

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

2015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

二〇一五年五月

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”)依照相关法律法规及约定设立,并经中国证监会核准(以下简称“中国证监会”)于2014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[2014]1475号)核准。本基金合同自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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资者应在投资前仔细阅读本基金的招募说明书(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适合其风险承受能力。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。本基金根据基金合同和招募说明书约定,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关系的主要法律文件,也是确定基金份额持有人权利和义务以及基金管理人、基金托管人之间权利义务关系的主要法律文件,投资者认购(或申购)基金份额即视为对基金合同的承认和接受,并视同基金合同、(运作办法)、基金合同及其他相关文件的组成部分。

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。本基金的投资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者基金投资的“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,由投资者自行承担。

本招募说明书与基金管理人相关的基金信息已经基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书内容截止日为2015年5月29日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日。

一、基金的基本情况

1.基金名称

基金名称:华安标普全球石油指数证券投资基金

2.基金的类型

本基金为股票型指数基金,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。

3.基金的投资目标

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

4.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、固定收益类资产、货币市场工具和中国证监会认可的其他金融产品或金融工具。

本基金投资于标普全球石油指数成分股,备选成分股,与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类资产、货币市场工具和中国证监会认可的其他金融产品或金融工具的比例不高于基金资产净值的20%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本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。本基金的投资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者基金投资的“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,由投资者自行承担。

5.基金的投资策略

本基金以标普全球石油指数成分股及其权重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、行业代表性及所在市场准入限制等进行筛选,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市值占标的指数的90%以上,并且集中了全球规模最大的大型上市公司和流动性较好的大型上市公司。本基金将根据一定比例的基金资产投资于与石油行业有关的公募基金,以上优化投资组合的建立,达到可投资交易成本有效降低的目的。

跟踪误差指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,控制基金相对标的指数的跟踪误差。基金管理人定期跟踪投资组合与比较基准的跟踪误差,适时调整投资组合,使跟踪误差控制在预定范围内。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,半年跟踪误差不超过1.6%(以美元资产计价)。当基金运作发展到一定程度后,本基金可能会将跟踪误差控制在跟踪偏离度的绝对值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:

$$TD_t = R_{it} - R_{bt}$$

$$R_{it} = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - R_{bt}$$

$$R_{bt} = \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

$$TD_t = \ln \frac{V_{it}}{V_{i,t-1}} - \ln \frac{V_{bt}}{V_{b,t-1}} - R_{bt}$$

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	72,077,194.08	81.31
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
其他	-	-
合计	72,077,194.08	81.31

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
非必需消费品	-	-