华安中证细分地产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

华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2013年9月22日证监许可[2013]1214号文核准募集。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，由投资者自行负担。

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本基金托管人复核。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：王艳
13、网址：www.huaan.com.cn

（二）注册资本和股权结构

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、从业简历、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。

童威先生，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。

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。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科员、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长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。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，中国工业经济学会副会长，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委员会委员。享受国务院政府津贴。

（2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任上海证管办机构处副处长，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。

陈涵女士，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。

章卫进先生，大专学历，会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科员、外经处会计主管，英国SONOFEC公司（长驻伦敦）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）有限公司财务部经理。

李梅清女士，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兼上海营业总部总经理，国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记，公司党委委员、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、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。

诸慧女士，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。

童威先生，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）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新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。

薛珍女士，研究生学历，15年证券、基金从业经验，曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，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

徐宜宜先生，管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM(金融风险管理师），9年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任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的基金经理职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年12月起同时担任本基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。

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
杨　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%具有硕士及以上学位，81%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，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)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2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007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%；客户贷款和垫款总额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5.76%。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，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个、综合柜员占比达到84%，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，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达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%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”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；证券投资基金托管只数和新发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代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“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9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”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

赵观甫，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分行营业部、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、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中国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其联系人

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：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8号
法定代表人：杨泽柱
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侨国际大厦22-24层
办公地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：何其聪
客户服务电话：0731-95571
网址：www.foundersc.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689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
客户服务电话：95553　4008888001
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：　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）　浙商证券股份有限公司
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：吴承根
客户服务电话：0571-967777
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-invs.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.cs.ecitic.com

（16）　中国证券金融股份有限公司
注册地址：北京市丰台区丽泽路18号院1号楼1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：聂庆平
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：郑奕莉
电话：（021）58872935
传真：（021）68870311

2、场外份额登记结算机构

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：孙睿
经办律师：安冬、孙睿

（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
法定代表人：杨绍信
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：周祎
经办会计师：汪棣、周祎

四、基金的名称

本基金名称：华安中证细分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部分非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货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%。

本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。

八、基金的投资策略

（一）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，本基金可以选择其他证券或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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（二）投资决策依据和决策程序

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）全球宏观经济发展态势、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）依据投资对象收益和风险的配比关系，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大类资产的配置策略，以及重大投资方案。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，数量研究员结合本基金的产品定位和风险控制要求提供资产配置的定量分析。基金经理结合自己的分析判断和研究员的投资建议，根据合同规定的投资目标、投资理念和投资范围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，并做出投资决议。

（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，基金管理人有权将在遵循上述投资策略的前提下，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80%；

（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基金持有的同一权证，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%；法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

（3）基金财产参与股票发行申购，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比例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约定。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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，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或者活动：

（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，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，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投资限制规定。

（四）基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

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收益率。

本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人在取得基金托管人同意后报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、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。

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股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月23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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,481,736.66	68.31
	其中：股票	1,481,736.66	68.31
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	680,483.38	31.37
7	其他资产	6,872.57	0.32
8	合计	2,169,092.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	1,463,991.25	79.13
L	租赁和商务服务业	6,713.81	0.36
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	11,031.60	0.60
	合计	1,481,736.66	80.08

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万　科A	15,002	190,975.46	10.32
2	000024	招商地产	6,320	180,056.80	9.73
3	600649	城投控股	6,260	80,065.40	4.33
4	600048	保利地产	9,430	75,345.70	4.07
5	000979	中弘股份	11,554	69,786.16	3.77
6	600663	陆家嘴	1,343	62,207.76	3.36
7	601588	北辰实业	10,515	45,635.10	2.47
8	600565	迪马股份	4,300	45,494.00	2.46
9	000667	美好集团	10,000	44,100.00	2.38
10	000882	华联股份	4,516	39,515.00	2.14

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,772.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,872.57

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末按的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000979	中弘股份	69,786.16	3.77	重大事项停牌
2	600565	迪马股份	45,494.00	2.46	重大事项停牌
3	000882	华联股份	39,515.00	2.14	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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，投资者在作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。

（一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较（截止时间