

华安标普全球石油指数证券投资基金(L.O.F)更新的招募说明书摘要

2015年第2号

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇一五年十一月

重要提示
华安标普全球石油指数证券投资基金(L.O.F)(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(L.O.F)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。
投资者在购买基金前应仔细阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的投资风险特征,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。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书基金合同和基金招募说明书的编制,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,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。
本招募说明书及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,本招募说明书所载内容截止日为2015年9月29日,有关基金名称和净值表现截止日为2015年6月30日。

一、基金名称

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

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

本基金投资于标普全球石油指数成分股,选成成分股,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和金融工具。
本基金投资于标普全球石油指数成分股,选成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和投资比例规定。

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,选成成分股,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和金融工具。
本基金投资于标普全球石油指数成分股,选成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和投资比例规定。

五、基金的投资策略

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选成成分股的可投资性、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较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跟踪标的指数的目的。

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跟踪误差。基金定期跟踪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%,年化跟踪误差不得超过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准转换为代表相同风险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:

$$TD = R_p - R_b$$

$$R_p = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{p,i}$$

$$R_b = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{b,i}$$

$$TD = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (R_{p,i} - R_{b,i})$$

$$TD = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{p,i} - \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{b,i}$$

$$TD = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{p,i} - \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n R_{b,i}$$

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

行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	478,780,104.92	88.24
合计	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	478,780,104.92	88.24
合计	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	478,780,104.92	88.24
合计	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
消费品	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
能源	478,780,104.92	88.24
合计	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.67
道达尔	1,004,320.99	0.19
英国石油	478,780,104.92	88.24

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

股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
埃克森美孚	291,684,772.21	53.76
壳牌	165,794,276.78	30.86
道达尔	33,949,847.75	6.43
英国石油	22,260,472.45	4.19
雪佛龙	5,386,682.68	1.01
埃克森美孚	13,141,973.84	2.47
壳牌	3,642,208.30	0.