

(上接B134版)

注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
电话:(0371)65856670
传真:(0371)65856665
客户服务电话:(0371)967218
网址:www.ccnw.com
(59)国都证券股份有限公司
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:常站
电话:(010)84183389
传真:(010)64482090
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodai.com
(60)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层
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
电话:021-20333333
传真:021-50498825 (021)50586660-8611
客户服务电话:4008888588
网址:www.longone.com.cn
(61)中银国际证券股份有限公司
地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海浦东银城中路200号中银大厦39、40、41层
法定代表人:钱卫
电话:(021)68604866
传真:(021)68883554
客户服务电话:4006200888
网址:www.bocichina.com
(62)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赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银
行办公楼14-18楼
办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银
行办公楼14-18楼
法定代表人:庞介民
电话:(0471)4913998
传真:(0471)4930707
客户服务电话:(0471)4961259
网址:www.cnht.com.cn
(63)国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小晋
客户服务电话:4008222111
网址:www.gsstock.com
(64)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96号
法定代表人:李玮
传真:(0531)68889752
客户服务电话:95638
网址:www.lqzq.com.cn
(65)第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
电话:(0755)25832583
客户服务电话:4008881888
网址:www.firstcapital.com.cn
(66)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A
栋41层
法定代表人:王宜四
电话:(0791)86768763
传真:(0791)86768764
客户服务电话:4008666667
网址:www.avicsec.com
(67)德邦证券有限责任公司
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:姚文平
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008888128
网址:www.tebon.com.cn
(68)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址:西安市东大街232号信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:(029)47406172
客户服务电话:95682
网址:www.westsecu.com.cn
(69)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157号7-8层
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157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:0591-96326
网址:www.hfzq.com.cn
(70)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人:李晓安
电话:(0931)4890100
传真:(0931)4890118
客户服务电话:0931-4890619
网址:www.hlzqgs.com
(71)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦26层、26、27层及28层
层
法定代表人:丁学东
电话:(010)65051166
传真:(010)65051156
客户服务电话:(010)65051166
网址:www.ciccc.com.cn
(72)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜祚
电话:(010)59226788
传真:(010)59226799
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com
(73)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科中一路西华强高新研发大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科中一路西华强高新研发大楼7层、8层
法定代表人:黄扬录
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82940511
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(74)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)62924777
网址:www.lxzq.com.cn
(75)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66号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人:孙名扬
电话:(0451)82336863
传真:(0451)82287211
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn
(76)厦门证券有限公司
注册地址:福建省厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址:厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人:傅毅辉
电话:95664
电话:(0592)15161642
传真:(0592)15161140
客户服务电话:(0592)5163588
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
(77)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦十一、二十九、三十、三十一层
法定代表人:吴骏
电话:(0755)83007041、83007166
传真:(0755)83007034
客户服务电话:(0755)26982993
网址:www.ydsc.com.cn
(78)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:杨斌忠
电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客户服务电话:58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(79)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、12层
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
(80)中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23号甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23号甲
法定代表人:马国刚
电话:(024)23268917
传真:(024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.sstockren.com
(81)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦24层
法定代表人:林义相
电话:(010)66045608
传真:(010)66045600
联系人:林爽
客户服务电话:(010)66045678
网址:www.txsec.com或jijin.txsec.com
(82)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:杨敏敏
电话:(021)38784818
传真:(021)68775878
客户服务电话:(021)38784818
公司网站:http://www.shhxzq.com
(83)财通证券股份有限公司
注册地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客服电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com
(84)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:400-700-9665
传真:021-68596167?
网址:www.ehowbuy.com
(85)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号9幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人:其实
电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn
(86)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
法定代表人:陈柏青
电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
(87)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路2555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:021-58788678
传真:021-58787988
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.e-rich.com.cn
(88)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区 虹飞路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 2楼
法定代表人:汪静波
电话:021-38600676
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(89)北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市顺义区北四环中路27号院5号楼3201单元21楼
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号院民建大厦3层
法定代表人:闫振杰
电话:400-888-6661
传真:(+86-10)62002088-8802
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.mypf.com
(90)中期资产管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
层
法定代表人:路瑶
电话:010-59539718、59539728
传真:010-65807110
电话:956162、400888160
网址:www.cifcofund.com
(91)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201单元21楼
办公地址:北京市西城区西藏中路336号
法定代表人:李招弟
电话:010-59393923
传真:010-59393074
电话:4008080069
网址:www.wy-fund.com
(92)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
电话:4008918918
网址:www.shzq.com
(93)深圳众禄基金控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路65号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人:徐刚
电话:95664
网址:www.lxzq.com.cn
(96)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F
法定代表人:王莉
联系人:吴卫东
电话:021-20835787
传真:021-20835879
(97)中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人:王兵
客服电话:95162
公司网站:www.cifco.net
(98)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人:陈操
客服电话:400-950-7771
公司网站:https://tjrq.com/
(99)北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人:罗细安
客服电话:400-001-8811
公司网站:http://www.zcvc.com.cn
(100)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人:李长伟
客服电话:0871-68898910
公司网站:http://www.tpyzq.com
(101)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
联系电话:021-33323998
传真号码: 021-33323993
客户服务电话:400-820-2819
网址: fundfundtrade.com
(102)泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市云鹿路3号
办公地址:泉州市云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系电话:0596-22551071
传真号码:0596-22505215
(103)一路财富(北京)信息科技有限公司
地址:北京市西城区广安门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
客服电话:4000011566
网址:www.yilucaifu.com
(104)北京恒天明泽基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁斌
客服电话:4008980618
网址:www.chtfund.com
(105)海银基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人:刘惠
联系电话:021-80133888
传真号码:021-80133413
客户服务电话:400-808-1016
网址: http://www.fundhaiyin.com
(106)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁宇竹
联系电话:021-20666952
传真号码:021-22066653
(107)北京乐融多源投资咨询有限公司
地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人:董浩
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com
(108)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人: 燕斌
客户服务电话: 400-046-6788
网址: www.66zichan.com
(109)深圳路济财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
客户服务电话:0755-83999913
网址: www.jinqianwo.cn
(110)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:上海市市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁颖明
联系电话:021-22267987
传真号码:021-22268089
网址: www.dtfunds.com
(二)注册登记机构
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层
法定代表人:朱学华
电话:(021)38969780
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
负责人:韩奥
电话:(021)31358666
传真:(021)3358716
四、基金名称
本基金名称:华安上证龙头企业交易开放式指数证券投资基金联接基金
本基金类型:ETF联接基金,指数基金。
运作方式:契约型开放式。
五、基金的投资目标
通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
六、基金的投资方向
本基金以目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象,把全部或接近全部的资金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。
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。
七、基金的投资策略
(一)投资策略
本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数的跟踪误差的全被动指数基金。
本基金通过把全部或接近全部的资金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,实现对业绩比较基准

紧密跟踪。正常情况下,本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%。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,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
本基金投资于目标ETF的方式以申购和赎回为主,但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下,为了更好地实现本基金的投资目标,减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差,也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。
(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、投资决策体系
本基金管理人实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集思广益、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,投资协调小组是基金投资的协调机构和中间桥梁,投资协调小组由基金投资部、研究发展部、固定收益部的负责人及业务骨干组成。基金经理是基金运作的直接管理人。
(三)投资管理程序
研究支持、投资决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了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的跟踪,通过对目标ETF、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:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理对目标ETF采取实物申购的方式或证券二级市场交易的方式来构建组合,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决策,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变动,结合成份股基本面情况、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跟踪的结果,采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数的指数。
(7)合规监察: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:95%×上证龙头企业指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率
本基金的标的指数为上证龙头企业指数,同时考虑对投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%、现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,因此本基金设定上述业绩比较基准。
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,或由于指数编制方法发生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
本基金属于ETF联接基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金,紧密跟踪标的指数,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,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。
十一、基金投资组合报告
基金管理人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。
基金托管人中国工商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。
本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日。
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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	111,821,048.18	94.16
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,882,203.18	5.77
8	其他资产	82,915.24	0.07
9	合计	118,766,166.60	100.00

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	上证龙头企业交易开放式指数证券投资基金	股票型	交易开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	111,821,048.18	94.38

3 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未有股票投资。
4 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
本基金本报告期末未有股票。
5 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有债券。
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五名债券投资明细
本基金本报告期末未有债券。
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十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券。
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贵金属投资明细
本基金本报告期末未有贵金属。
9 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有权证。
10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期没有投资股指期货。
10.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。
11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
11.1 本基金投资国债期货的投资政策
无。
11.2 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。
11.3 本基金投资国债期货的投资评价
无。
12 投资组合报告附注
12.1 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,在本报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情况。
12.2 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。
12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	74,534.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,211.30
5	应收申购款	7,170.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,915.24

12.4 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有处于转股期的可转换债券。
12.5 报告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不存在流通受限情况。

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据。
(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2015年6月30日)

阶段	净值增长率①	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益③	①-③	②-③
2015年1月1日至2015年6月30日	41.73%	2.11%	44.83%	2.10%	-3.10%
2014年1月1日至2014年12月31日	40.76%	1.01%	40.18%	1.01%	0.08%
2013年1月1日至2013年12月31日	-10.08%	1.28%	-12.64%	1.27%	0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	14.30%	1.12%	12.53%	1.12%	1.77%
2011年1月1日至2011年12月31日	-19.31%	1.14%	-19.42%	1.15%	-0.01%
自基金成立(2010年11月18日)至2010年12月31日	-2.10%	0.76%	-2.38%	1.17%	-0.42%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金收益分配中发生的费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、与基金运作有关的费用
(1)基金管理人的管理费
在通常情况下,本基金投资于目标ETF的部分豁免管理费,其他部分基金资产的基金管理费按前一日该部分基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:
H=MAX{(E×年管理费率÷当年天数),0)
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产中非投资目标ETF的部分基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
在通常情况下,本基金投资于目标ETF的部分豁免托管费,其他部分基金资产的基金托管费按前一日该部分基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:
H=MAX{(E×年托管费率÷当年天数),0)
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产中非投资目标ETF的部分基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
2、与基金销售有关的费用
(1)申购费
本基金申购费率最高不超过1.2%,且随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有单笔申购,适用费率按单笔分别计算。
本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金,可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。
通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。
其他投资者申购本基金基金份额申购费率如下所示:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<500万	0.6%
M≥500万	每笔1000元

本基金的申购费用由本基金的投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
(2)赎回费
本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.5%,按持有期递减。赎回费用由赎回本基金基金份额持有人承担,赎回费总额的25%归基金财产。具体费率如下:
持有年限(Y)
Y<1年
1年≤Y<2年
Y≥2年
赎回费率
0.5%
0.25%
0
注:一年指365天,两年为730天,依此类推。
(3)转换费
基金转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费。
转出基金赎回费=转出份额×转出基金T日基金份额净值×转出基金赎回费
转出金额=转出份额×转出基金T日基金份额净值-转出基金赎回费
基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计算收取,具体计算公式如下:
基金转换申购补差费= max{(转入基金的申购费-转出基金的申购费),0},即转入基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取0
转入金额=转出金额-基金转换申购补差费
转入份额=转入金额÷转入基金T日基金份额净值
转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。
其中:
转入基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转入基金的申购费率)]或转入基金固定收费金额
转出基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转出基金的申购费率)]或转出基金固定收费金额
注1:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。
注2:本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
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。调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体公告。
(五)基金税收
本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十四、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	更新了部分代销机构的信息。
八、基金份额的申购、赎回与转换	1.更新了广州分公司、西安分公司、成都分公司的联系方式;2.更新了首次申购最低金额限制。
九、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
二十一、对基金投资人的服务	更新了基金成立以来的业绩表现。
二十二、其他应披露事项	电子直销交易服务平台交易功能更新,详见招募说明书。

披露了[2015年5月18日至2015年11月18日期间]本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一五年十二月三十一日