华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要

2017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
二〇一七年五月

重要提示

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）（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”）依照有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”）2011年9月15日《关于核准华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2011]1475号）核准。本基金基金合同自2012年3月29日正式生效。

基金管理人保证本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，投资者在申购基金前请认真阅读《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人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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

本摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经基金托管人复核。除特别说明外，本摘要所载内容截止日为2017年3月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日。

一、基金的名称

本基金名称：华安标普全球石油指数证券投资基金。

二、基金的类型

本基金类型：契约型开放式、股票型基金。

三、基金的投资目标

本基金为股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

四、基金的投资方向

本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股，与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的80%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的20%，其中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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

五、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。本基金根据成分股或备选成分股的可投资性、流动性、行业代表性以及所在市场进入限制等进行筛选，主要投资于美国、英国、法国、意大利、加拿大、澳大利亚和香港等发达市场。这些市场所涵盖的成分股总流通市值占标的指数的90%以上，并且集中了全球规模最大的石油上市公司和成长性良好的新兴市场国家的大型石油企业。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。

为控制投资组合相对标的指数的偏离，本基金选择以“跟踪偏离度的绝对值”作为投资组合管理的主要标准，控制基金相对指数的偏离风险。基金经理定期检验投资组合与比较基准的跟踪偏离度，适时调整投资组合，使跟踪误差控制在限定范围内。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%（以美元资产计价）。当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪偏离度，具体变化将另行公告。

日均跟踪偏离度的绝对值和跟踪误差的计算方法如下：

跟踪偏离度（Tracking Difference）采用基金组合收益与业绩基准收益之差来衡量，计算公式如下：

[illegible]

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

（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、法规和本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、禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金不得有下列行为：

（1）购买不动产。

（2）购买房地产抵押按揭。

（3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。

（4）购买实物商品。

（5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

（6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。

（7）参与未持有基础资产的卖空交易。

（8）从事证券承销业务。

（9）中国证监会禁止的其他行为。

2、投资组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

（2）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

（3）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（4）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%。（持有货币市场基金可以不受上述限制）

（5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

基金管理人应当在基金合同生效后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。若基金超过上述1-5项投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。如果法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例规定进行变更的，以变更后的规定为准。有关法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

3、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

4、基金参与正回购交易，所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。本项比例限制计算，基金因参与正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金、集合计划总资产。

5、若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

七、基金的业绩比较基准

标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return）

标普全球石油指数（S&P Global Oil Index）由全球最大的120家满足特定可投资性条件的石油和天然气行业上市公司组成，旨在跟踪全球涉及油气勘探、冶炼和生产业务的公司。该指数成分股取自于标准普尔全球BM指数，其中不包括优先股。为确保可投资性，指数成分股必须在发达市场上市，并且满足截至参考日的3个月日平均交易额不低于500万美元的条件。该指数使用调整后的市值加权方法。市值权重将按照流通市值进行调整。该指数每年调整一次，具体为每年8月最后一个交易日的收盘后。与业绩比较基准比较时，我们将采取相同的计价货币，以准确的体现基金收益特征。

如果标普全球石油指数被停止编制及发布，或标普全球石油指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致标普全球石油指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适的指数作为本基金的标的指数，经基金托管人同意，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，相应变更业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

八、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。

九、基金的投资组合报告

本基金投资组合报告所载数据截至2016年12月31日。

（一）重要提示

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2017年1月18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。

（二）基金投资组合报告

2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	502,945,825.05	90.81
	其中：普通股	444,136,283.75	80.19
	存托凭证	58,809,541.30	10.62
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	142,102.65	0.03
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	142,102.65	0.03
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	44,732,830.05	8.08
8	其他各项资产	6,008,763.32	1.08
9	合计	553,829,521.07	100.00

2.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
意大利	16,268,045.84	3.03
美国	285,178,239.07	53.17
加拿大	54,108,172.65	10.09
中国香港	20,503,412.56	3.82
英国	87,982,577.72	16.40
法国	25,282,207.53	4.71
西班牙	5,417,663.39	1.01
澳大利亚	8,205,506.29	1.53
合计	502,945,825.05	93.76

2.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

2.3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	502,945,825.05	93.76
合计	502,945,825.05	93.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

2.4 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及存托凭证投资明细

2.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约交易所	美国	79,400	49,715,009.43	9.27
2	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约交易所	美国	48,800	39,844,463.12	7.43
3	TOTAL SA	道达尔	FP FP	法国交易所	法国	64,200	22,854,384.40	4.26
4	BP PLC	碧辟公司	BP/ LN	伦敦交易所	伦敦	513,719	22,276,860.54	4.15
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	RDSA LN	伦敦交易所	伦敦	99,153	18,920,702.21	3.53
6	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽约交易所	美国	27,832	16,208,275.53	3.02
7	ENI SPA	埃尼集团	ENI IM	意大利交易所	意大利	102,900	11,631,424.57	2.17
8	ROSNEFTO-JSC-REG S GDR	俄罗斯石油公司	ROSN LI	伦敦国际交易所	英国	254,500	11,475,532.25	2.14
9	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港交易所	中国香港	1,252,800	10,870,228.64	2.03
10	GAZPROM OAO-SPON ADR	俄罗斯天然气工业公司	OGZD LI	伦敦国际交易所	英国	308,000	10,789,809.80	2.01

2.4.2 积极投资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益投资明细

无。

2.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证	REPSOL SA RIGHT	142,102.65	0.03

2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

2.10 投资组合报告附注

2.10.1 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不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2.10.2 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。

2.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,588,505.84
3	应收股利	862,473.01
4	应收利息	6,484.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	2,551,299.78
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,008,763.32

注：其他应收款为在途结汇款。

2.10.4 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。

2.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2.10.5.1 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

无。

2.10.5.2 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

无。

五、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。

（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（截至时间2016年12月31日）。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016-1-1至2016-12-31	31.24%	1.34%	38.03%	1.47%	-6.79%	-0.13%
2015-1-1至2015-12-31	-15.57%	1.54%	-17.62%	1.67%	2.05%	-0.13%
2014-1-1至2014-12-31	-15.37%	0.85%	-14.86%	1.01%	-0.51%	-0.16%
2013-1-1至2013-12-31	9.08%	0.71%	11.12%	0.75%	-2.04%	-0.04%
2012-3-29（基金成立日）至2012-12-31	4.14%	0.86%	-2.84%	1.11%	6.98%	-0.25%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十一、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金的管理费

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

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3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.28%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.28%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、标的指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值及指数许可使用费年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

H=E×A÷当年天数

H为每日应计提的指数使用许可费

E为前一日的基金资产净值

A为“标普全球石油指数”指数使用许可费率

基金合同生效之日起及其后的12个月为第一个指数使用许可费的支付周期，随后的12个月为第二个指数许可费的支付周期，依此类推。指数使用费每日计提，按支付周期支付。若一个支付周期累计计提指数使用费金额 / 该支付周期最后一日（如为节假日取最近一日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于该支付周期最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。在每个支付周期到期后，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后于支付周期结束日起15个自然日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告，此项调整无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

（1）场外申购费率

本基金场外申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
0≤M<100万	1.2%
100万元≤M＜300万元	0.8%
300万元≤M＜500万元	0.4%
M≥500万元	每笔1000元

（2）场内申购费率

本基金的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

（3）本基金的申购费用由基金申购人承担，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、赎回费用

（1）场外赎回费率

本基金的场外赎回费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期	赎回费率
一年以内（不含一年）	0.5%
一年至两年（不含两年）	0.25%
两年（含两年）以上	0

注：一年指365天，两年为730天，依此类推。

（2）场内赎回费率

本基金的场内赎回费率固定为0.5%。

（3）本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

（三）其他费用

1、基金财产拨划支付的银行费用；

2、基金合同生效后的基金信息披露费用；

3、基金份额持有人大会费用；

4、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费以及其他为基金利益而产生的中介机构费用；

5、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记、开户等实际发生的费用（out-of-pocket fees）；

6、外汇兑换交易的相关费用；

7、标的指数数据提供费；

8、基金上市年费；

9、与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等；

10、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

11、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。本基金终止清算时所发生的费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金的税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

十二、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。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，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党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，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兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

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董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长，固定资产投资审计处副处长（主持工作）、处长，上海市审计局财政审计处处长，上海电气（集团）总公司财务总监。现任上海电气（集团）总公司副总裁、财务总监。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略管理部总经理。

独立董事：

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。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，中小企业融资部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司业务总监兼投行业务委员会副总裁，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，研究生学历。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

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，17年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，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党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，15年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，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兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现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，29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，16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），10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月起同时担任本基金的基金经理，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月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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，国际投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童　威先生，总经理

翁启森先生，总经理助理

杨　明先生，投资研究部高级总监

苏圻涵先生，全球投资部助理总监

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2017年3月31日，公司目前共有员工348人（不含香港公司），其中57.2%具有硕士及以上学位，85.9%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。

十三、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。本行于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年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长5.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,052亿元，增长6.09%，其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2