

# 华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2016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**  
**二〇一六年一月**

**重要提示**

华安中证细分医药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”)2013年9月22日证监许可[2013]1213号文核准。本基金基金合同自2013年12月4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。

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。

本招募说明书基金合同和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。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。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2015年12月4日,有关财务数据截止日为2015年9月30日,净值表现截止日为2015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: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:王皓  
 13.网址:www.huain.com.cn

(二)注册备案和股权结构  
 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 |
|----------------|----------|
| 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、副总经理并兼任际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董事长、法定代表人、党总支书记。

戴威先生,博士研究生学历,14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中心部门总经理,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,自2015年7月起任华安基金管理有限公司总经理。

扈招新先生,研究生学历。历任上海经济委员会信息中心副主任、主任,上海市经济学会副秘书长、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。

马尚卿先生,工商管理硕士,高级会计师。历任凤凰股份有限公司董事长、总经理,上海东方市上企业博览中心副总经理,现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼计划财务部总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副董事长、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监事、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,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,国泰君安有限公司北京办事处副主任,发行二部副总经理,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,固定收益证券总部副总经理、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。历任全国政协常委,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局秘书科科长、上海市第一律师事务所律师主任,上海市金茂律师事务所主任,上海市律师协会会长。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,中国经济学学会副会长,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公司委员会委员,享受国务院政府津贴。

(2)监事会  
 张红女士,经济学博士。历任上海证劵监管机构副处长,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。

陈丽女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部副经理,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资产管理总部高级经理。

章卫进先生,大学学历,会计师。历任上海有色金属总公司财务处科员,外经处会计主管,英国SONOPEC公司(长江石化)业务经理,上海有色金属总公司财务处公司财务部经理,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)有限公司财务部经理。

李梅女士,大专学历,会计师。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部副经理,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,国泰证券综合管理部总经理,公司专职党委副书记兼行政事务部总经理,公司专职党委副书记兼上海置业总部总经理,国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记,公司党委书记、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书记。

赵敏先生,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、市场营销总部总经理,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、副总经理并兼任际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董事长、法定代表人、党总支书记。

戴威先生,博士研究生学历,14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中心部门总经理,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,自2015年7月起任华安基金管理有限公司总经理。

章国富先生,博士研究生学历,27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,上海大华会计师事务所会计师,中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理,上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作),上海锦江投资管理有限公司副总经理兼上海新嘉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。

滕彦女士,研究生学历,15年证券、基金从业经验。曾任华东政法学院副教授,中国证监会上海证劵监管机构副处长,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法制工作处处长,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:  
 钱晶,硕士,4年证券、基金行业从业经验,曾任国信证券分析师,2014年12月加入华安基金,任指数投资部量化分析师。2015年6月起担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分

级证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理。2015年9月起担任本基金及其联接基金的基金经理。

历任基金经理:  
 计伟,硕士研究生,9年基金、金融行业从业经历,曾任华安基金管理有限公司基金会计,中国国际金融有限公司经理,2012年1月再次加入华安基金,2015年9月起担任本基金及其联接基金的基金经理。

张昊先生,自2013年12月4日至2014年4月23日担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理。  
 曹海歆女士,自2013年12月4日至2014年4月23日担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

3.本公司采取集体投资决策制度,股票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  
 翁启森先生,基金投资部兼全球投资部高级总监、基金经理  
 胡明先生,投资研究部高级总监  
 许之彦先生,指数投资部高级总监  
 贺涛先生,固定收益部总监、基金经理  
 上述人员之间不存在亲属关系;

4.业务人员的准备情况:  
 截至2015年9月30日,公司目前共有员工313人(含香港公司7人),其中54.6%具有硕士及以上学历,81%以上具有三年证券业务或金融行业从业经历,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。公司业务由投资与研究、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。中国建设银行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码0939),并于2009年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末,本集团资产总额182,192亿元,较上年末增长8.81%;客户存款和垫款总额101,571亿元,增长7.20%;客户存款总额136,970亿元,增长6.19%。净利润1,322亿元,同比增长0.97%;营业收入3,110亿元,同比增长8.34%,其中,利息净收入同比增长6.31%,手续费及佣金净收入同比增长4.76%,成本收入比23.23%,同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%,处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部,全面推动渠道整合,营业网点“三综合”建设取得进展,综合性网点达到141万个,综合营销团队达到19,934个,综合柜员占比达到94%,客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设,有力支持渠道转型的综合化转型,电子银行和自助渠道业务交易量占比达94.32%,较上年末提高6.29个百分点;个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%;普惠商务推出精品移动平台,个人商务手机客户端“建行融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末,累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元,承销金额继续保持同业第一;证券投资基金托管户数和新增基金托管只数均列市场第一,成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行不断扩大,现金管理池、票据池、银银单位结算卡等战略性产品市场份额不断提升,多模式品牌“禹道”的市场影响力持续提升;代理中央财政授权支付业务,代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一,在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户,管理资金总额7,417.41亿元,均为行业第一。

2015年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2;在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位,较上年上升一位;荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项;荣获社会责任建设国际银行协会的“年度最佳社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生建设奖”两个综合大奖。

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、理财信托投资市场处、OFII托管处、养老金托管处、清结处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管业务上海备份中心,共有员工210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  
 赵观雨,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务和个人银行业务和内部审计等工作,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。

张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷管理部、信贷经营部,公司业务部,并在总行集团客户部和建设银行北京市分行担任领导职务,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,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、基本养老金专户、OFII、企业年金专户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2015年9月末,中国建设银行已托管537只证券投资基金。中国建设银行拥有多年开放市场托管业务能力和业务声誉,赢得了业内的高度认可。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构  
 (一)基金份额发售机构及基金联系人  
 1.申购赎回代办证券公司(简称:一级交易商):  
 (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:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层  
 法定代表人:王连志  
 客户服务电话:4008001001  
 网址:www.essence.com.cn  
 (2)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号  
 法定代表人:杨泽洋  
 客户服务电话:95579  
 网址:www.cjsc.com  
 (3)方正证券股份有限公司  
 注册地址:长沙市芙蓉中路二段华国际大厦22—24层  
 办公地址:长沙市芙蓉中路二段华国际大厦22—24层  
 法定代表人:何其慧  
 客户服务电话:0731-95571  
 网址:www.founders.com  
 (4)广发证券股份有限公司  
 注册地址:广州市天河区天河北路183—187号大都会广场43楼(4301—4316房)  
 办公地址:广州市天河区北路183号大都会广场5、7、10、18—19、36、38—39、41—44楼  
 法定代表人:孙树明  
 客户服务电话:95575  
 网址:www.gf.com.cn  
 (5)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楼  
 法定代表人:万建华  
 客户服务电话:4008888666  
 网址:www.gtja.com  
 (6)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  
 客户服务电话:95536  
 网址:www.guosen.com.cn  
 (7)海通证券股份有限公司  
 注册地址:上海市广东路68号  
 办公地址:上海市广东路68号  
 法定代表人:王开国  
 客户服务电话:95553 4008889001

网址:www.htsec.com  
 (8)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46层  
 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场46层  
 法定代表人:李梅  
 客户服务电话:021-96250500  
 网址:www.swhysc.com  
 (9)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:4008008899  
 网址:www.cindasc.com  
 (10)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弄证大五道口广场1号楼  
 法定代表人:兰荣  
 客户服务电话:95562  
 网址:www.xyzq.com.cn  
 (11)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楼  
 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45楼  
 法定代表人:宫少林  
 客户服务电话:95565  
 网址:www.newone.com.cn  
 (12)浙商银行股份有限公司  
 注册地址:浙江省杭州市杭大路1号  
 办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6/7楼  
 法定代表人:吴圣银  
 客户服务电话:0571-96777  
 网址:www.stocke.com.cn  
 (13)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  
 客户服务电话:4008-888-888  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 (14)中国中证券有限公司  
 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18—21层  
 办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18—21层  
 法定代表人:胡长生(代)  
 客户服务电话:4006008008  
 网址:www.china-inv.com.cn  
 (15)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:王东明  
 客户服务电话:0755-23835888  
 网址:www.cscit.com.cn  
 (16)中国证券投资基金业协会  
 注册地址:北京市丰台区丽泽桥19号院1号楼8层东侧  
 办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦  
 法定代表人: 廖庆平  
 电话: 010-63211663  
 网址: http://www.csf.com.cn/  
 2.二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  
 1.场内份额登记结算机构  
 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  
 负责人:周明  
 联系人:郑宏阳  
 电话:(010)58872935  
 传真:(010)68870311  
 2.场外的登记结算机构  
 名称:华安基金管理有限公司  
 住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期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)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  
 办公地址: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)31358666  
 传真:(021)31358716  
 联系人:孙晔  
 经办律师:安冬、孙晔  
 (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:魏程信  
 联系电话:(021)23238888  
 传真:(021)23238800  
 联系人:周伟  
 经办会计师:江熺、周伟

(四)交易执行阶段  
 由集中交易部负责投资指令的操作和执行。集中交易部合法、合规地执行交易指令,对交易过程中出现的任何异常情况,负有监控、报告的职责。集中交易部确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理及时反馈。

(五)风险评估和绩效分析  
 风险管理部定期和不定期地对基金组合进行风险评估和绩效分析并提交报告。风险评估报告帮助投资决策委员会和基金经理了解投资组合承受的风险水平和风险的来源。绩效分析报告帮助分析既定的投资策略是否成功,以及组合收益来源是否是依靠实现既定策略获得。风险管理部定期向投资决策委员会提交风险评估和绩效分析报告,并及时反馈结果给基金经理。对重大的风险事项可报告风险控制委员会。

投资决策委员会在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资决策程序。

如果聘请、更换境外投资顾问,基金管理人有权在遵循上述投资决策策略的前提下,对其投资决策程序进行适当调整,无需召开基金份额持有人大会。

(三)投资限制  
 1.组合限制  
 基金的投资组合应遵循以下限制:  
 (1)本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金管理人管理的全部权证持有同一权证,不得超过该权证的10%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;法律法规和中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(3)本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(5)在任何交易日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)不得超过基金资产净值的100%。

(6)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或中国证监会规定进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为  
 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资活动或活动:

(1)承销证券;  
 (2)违反规定向他人贷款或者提供担保;  
 (3)从事承担无限责任的投资;  
 (4)买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资;  
 (6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;  
 (7)法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合国务院证券监督管理机构的规定,并履行信息披露义务。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述禁止性规定禁止行为和与投资限制不再适用,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和与投资限制规定。

(四)基金的投资组合  
 本基金为股票型基金,属较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于90%,其中,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。

本基金根据相关法律法规和中国证监会要求履行相关手续后,还可以投资于法律法规和中国证监会允许基金资产投资的其它金融工具。

四、基金的投资策略  
 本基金名称:华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金  
 五、基金的类型  
 本基金类型:股票型证券投资基金  
 运作方式:契约型开放式。

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。

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。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于标的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司)、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金资产投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。

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。

正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。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,基金管理人应采取积极措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(二)投资管理  
 1.决策依据  
 (1)依据国家有关法律、法规和基金合同的有关规定,依法决策是本基金进行投资的前提;

(2)全球宏观经济形势、区域经济发展情况、微观经济运行环境和证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础;

(3)根据投资对象收益和风险的特征分析,在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障;

(4)宏观研究员、策略研究员、股票研究员和数量研究员各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

2.决策程序  
 (1)决策机制  
 本基金实行投资决策委员会下的基金经理负责制。投资决策委员会的主要职责是确定基金资产的配置策略,以及重大投资决策。基金经理的主要职责是在投资决策委员会批准的大类资产配置范围内构建和调整投资组合。基金经理负责下达投资指令。集中交易部负责执行交易指令。

(2)资产配置阶段  
 基金经理在研究平台的支持下,对不同类别的大类资产的收益风险状况作出判断。宏观研究员提供宏观经济分析,策略研究员提供策略建议,股票研究员提供行业和个股配置建议,数量研究员结合基金的产品定位和风险控制要求提供资产配置的量化分析。基金经理结合自己的分析和判断和研究员的投资建议,根据合同规定的投资目标、投资理念和投资风格拟定大类资产的配置方案,向投资决策委员会提交投资策略报告。投资决策委员会审议投资策略报告,并做出投资决策。

(3)组合构建阶段  
 研究员负责构建股票的备选库。基金经理在其中选择投资品种,构造具体的投资组合及操作方案,并决定交易的数量和时机。

(4)交易执行阶段  
 由集中交易部负责投资指令的操作和执行。集中交易部合法、合规地执行交易指令,对交易过程中出现的任何异常情况,负有监控、报告的职责。集中交易部确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理及时反馈。

(5)风险评估和绩效分析  
 风险管理部定期和不定期地对基金组合进行风险评估和绩效分析并提交报告。风险评估报告帮助投资决策委员会和基金经理了解投资组合承受的风险水平和风险的来源。绩效分析报告帮助分析既定的投资策略是否成功,以及组合收益来源是否是依靠实现既定策略获得。风险管理部定期向投资决策委员会提交风险评估和绩效分析报告,并及时反馈结果给基金经理。对重大的风险事项可报告风险控制委员会。

投资决策委员会在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资决策程序。

如果聘请、更换境外投资顾问,基金管理人有权在遵循上述投资决策策略的前提下,对其投资决策程序进行适当调整,无需召开基金份额持有人大会。

(三)投资限制  
 1.组合限制  
 基金的投资组合应遵循以下限制:  
 (1)本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金管理人管理的全部权证持有同一权证,不得超过该权证的10%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;法律法规和中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(3)本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(5)在任何交易日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)不得超过基金资产净值的100%。

(6)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或中国证监会规定进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为  
 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列