

华安上证龙头企业交易型开放式指数
证券投资基金联接基金
更新的招募说明书摘要
(2012 年第 2 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一二年十二月

重要提示

华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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”）2010年9月1日《关于核准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募集的批复》（证监许可【2010】1203 号）核准。本基金基金合同自2010年11月18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，由投资者自行承担。

本基金为上证龙头ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：（1）在基金的投资方法方面，上证龙头ETF 采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于上证龙头ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。（2）在交易方式方面，投资者既可以像股票一

样在交易所市场买卖上证龙头ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，实物申赎上证龙头ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金并不保证和上证龙头ETF业绩表现完全一致，与上证龙头ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）投资比例要求。上证龙头ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（2）申购赎回的影响。上证龙头ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

本招募说明书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2012年11月18日，有关财务数据截止日为2012年9月30日，净值表现截止日为2012年6月30日。

目录

一、基金管理人	1
二、基金托管人	6
三、相关服务机构	7
四、基金的名称	31
五、基金的类型	31
六、基金的投资目标	32
七、基金的投资方向	32
八、基金的投资策略	32
九、基金的业绩比较基准	34
十、基金的风险收益特征	35
十一、基金投资组合报告	35
十二、基金的业绩	40
十三、费用概览	41
十四、对招募说明书更新部分的说明	44

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：上海浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层
- 3、法定代表人：李勃
- 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、联系电话：（021）38969999
- 7、联系人：冯颖
- 8、客户服务中心电话：40088-50099
- 9、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

朱仲群先生，研究生学历。历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长，国家开发银行办公厅处长，中国光大银行大连分行行长助理、监察室副主任，中

国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理，长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事，现任上海国际集团有限公司总经理助理，华安基金管理有限公司董事长。

李勃先生，大学学历，高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理，北京汇正财经顾问有限公司董事总经理，上海证券交易所深圳办事处主任，中国投资信息有限公司董事总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总裁。

冯祖新先生，研究生学历。历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员，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，现任上海工业投资(集团)有限公司总裁、法定代表人、党委副书记。

马名驹先生，大学学历，高级会计师。历任上海凤凰自行车股份有限公司副董事长兼总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理，锦江国际(集团)有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理、上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

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、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生，研究生学历，教授。历任上海财经大学科研处处长、上海财经大学南德管理学院院长、上海财经大学常务副校长，现任上海国家会计学院院长、党委书记，APEC 金融与发展项目执行秘书处秘书长，兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

（2）监事会

谢伟民先生，研究生学历，副教授。历任上海市城建沪南工务所干部，空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师，上海市计委直属机关党委干事，中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员（副处级）、副处长，中共上海市金融工作党委组织处（宣传处）副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记（正处级），现任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、资产管理总部投资业务部副科长，现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生，研究生学历，高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长，上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长，上海电气（集团）总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

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、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。

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，助理研究员。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裁助理，兼任信息技术部总监。

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经理。

（3）高级管理人员

朱仲群先生，研究生学历。历任中国人民银行人事司、办公厅副处长、处长，国家开发银行办公厅处长，中国光大银行大连分行行长助理、监察室副主任，中国平安人寿保险股份有限公司北京分公司党委副书记兼副总经理、党委书记兼总经理，长城人寿保险股份有限公司总经理、副董事长、董事，现任上海国际集团有限公司总经理助理，华安基金管理有限公司董事长。

李勃先生，大学学历，高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理，北京汇正财经顾问有限公司董事总经理，上海证券交易所深圳办事处主任，中国投资信息有限公司董事总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总裁。

尚志民先生，工商管理硕士，15 年证券、基金从业经验。曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任安顺证券投资基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。现任华安基金管理有限公司副总裁兼首席投资官。

秦军先生，研究生学历，13 年证券、基金从业经验，曾任中国航空工业规划设计研究院建设监理部总经理助理，中合资产管理有限责任公司北京分公司总经理，嘉实基金管理有限公司总经理助理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

章国富先生，研究生学历，25 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裁。

薛珍女士，研究生学历，11 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

现任基金经理：

牛勇先生，复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），8 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 6 月起担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起担任本基金及华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2012 年 6 月起同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

许之彦先生，自 2010 年 11 月 18 日至 2012 年 12 月 22 日担任本基金基金经理。

徐宜宜先生，自 2010 年 11 月 18 日至 2012 年 12 月 22 日担任本基金基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

李 勃先生，总 裁

尚志民先生，副总裁、首席投资官

顾建国先生，财富管理中心总经理

翁启森先生，全球投资部总经理、基金经理

陈俏宇女士，基金经理

汪光成先生，基金经理

杨 明先生，投资研究部总经理、首席宏观策略师

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 2012 年 9 月 30 日，公司目前共有员工 305 人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中 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：中国工商银行股份有限公司

注册地址：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 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至 2012 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 161 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，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业客户提供安全、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、QFII 资产、QDII 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 2012 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 269 只，其中封闭式 6 只，开放式 263 只。自 2003 年以来，本行连续八年获得香港《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》等境内外权威财经媒体评选的 33 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）基金份额发售机构及其联系人

1、直销机构

（1）华安基金管理有限公司上海业务部

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层

电话：（021）38969960

传真：(021) 68863223

联系人：姚佳岑

(2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话：(010) 57635999

传真：(010) 66214061

联系人：朱江

(3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区华夏路10号富力中心1203室

电话：(020) 38199200

传真：(020) 38927962

联系人：田峰

(4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街88号长安国际中心A座706室

电话：(029) 87651811

传真：(029) 87651820

联系人：史小光

(5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段 19 号威斯顿联邦大厦 12 层 1211K-1212L

电话：(028) 85268583

传真：(028) 85268827

联系人：张彤

(6) 华安基金管理有限公司沈阳分公司

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：曹瀚

(7) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

华安电子交易手机网站: wap.huaan.com.cn

华安电子交易热线: 40088-50099

传真电话: (021) 33626962

联系人: 谢伯恩

2、代销机构

(1) 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 胡怀邦

电话: 021-58766688

传真: 021-58798398

客户服务电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 肖钢

电话: (010) 66592638

传真: (010) 66594568

客户服务电话: 95566

网址: www.boc.cn

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客户服务电话: 95588

传真: 010-66107571

网址: www.icbc.com.cn

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(5) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：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（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

电话：(010) 65558000

传真：(010) 65550809

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

电话：0591-87824863

传真：0591-87842633

客户服务电话：95561

网址： www.cib.com.cn

(9) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：010-66419824

公司网址： www.psbc.com

(10) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

电话：(010) 66426500

传真：(010) 66426519

客户服务电话：(010) 95526

网址： www.bankofbeijing.com.cn

(11) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：吴建

电话：010-85238570，85239938

传真：010-85239605

客户服务电话：95577

网址： www.hxb.com.cn

(12) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476215

客户服务电话：(021) 962888

网址：www.bankofshanghai.com

(13) 平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦半地下层 1、2、

法定代表人：孙建一

联系电话：(0755) 25859591

传真号码：(0755) 25878304

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

(14) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

电话：0086-21-38576709

传真：0086-21-50105085

客户服务电话：(021) 962999

网址：www.srcb.com

(15) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

办公地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

电话：(0571) 87659009, 87659816

传真：(0571) 87659826

客户服务电话：95527

网址：www.czbank.com

(16) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路193号

法定代表人：廖玉林

电话：（0769）22118118

传真：（0769）22118020

客户服务电话：4001196228

网址：www.dongguanbank.cn

(17) 临商银行股份有限公司

注册地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号

法定代表人：王傢玉

电话：（0539）8311353

客户服务电话：40069-96588

网址：www.lsbchina.com

(18) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：（0577）88999906

客户服务电话：（0577）96699

网址：www.wzbank.cn

(19) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市新华北路8 号

法定代表人：农惠臣

电话：（0991）8824667

传真：（0991）8824667

客户服务电话：96518

网址：www.uccb.com.cn

(20) 烟台银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号

法定代表人：庄永辉

电话：（0535）6691333

传真：（0535）6691305

客户服务电话：4008-311-777

网址：www.yantaibank.net

(21) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼

办公地址：大连市中山区中山路88号

法定代表人：陈占维

电话：0411-82311410

传真：0411-82311410

客户服务电话：4006640099

网址：www.bankofdl.com

(22) 哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号

法定代表人：高淑珍

电话：（0451）86779999

传真：（0451）86779000

客户服务电话：4006096358 / 95537

网址：www.hrccb.com.cn

(23) 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

法定代表人：金子军

电话：（0579）85337702

传真：（0579）85337706

客户服务电话：（0571）96527、400-8096-527

网址：www.czcb.com.cn

(24) 广州银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市越秀区广州大道北195号

办公地址：广东省广州市越秀区广州大道北195号

法定代表人：姚建军

电话：020-37598339

传真：020-37590798

客户服务电话：96699（广州）、400-83-96699（全国）

网址：www.gzcb.com.cn

(25) 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

法定代表人：万建华

电话：（021）38676666

传真：（021）38670161

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(26) 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：王常青

电话：（010）65183888

传真：（010）65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(27) 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

法定代表人：何如

电话：（0755）82130833转2181

传真：（0755）82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(28) 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：宫少林

电话：（0755）82943511

传真：（0755）82943237

客户服务热线：95565

网站：www.newone.com.cn

(29) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

法定代表人：孙树明

电话：（020）87555888

传真：（020）87555305

网址：www.gf.com.cn

(30) 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

电话：（010）84864818

传真：（010）84865560

网址：www.cs.ecitic.com

(31) 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

法定代表人：顾伟国

电话：（010）66568047

传真：（010）66568536

客户服务电话：8008201968

网址：www.chinastock.com.cn

(32) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）63410456

客户服务电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

(33) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

电话：（021）54033888

传真：（021）54035333

客户服务电话：（021）962505

网址：www.sywg.com

(34) 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

法定代表人：兰荣

电话：（021）68419974

传真：（021）68419867

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(35) 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

法定代表人：胡运钊

电话：400-8888-999

网址：www.cjsc.com.cn

(36) 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

法定代表人：牛冠兴

电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

网址：www.essence.com.cn

(37) 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

法定代表人：余维佳

电话：(023) 63786488

传真：(023) 63786001

客户服务电话：40080-96096

网址：www.swsc.com.cn

(38) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

电话：(020) 37865070

传真：(020) 37865030

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

(39) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：(0551) 2207114

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

(40) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

电话：(022) 28451861

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：www.ewww.com.cn

(41) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

电话：(025) 84457777

客户服务电话：(025) 95597

网址：www.htsc.com.cn

(42) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层

法定代表人：侯巍

电话：(0351) 8686703

传真：(0351) 8686619

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn; www.sxzq.net

(43) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：(0532) 85022026

传真：(0532) 85022026

客户服务电话：(0532) 96577

网址：www.zxwt.com.cn

(44) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

法定代表人：徐勇力

电话：(010)66555316

传真：(010)66555246

客户服务电话：(010) 66555835

网址：www.dxzq.net

(45) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

电话：(0512) 65581136

传真：(0512) 65588021

客户服务电话：(0512) 33396288

网址： www.dwzq.com.cn

(46) 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：高冠江

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址： www.cindasc.com

(47) 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

办公地址：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

电话：(0731) 85832343

传真：(0731) 85832342

客户服务电话：95571

网址： www.foundersc.com

(48) 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：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83516199

客户服务电话：400-6666-888

公司网站： www.cgws.com

(49) 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：徐浩明

电话：(021) 68816000-1876

传真：(021) 68815009

客户服务电话：95525、4008888788

网站：www.ebscn.com

(50) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：刘东

电话：(020) 88836999

传真：(020) 88836654

客户服务电话：961303、(020) 83963933

网址：www.gzs.com.cn

(51) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：(0431) 85096709

传真：(0431) 85096795

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(52) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层

法定代表人：马金声

电话：(010) 83561149

传真：(010) 83561094

客户服务电话：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

(53) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号国联大厦

法定代表人：雷建辉

电话：(0510) 82831662

传真：(0510) 82830162

客户服务电话：(0510) 82588168

网址：www.glsc.com.cn

(54) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：(0755) 82400862

客户服务电话：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

(55) 国海证券有限责任公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人：张雅锋

电话：(0771) 5539262

传真：(0771) 5539033

客户服务电话：全国：400-8888-100；广西：96100、(0771) 5539032

网址：www.ghzq.com.cn

(56) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

电话：(0731) 4403343

传真：(0731) 4403439

客户服务电话：0731-84403304

网址：www.cfzq.com

(57) 东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：张运勇

电话：(0769) 22119351

传真：(0769) 22119423

客户服务电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

(58) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：石保上

电话：(0371) 65585670

传真：(0371) 65585665

客户服务电话：(0371) 967218

网址：www.ccnew.com

(59) 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：常喆

电话：(010) 84183389

传真：(010) 64482090

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(60) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

电话：(021) 50586660-8636

传真：(021) 50586660-8611

客户服务电话：400888588

网址: www.longone.com.cn

(61) 中银国际证券有限责任公司

地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

电话: (021) 68604866

传真: (021) 58883554

客户服务电话: 021-4006208888

网址: www.bocichina.com

(62) 恒泰证券股份有限公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

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: 南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人: 曾小普

电话: (0791) 6289771

传真: (0791) 6289395

网址: www.gsstock.com

(64) 宏源证券股份有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

法定代表人: 冯戎

联系电话: (010) 88085858

传真号码: (010) 88085195

客户服务电话: 0991-400-800-0562

公司网址: www.hysec.com

(65) 齐鲁证券有限公司

注册地址: 山东省济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

传真: (0531) 68889752

客户服务电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

(66) 第一创业证券有限责任公司

注册地址: 广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 号

办公地址: 广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 号

法定代表人: 刘学民

电话: (0755) 25832583

传真: (0755) 25831718

客户服务电话: 4008881888

网址: www.firstcapital.com.cn

(67) 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: 杜航

电话: (0791) 6768763

传真: (0791) 6789414

客户服务电话: 4008866567

网址: www.avicsec.com

(68) 德邦证券有限责任公司

注册地址: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 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

(69) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：(029) 87406172

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com.cn

(70) 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

(71) 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

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

(72) 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 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26-28 层

法定代表人：李剑阁

电话：(010) 65051166

传真：(010) 65051156

客户服务电话：(010) 65051166

网址：www.cicc.com.cn

(73) 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

法定代表人：刘弘

电话：(010) 59226788

传真：(010) 59226799

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(74) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人：吴永良

电话：(0755) 82943755

传真：(0755) 82940511

客户服务电话：4001022011

网址：www.zszq.com.cn

(75) 日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人：孔佑杰

电话：(0471) 6292587

传真：(0471) 6292477

客户服务电话：(010) 88086830、(0471) 6292465

网址：www.rxzq.com.cn

(76) 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56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56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

(77) 厦门证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

电话：(0592) 5161642

传真：(0592) 5161140

客户服务电话：(0592) 5163588

网址：www.xmzq.cn

(78) 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三十、三十一层

法定代表人：赵文安

电话：(0755) 83007041、83007166

传真：(0755) 83007034

客户服务电话：4008-698-698、(0755) 26982993

网址：www.ydsc.com.cn

(79) 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：宋德清

电话：(010) 58568007

传真：(010) 58568062

客户服务电话：01058568162

网址：www.hrsec.com.cn

(80) 天风证券有限责任公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

电话：(027) 87618889

传真：(027) 87618863

客户服务电话：(027) 87618882, (028) 86711410、028-86712334

网址：www.tfzq.com

(81) 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：李学琦

电话：(024) 23266917

传真：(024) 23255606

客户服务电话：4006180315

网址：www.stockren.com

(82) 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B座4层

法定代表人：林义相

电话：(010) 66045608

传真：(010) 66045500

联系人：林爽

客户服务电话：(010) 66045678

网址：www.txsec.com或jijin.txsec.com

(83) 中信证券（浙江）有限责任公司

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

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

法定代表人：沈强

联系电话：(0571) 87112510

传真号码：(0571) 85783771

客户服务电话：（0571）96598

网址：www.bigsun.com.cn

（84）财富里昂证券有限责任公司

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：罗浩

电话：（021）38784818

传真：（021）68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877、（021）38784818

公司网站：www.cf-clsa.com

（85）财通证券有限责任公司

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（浙江），40086-96336（全国）

网址：www.ctsec.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：李勃

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：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358716

联系人：秦悦民

经办律师：秦悦民、王利民

（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有限公司

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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

注册会计师：汪棣、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称：华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型：ETF 联接基金，指数基金。

运作方式：契约型开放式。

六、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。

七、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基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。

八、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紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 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的紧密跟踪。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。

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

（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体决策、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。

3、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：金融工程部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 采取实物申赎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策略，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评估的结果，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。

(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： $95\% \times \text{上证龙头企业指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$

本基金的标的指数为上证龙头企业指数，同时考虑到投资于目标 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等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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 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 2012 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	42,674.00	0.01
	其中：股票	42,674.00	0.01
2	基金投资	542,769,385.14	92.48
3	固定收益投资	9,982,000.00	1.70
	其中：债券	9,982,000.00	1.70
	资产支持证券	-	-

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	33,917,789.29	5.78
7	其他各项资产	178,985.49	0.03
8	合计	586,890,833.92	100.00

2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	542,769,385.14	92.57

3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	采掘业	-	-
C	制造业	32,438.00	0.01
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑料、塑料	-	-
C5	电子	5,874.00	0.00
C6	金属、非金属	26,564.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	2,356.00	0.00
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	7,880.00	0.00
M	综合类	-	-
	合计	42,674.00	0.01

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

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	600019	宝钢股份	5,800	26,564.00	0.00

2	600880	博瑞传播	800	7,880.00	0.00
3	600060	海信电器	600	5,874.00	0.00
4	601933	永辉超市	100	2,356.00	0.00

5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	9,982,000.00	1.70
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,982,000.00	1.70

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

序号	债券代码	债券名称	数量 （张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	1001037	10央票37	100,000	9,982,000.00	1.70

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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 投资组合报告附注

9.1 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。

9.2 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。

9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,714.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	115,781.33
5	应收申购款	27,489.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,985.49

9.4 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。

9.5 报告期末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	600880	博瑞传播	7,880.00	0.00	重大资产重组

					停牌
--	--	--	--	--	----

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。

（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 2012 年 6 月 30 日）

阶段	净值增长率①	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
2012年1月1日至 2012年6月30日	6.71%	1.19%	5.67%	1.18%	1.04%	0.01%
2011年1月1日至 2011年12月31日	-19.31%	1.14%	-19.42%	1.15%	0.11%	-0.01%
自基金成立（2010 年11月18日）至 2010年12月31日	-2.10%	0.75%	-2.38%	1.17%	0.28%	-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费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 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：

$$H = \text{MAX} (E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, 0)$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的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：

$$H = \text{MAX} (E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, 0)$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的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多笔申购，适用费率按单笔分别计算。申购费率如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 500 万	0.5%
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的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)	赎回费率
Y < 1 年	0.5%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
Y ≥ 2 年	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×转出基金赎回费率

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》、《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	更新了部分直销机构和代销机构的信息； 更新了注册登记机构部分信息。
八、基金份额的申购、赎回与转换	更新了直销机构与代销机构部分信息。
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。
十、基金的业绩	更新了基金成立以来的业绩表现。
二十一、对基金份额持有人的服务	增加智能再平衡相关内容； 修改客户服务联系方式相关内容。
二十二、其他应披露事项	披露了自 2012 年 5 月 18 日至 2012 年 11 月 18 日期间本基金

露事项	的公告信息。
-----	--------

华安基金管理有限公司

二〇一二年十二月二十八日