册地址：深圳市福田区金田路4018号国际交易广场8楼
 办公地址：深圳市福田区金田路4018号国际交易广场8楼（518048）
 法定代表人：杨宇翔
 全国免费业务咨询电话：95511-8
 开放式基金业务传真：0755-82400862
 联系人：郑 舒 瑶（zhengshuyi001@pingan.com.cn，0755-22626391）
 网址：http://www.pingan.com
 10) 齐鲁证券有限公司
 注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的成份及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近目标指数的表现。
 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数的成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合原因导致本基金管理人买入标的指数的跟踪组合严重制约等。
 在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年化跟踪误差不得超过2%。如标的指数的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正常范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金股指期货投资将根据风险管理的原则，以提高投资效率，更好达到本基金的投资目标。基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的，不得将之应用于投机目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

（二）投资组合管理
 1. 构建投资组合
 构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取完全复制法确定目标组合，根据指数成份股的流动性和需求人数建立基金的建仓策略，在基金合同生效之日起3个月内，按照建仓策略将不低于90%的基金资产投资于标的指数成份股、备选成份股。此后，如因标的指数的成份股调整，基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在规定期限内进行调整。
 基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。
 2. 日常投资组合管理
 （1）可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数的成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等要素进行密切跟踪，分析其对跟踪误差的影响。
 （2）投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合跟踪方案，并利用ETF投资管理信息系统适时调整投资组合，以实现更优的跟踪标的指数的目的。
 （3）对比指数与组合的每日及累计的绩效数据，检测跟踪误差及其趋势：分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源，进而决定需要对跟踪误差的部分及调整方法，并初步制定下一交易日的投资组合调整方案。
 （4）制作并公布申购赎回清单：以T-1 日基金持有的证券及其比例为基础，根据上市公司公告，考虑T 日可能发生的上市公司变动情况，制作T 日的申购赎回清单并公告。
 3. 定期投资组合管理
 基金管理人将定期（每月或每半年）进行投资组合管理，主要完成下列事项：

（1）定期对投资组合持仓的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案，经投资决策委员会审批后实施；
 （2）根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案，经投资决策委员会审批后实施；
 （3）根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行每月支付现金的准备。
 4. 投资绩效评估
 （1）每日对基金的绩效评估报告，主要是对跟踪偏离度和跟踪误差进行评估；
 （2）每月末，基金经理根据基金估值报告进行量化评估；
 （3）每月末，基金经理根据基金估值报告，重点分析本基金跟踪误差和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。
 （三）投资决策依据和投资程序
 1. 投资决策依据
 （1）国家有关法律、法规和基金合同的规定；
 （2）标的指数的相关规定；
 （3）《汇添富基金管理股份有限公司章程》的有关规定；
 （4）《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制》的有关规定。
 2. 投资决策机制
 本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。
 本基金管理人设立的投资决策委员会是本基金投资的最高决策机构。投资决策委员会的主要职责包括：
 1）负责决定有关指数基金调整的对标决策；
 2）负责决定其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；
 3）审核评估基金经理每季提交的投资运作季报。

（2）基金经理的主要职责
 基金经理的主要职责包括：
 1）决定正常市场情况下，日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策；
 2）必要时进行本基金跟踪偏离度的分析；
 3）每季向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报；
 4）撰写基金中报、年报等公开报告关于基金投资运作的部分。
 3. 投资程序
 本基金投资程序分为投资研究、投资决策、投资执行（组合构建与监控调整）、交易执行、投资绩效评估、投资核对与监督、组合监控与调整、投资风险管理八个环节。
 （1）投资研究
 基金经理依托公司研究平台，开展指数跟踪、成份股流动性、成份股更新跟踪、成份股基本面情况（以期尽早发现退市风险）、成份股公司行为等相关研究，同时开展对本基金跟踪偏离的归因分析，并撰写报告，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基金经理提供的研究报告，定期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，每日进行基金投资决策的日常决策。
 定期事项是指：每季初投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策，基金经理根据投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作；
 重大事项是指：成份股更新、成份股发生合并、清算、破产等退市类事件、成份股长期停牌等事件。
 （3）投资执行（组合构建与监控调整）
 根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。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，以降低买入成本、控制投资风险。
 （4）交易执行
 集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。
 （5）投资绩效评估
 数量分析师定期或不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期，组合误差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。
 1）不定期的，基金经理对基金出现的较大的跟踪偏离度及归因分析和分析；
 2）每周末，数量分析师对基金的运行情况进行量化评估；
 3）每季末，基金经理根据评估报告分析当季的投资操作和跟踪指数的偏离情况，主要对组合跟踪偏离度和跟踪误差、现金控制情况、成份股更新期的操作以及成份股未来可能发生的变化进行分析并提供相关报告，作为今后投资运作的参考依据。
 在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不得超过2%。如因指数的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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（6）投资核对与监督
 基金运营部基金会计通过交易数据的核对，对当日交易操作进行复核，如发现违反《证券法》、《基金法》、基金合同、公司相关管理规定的交易操作，须立刻向投资总监汇报，并同时通报督察长、稽核监察部及基金经理。
 （7）投资执行
 集中交易室负责基金投资的日常交易行为进行实时监控。
 督察长和稽核监察部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东经贸城安永大
 楼16层
 邮政编码：100738
 公司电话：（010）58153000
 公司传真：（010）85188298
 盖章会计师：徐德、戴育化
 业务联系人：戴育化
四、基金的名称
 本基金名称：中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金
五、基金的类型
 本基金为股票型证券投资基金。
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。
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公司股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和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，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
 基金的投资组合比例为：本基金主要投资于标的指数的成份股，备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或基金管理人认可的指数的跟踪组合严重制约等。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则，具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。
八、基金的投资策略
 （一）投资策略
 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的成份及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数的成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合原因导致本基金管理人买入标的指数的跟踪组合严重制约等。
 在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年化跟踪误差不得超过2%。如标的指数的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正常范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金股指期货投资将根据风险管理的原则，以提高投资效率，更好达到本基金的投资目标。基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的，不得将之应用于投机目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

（二）投资组合管理
 1. 构建投资组合
 构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取完全复制法确定目标组合，根据指数成份股的流动性和需求人数建立基金的建仓策略，在基金合同生效之日起3个月内，按照建仓策略将不低于90%的基金资产投资于标的指数成份股、备选成份股。此后，如因标的指数的成份股调整，基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在规定期限内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。

2. 日常投资组合管理
 （1）可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数的成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等要素进行密切跟踪，分析其对跟踪误差的影响。
 （2）投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合跟踪方案，并利用ETF投资管理信息系统适时调整投资组合，以实现更优的跟踪标的指数的目的。
 （3）对比指数与组合的每日及累计的绩效数据，检测跟踪误差及其趋势：分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源，进而决定需要对跟踪误差的部分及调整方法，并初步制定下一交易日的投资组合调整方案。
 （4）制作并公布申购赎回清单：以T-1 日基金持有的证券及其比例为基础，根据上市公司公告，考虑T 日可能发生的上市公司变动情况，制作T 日的申购赎回清单并公告。
 3. 定期投资组合管理
 基金管理人将定期（每月或每半年）进行投资组合管理，主要完成下列事项：