国联安中证医药100指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2012年9月18日证监许可[2012]1237号文核准募集。

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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资债券引发的信用风险,以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为股票型基金和被动投资型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

在满足相关条件(具体相关条件请见本基金基金合同"第十八部分、修改基金合同变更为ETF联接基金"一章)的前提下,无需召开基金份额持有人大会,基金管理人将根据基金合同的约定,修改本基金的基金合同,使本基金从国联安中证医药100指数证券投资基金变更为以国联安中证医药100股票交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF的ETF联接基金。变更完成后,本基金更名为国联安中证医药100股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金,运作方式为契约型开放式。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。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,由投资者自行负担。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年2月21日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日:2013年8月21日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国联安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9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9楼
法定代表人:庹启斌
成立日期:2003年4月3日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]42号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元人民币
存续期限:五十年或股东一致同意延长的其他期限
电话:(021)38992888
联系人:李斐

股权结构:

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

(二)证券投资基金管理情况

截至本招募说明书(更新)所载内容截止日,公司旗下共管理24只基金:国联安德盛稳健证券投资基金(以下简称"国联安稳健证券")、国联安德盛小盘精选证券投资基金(以下简称"国联安小盘精选混合")、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金(以下简称"国联安心成长混合")、国联安德盛精选股票证券投资基金(以下简称"国联安精选股票")、国联安德盛优势股票证券投资基金(以下简称"国联安优势股票")、国联安德盛红利股票证券投资基金(以下简称"国联安红利股票")、国联安德盛增利债券证券投资基金(以下简称"国联安增利债券")、国联安主题驱动股票型证券投资基金(以下简称"国联安主题驱动股票")、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金(以下简称"国联安双禧中证100指数分级")、国联安信心增益债券型证券投资基金(以下简称"国联安信心增益债券")、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"商品ETF")、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"国联安上证商品ETF联接")、国联安货币市场证券投资基金(以下简称"国联安货币")、国联安优选行业股票型证券投资基金(以下简称"国联安优选行业股票")、国联安信心增长债券型证券投资基金(以下简称"国联安信心增长债券")、国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称"国联安双力中小板综指分级")、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(以下简称"国联安双佳信用分级债券")、国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金(以下简称"国联安中债信用债指数增强")、国联安保本混合型证券投资基金(以下简称"国联安保本混合")、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金(以下简称"国联安股债动态")、国联安中证医药100指数证券投资基金(以下简称"国联安医药100指数")、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"国联安新精选混合")、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金("国联安通盈混合")和国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金("国联安鑫安灵活配置混合")。

(三)主要人员情况

1、董事会成员

(1)庹启斌先生,董事长,经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁,国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事、党委委员;国联安基金管理有限公司董事长,并代为履行总经理职责。

(2)Andrew Douglas Eu(余义模)先生,副董事长,工商管理硕士。历任怡富证券投资有限公司高级研究分析员、投资经理、董事(地区业务)、JF资产管理有限公司董事、行政总裁。现任德盛安联亚太区行政总裁及公司全球执行委员会成员、德盛安联资产管理有限公司(香港)董事、研富资产管理有限公司(亚太地区)董事。

(3)叶锦华先生(IP Kam Wah),董事,学士学位,澳洲注册会计师。历任瑞士银行香港分行会计经理、财务总监;瑞士银行集团财务董事、亚太区财务变更计划负责人及项目总监;瑞银环球资产管理有限公司亚太区首席财务总监及常务董事;瑞银证券投资信托股份有限公司财务总监及公司监事;瑞银环球资产管理(日本)有限公司法定核数师;国投瑞银基金管理有限公司监事、监事长。现任德盛安联资产管理有限公司首席财务总监,德盛安联资产管理公司(香港、日本、新加坡、台湾)董事、研富资产管理有限公司(亚太地区)董事。

(4)汪卫杰先生,董事,经济学硕士,会计师职称。1994年起进入金融行业,历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现任国泰君安证券股份有限公司监事会办公室主任、纪检监察室主任。

(5)程静萍女士,独立董事,高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理,上海市财政局、税务局副局长,上海市计划委员会、上海市发展计划委员会副主任兼上海市物价局局长、上海市发展和改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海银行独立董事、上海市创业投资行业协会会长。

(6)王鸿嫩女士,独立董事,法学士。历任台湾摩根资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理、怡富证券投资顾问公司总经理,中国摩根资产管理董事总经理、上投摩根基金管理有限公司总经理。现主要从事教育工作和公益活动。

(7)胡斌先生,独立董事,特许金融分析师(CFA),美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司担任Standish Mellon量化分析师、公司副总裁,Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起,于纽银梅隆西部基金管理有限公司(筹建)担任筹建组副组长。2010年7月起,于纽银梅隆西部基金管理有限公司担任首席执行官(总经理)。现任上海系数投权投资基金管理合伙企业(有限合伙)担任总经理。

2、监事会成员

(1)元落伟女士,监事会主席,北京大学光华管理学院工商管理硕士。历任中国工商银行大连分行出纳、会计、信息技术等工作,1992年担任工商银行信托公司证券部副主任;1994年加入君安证券任大连营业部总经理助理,期间兼任君安物业有限责任公司总经理;1999年担任国泰君安证券大连西安路营业部副总经理;2004年起任大连营业部总经理;2005年起任辽宁营销总部副总经理;2007年起任辽宁营销总部总经理;2009年起担任辽宁分公司总经理;2012年起任财富管理部总经理;现任国联安基金管理有限公司监事会主席。

(2)庄小慧女士,监事,法律硕士。历任Bell, Temple见习律师、McCague, Peacock, Borlack, McInnis & Lloyd大律师及事务律师助理、金杜律师事务所事务律师助理、瑞士再保险公司法律顾问。现任德盛安联资产管理(亚太)有限公司法律顾问。

(3)朱慧女士,职工监事,经济学学士,历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理,现任国联安基金管理有限公司财务部总监。

(4)刘消女士,职工监事,经济学学士,现任国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

3、公司高级管理人员

(1)庹启斌先生,董事长,代理总经理,经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁,国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事、党委委员;国联安基金管理有限公司董事长,并代为履行总经理职责。

(2)周浩先生,督察长,法学硕士。曾先后任职于中国证券监督管理委员会和上海航运产业基金管理有限公司。2012年2月加盟国联安基金管理有限公司,现担任国联安基金管理有限公司督察长。

(3)李柯文女士,副总经理,经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理,现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(4)魏东先生,副总经理,经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司;2003年1月加盟华宝兴业基金管理有限公司,先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司,先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起,担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009年12月至2011年8月,兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。2014年3月起,兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5)满黎先生,副总经理,研究生学历。曾任职于华安基金管理有限公司,先后担任上海分公司高级投资顾问、西安分公司总经理、华东业务总部总经理、北京总部高级董事总经理;2012年9月加盟国联安基金管理有限公司,担任市场总监。自2012年11月起,担任国联安基金管理有限公司副总经理。

4、基金经理

黄志钢先生,硕士,先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司,2012年3月起担任国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金经理,2012年6月至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起兼任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人(根据需要)组成。投资决策委员会成员为:

庹启斌先生(代为履行总经理职责)投委会主席
魏东(投资总监,副总经理)投委会执行主席
冯俊(固定收益部负责人)
韦明亮(投资组合管理部总监)
高级基金经理1-2人(根据需要)

三、基金托管人

(一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:牛锦明
住所: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
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:汤嵩彦
电话:021-95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市,是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。交通银行连续五年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强,营业收入排名第243位,较上年提升83位;列《银行家》杂志全球1,000家最大银行一级资本排名第23位,较上年提升7位。2014年荣获《首席财务官》杂志评选的"最佳资产托管奖"。截至2014年9月30日,交通银行资产总额达到人民币6.21万亿元,实现净利润人民币515.22亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、极践进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锦明先生,董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生,副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行马鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

钱文挥先生,执行董事、副行长。

钱先生2007年8月起任本行执行董事、副行长,2004年10月至2007年8月任本行副行长(其中:2005年7月至2006年11月兼任本行上海分行行长)。钱先生1998年于上海财经大学获工商管理硕士学位。

刘树军先生,资产托管部总经理。

刘先生2012年5月起任本行资产托管部总经理。2011年10月起任本行资产托管部副总经理,2011年10月前历任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长,农行总行托管部及养老金中心副总经理,本行内蒙古分行副行长。刘先生管理学硕士,高级经济师。

(三)基金托管业务经营情况

截止2014年四季度末,交通银行共托管证券投资基金116只。此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品。

四、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

(1)直销机构

名称:国联安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9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9楼
法定代表人:庹启斌
联系人:李斐
客户服务电话:400-700-0365(免长途通话费),86-21-3878 4766
网址:www.vip-finds.com或www.GTJA-Allianz.com

(2)销售机构

1)名称:交通银行股份有限公司
住所:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锦明
电话:021-58781234
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

2)名称:上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海中山东一路12号
办公地址:上海中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:(021)61616206
联系人:虞谷云
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

3)名称:中信银行股份有限公司
住所:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦
法定代表人:常振明
电话:010-8993 6689
联系人:方爽
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

4)招商银行股份有限公司
住所:中国广东省深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:中国广东省深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
电话:0755-83077278
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

5)国泰君安证券股份有限公司
住所: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
联系电话:021-38676161
联系人:芮敏琪
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com

6)名称:中信证券股份有限公司
住所: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;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:010-85130579
联系人:张于爱
客户服务电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com

7)名称:中信证券(浙江)有限责任公司
住所:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19层、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19层、20层
法定代表人:沈强
电话:0571-86078823
联系人:周婷
客户服务电话:95548
网址:www.bigsun.com.cn

8)名称:国信证券股份有限公司
住所:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
电话:0755-82133066
联系人:李颖
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

9)名称:中国国际期货有限公司
住所: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
联系人:赵森
电话:010-59539864
客服电话:95162、400-8888-160
网址:www.cifco.net

10)名称:天风证券股份有限公司
住所: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:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
电话:027-87618882
联系人:翟璐
客户服务电话:400-8005-000
网址:www.ftzq.com

11)名称:德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
联系人:朱磊
电话:021-68761616
客服电话:400-8888-128
网址:www.tebon.com.cn

12)名称:天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:010-66045608
联系人:尹伶
客户服务电话:010-66045678
网址:www.txsec.com

13)名称:上海好买基金销售有限公司
住所:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-58870011
联系人:王玉山
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

14)名称:上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
法定代表人:其实
电话:021-54509998
联系人:徐兰兰
客户服务电话:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn

15)名称:杭州数米基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
法定代表人:陈柏青
电话:0571-28829790
联系人:周臻旻
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

16)名称:深圳众禄基金销售有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
联系人:童彩平
客户服务电话:400-678-8887
网址:www.zlfund.cn

17)名称:和讯信息科技有限公司
住所: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18楼
法定代表人:王莉
电话:021-68419822
联系人:周轶
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:国联安基金管理有限公司
住所及办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
法定代表人:庹启斌
联系人:李斐
电话:021-38992888

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
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
联系人:安冬
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:吕红、安冬

(四)审计基金资产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所
住所及办公地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
负责人:蔡廷基
联系人:王国蓓
联系电话:021-22122428
传真:021-62881889
经办注册会计师:王国蓓、戴丽

五、基金的名称

国联安中证医药100指数证券投资基金

六、基金的类型

股票型证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的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%,为投资者提供一个投资中证医药100指数的有效工具,从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。

八、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发,包含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、到期日在一年之内的政府债券、债券回购、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的比例不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产市值不低于股票资产的90%;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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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。

九、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的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%,以实现对中证医药100指数的有效跟踪。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并结合合理的投资管理策略等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、股票组合的构建方法

本基金按照成份股在中证医药100指数中的基准权重构建股票投资组合。如有股票停牌的限制、股票流动性、法律法规限制等因素,使基金管理人无法依指数权重购买某成份股,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成分股等)进行适当替代。

针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购。

2、股票指数化投资日常投资组合管理

(1)组合调整原则

本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与标的指数间的跟踪误差最小化。

(2)投资组合调整方法

本基金将对标的指数进行定期与不定期跟踪调整。

1)定期调整

本基金根据所跟踪的中证医药100指数成份股定期调整而进行相应调整。

2)不定期调整

当成份股发生增发、送配等情况对成份股在指数中的权重影响较大时,本基金将根据指数公司公布的指数权重文件进行相应调整;

根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

(3)跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。

3、债券的投资策略

基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年之内的政府债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性同时提高基金资产的投资收益。

4、股指期货的投资

本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

(二)投资决策过程

1、投资依据

(1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;

(2)经济运行态势和证券市场走势。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3、投资程序

(1)首先运用数量化模型以及各种风险监控指标,结合公司内外的研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析,提出研究分析报告。

(2)投资决策委员会依据相关研究分析报告,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,进行基金投资管理的日常决策。

(3)基金经理根据标的指数,结合研究分析报告,原则上依据指数成份股的权重构建资产组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的技术和方法,降低交易成本,控制投资风险。

(4)交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。

(5)根据市场变化,定期和不定期评估基金投资绩效。风险管理部对基金投资计划的执行进行日常监督和风险控制。

(6)基金经理密切跟踪标的指数的变动,结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、绩效评估报告等,对投资组合进行监控和调整,以实现对跟踪误差的有效控制。

(7)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。

十、标的指数和业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数为中证医药100指数。

中证医药100指数是由中证指数有限公司编制和计算(关于指数信息和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司),由中证指数公司于2011年3月18日正式发布的反映医药行业公司股票走势的指数。中证医药100指数以沪深A股为样本空间,根据中证行业分类,从医药卫生行业和药品零售行业中挑选日均总市值前100位的公司股票为成份股,设置等权重因子以使每个样本权重相等,采取派许加权法编制而成。中证医药100指数以2004年12月31日为基日,以该日所有股票样本的调整市值为基期,基点均为1000点。

中证医药100指数具有市场代表性好、历史业绩表现突出、编制规则透明度高、成份股数目适合跟踪、流动性强、未来创新潜力较大等综合优势。

如果中证医药100指数被停止编制及发布,或中证医药100指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致中证医药100指数不宜继续作为标的指数,或本基金变更为以国联安中证医药100股票交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF的ETF联接基金后,该目标ETF变更标的指数的,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,通过履行适当程序更换本基金的标的指数、投资对象、业绩比较基准和基金名称等,并根据《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

其中,若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒体上刊登公告;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),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案并及时公告。

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:95%×中证医药100指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。

如果今后法律法规或基金合同发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开持有人大会。

十一、风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十二、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2014年12月31日,本报告财务资料未经审计师审计。

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	551,429,383.23	90.48
	其中:股票	551,429,383.23	90.48
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	39,531,543.60	6.49
7	其他资产	18,466,455.80	3.03
8	合计	609,427,382.63	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 指数投资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	采矿业	-	-
C	制造业	480,353,808.03	80.47
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	46,658,296.38	7.82
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,590,318.19	1.27
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	16,826,960.63	2.82
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	551,429,383.23	92.38

2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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	000623	吉林敫东	292,050	10,166,260.50	1.70
2	002424	贵州百灵	185,504	7,614,939.20	1.28
3	600645	中源协和	187,369	7,590,318.19	1.27
4	000650	仁和药业	949,016	7,326,403.52	1.23
5	600056	中国医药	431,074	7,073,924.34	1.19
6	600511	国药股份	223,865	6,937,576.35	1.16
7	600614	鼎立股份	508,703	6,765,749.90	1.13
8	600252	中恒集团	412,155	6,742,855.80	1.13
9	600521	华海药业	444,820	6,467,682.80	1.08
10	600380	健康元	874,613	6,288,467.47	1.05

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股票。

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 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。

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。

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投资。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	146,714.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,878.32
5	应收申购款	18,307,862.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,466,455.80

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。

11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。