

中银沪深300等权重指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要

(2014年第2号)

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
二〇一四年十二月

重要提示

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)经中国证监会2011年11月4日证监许可【2011】1752号文核准进行募集,基金合同于2012年5月17日正式生效。

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对本基金业绩表现的保证。

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

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,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人将在基金管理人实施过程中产生的基金管理风险。本基金的特有风险。

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、义务的法律性文件。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。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书中基金投资组合管理策略部分(以下简称“投资策略”)所载,但中国证监会核准,但中国证监会核准,并不表明其对本基金的价值和收益的预测构成实质性判断或保证,也不表明其对基金没有投资。

本更新招募说明书所载内容截止日为2014年11月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人招商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日
2012年5月17日
二、基金管理人
(一)基金管理人概况
公司名称:中银基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人:李澜
设立日期:2004年8月12日
电话:(021)38834999
传真:(021)68872488
联系人:高爽秋
注册资本:1亿元人民币
股权结构:

股 东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8380万元	83.5%
贝莱德投资管理(美国)有限公司	相当于人民币1650万元的美	16.5%

(二)主要人员情况
1.董事会成员
谢炯(Tian Jiang)先生,董事长。国籍:中国。武汉大学硕士研究生,高级经济师,云南省人民政府特殊津贴专家。历任中国银行武汉市青山支行行长、党总支书记,中国银行西藏自治区分行行长、党委书记、中国银行云南省分行行长、党委书记等职。

李道滨(Li Daobin)先生,董事。国籍:中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司,历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有14年基金行业从业经验。

梅非奇(MEI Feiqi)先生,董事。国籍:中国。现任中国银行总行办公室主任。哈尔滨工业大学硕士研究生,高级工程师,高级经济师。曾先后任地质矿产部、国务院办公厅工作,加入中国银行后,历任中国银行总行办公室副主任、中国银行北京市分行副行长、中国银行总行个人金融总部总经理等职。

葛伟伟(David Graham)先生,董事。国籍:美国。现任贝莱德投资管理咨询有限公司董事总经理,主要负责管理贝莱德美国企业关系方面的业务。葛伟伟先生于1977年—1984年供职于Deloitte Haskins & Sells(现为普华永道)伦敦和悉尼分公司,之后,在拉扎兹(Lazard)银行任职。香港和东京分公司任职。1992年,加入美林投资管理有限公司(MJLM),曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部门的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后,加入贝莱德。

朱嘉利(ZHU Shunli)先生,独立董事。国籍:中国。现任北京大学光华管理学院教授,博士生导师,北京大学中国中小企业促进会主任、21世纪经济报道中心主任、管理中心副主任,兼任中国投资协会理事、中国留学理事会、中国企业家协会常务理事、中原证券股份有限公司独立董事等职。曾任北京大学光华管理学院经济系讲师、副教授、系主任,北京大学光华管理学院应用经济学系主任、北京大学光华管理学院工商管理硕士、明德学院生物系主任。

靳新(JING Xin)先生,独立董事。国籍:中国。现任中国人民大学商学院党委书记兼副院长,会计学教授、博士生导师、博士后合作导师,兼任财政部会计准则委员会咨询专家、中国社会会计学会、全国会计专业学位教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事、安泰科技股份有限公司独立董事,风神轮胎股份有限公司独立董事。曾任中国人民大学会计系副主任,中国人民大学审计处处长等职。

葛礼(Gary Rieschel)先生,独立董事。国籍:美国。启明创投投资管理有限公司的创办者,现任董事总经理,同时供职于里德学院董事会议、亚洲协会、中美合资企业清洁能源、清洁技术论坛的间委员会,并担任纳斯达克上市公司TTHO的独立董事。曾在美国知名设计公司思科、英特尔任高级管理职位,并被多家杂志如福布斯、红鲱鱼、网络标准评为全球最主要的风险资本家之一。曾在美国英特尔公司担任品质保证经理,在美国NCube公司、思科公司、思科公司担任产品经理职位,后为SOFITBANK/Mobius风险资本的创办者、董事总经理。哈佛大学商学院工商管理硕士,里德学院生物系主任。

2.监事
赵旭坪(ZHAO Huiping)先生,监事。国籍:中国。中央党校经济管理局主任、中国人民大学资源管理、经济师。曾任中国银行行内资源部信息主管、中国银行行内人力资源部综合处副处长、处长、人事教育部干部、副处级。

乐融(YUE Ni)女士,职工监事。国籍:中国。上海交通大学工商管理硕士。曾分职就职于上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华银基金管理有限公司。2006年7月加入中银基金管理有限公司,现任基金运营部总经理。具有13年证券从业年限,10年基金行业从业经验。

3.管理层成员
李道滨(Li Daobin)先生,董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

刘旭向(Jason X. OUYANG)先生,督察长。国籍:加拿大。中国证券业协会—沃顿商学院高级管理培训班(Wharton-SAG Executive Program)毕业证书,加拿大西部大学毅伟商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士(MBA)和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大华人寿险公司等海外机构从事金融工作多年,也曾任嘉德资产管理有限责任公司(现光大证券)研究发展部中心总经理、融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文(ZHANG Jiawen)先生,副执行总裁。国籍:中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

4.基金经理
周小川先生,中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),香港城市大学金融数学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司,先后担任数量研究员、中银中证100指数基金基金经理助理、中银蓝筹精选基金经理等职。2010年11月至今任中银中证100指数基金基金经理,2011年6月至2014年任国泰ETF基金经理,2012年5月至今任中银沪深300等权重指数基金(LOF)基金经理。具有7年证券及从业年限。具备基金从业资格。

5.投资决策委员会成员的姓名及职务
主席:李道滨(执行总裁)
成员:陈军(助理执行总裁)、杨军(资深投资经理)、奚鹏洲(固定收益投资部总经理)、张发余(研究部总经理)、李建(固定收益投资部副经理)

列席成员:欧阳向远(督察长)

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人
(一)基金托管人概况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.138亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755-83077301
传真:0755-83196201
资产托管部信息披露负责人:朱万鹏
(二)主要人员情况
李建红先生,本行董事长,非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事兼主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国远洋海运集团(集团)股份有限公司董事长、招商局华建重工投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总经理、总经理、副总裁,招商局集团有限公司总经理。

田惠宇先生,本行行长,执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年6月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长。大学本科毕业,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行长助理、副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行政助理,2008年4月任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

吴晓辉先生,招商银行资产托管部总经理,硕士研究生,高级经济师。1993年10月加入招商银行工作;历任招商银行总行计划资金部总经理,总行资金交易部总经理,招银国际银信基金有限公司总裁,招商银行济南分行党委书记、行长,2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况
截至2014年9月30日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商股票证券投资基金,招商平衡型证券投资基金和

招商债券证券投资基金),招商现金增值开放式证券投资基金,华夏经典配置混合型证券投资基金,长城久泰沪深300指数证券投资基金,华夏货币市场基金,光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞金字塔稳增债增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金,光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势债券证券投资基金、华富成长趋势灵活股票型证券投资基金,光大保德信优势配置股票型证券投资基金,益民多利债券型证券投资基金,德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中价价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信红利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕丰分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国油气能源股票型证券投资基金(LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强回报定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安弘利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰收纯债债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用添利一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、中邮睿享全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月新定期支付债券型证券投资基金、中银保本2号混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、交银蓝筹成长股票投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型证券投资基金、宝盈养老目标混合型证券投资基金和国泰养老分级债券型证券投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、中银新动力灵活配置证券投资基金共05只开放式基金及其其它投资组合。

公司网站:www.longone.com.cn
17) 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
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯巍
联系人:李巍
客服电话:4008000562
公司网站:http://www.hysec.com
18) 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5层
法定代表人:林义相
联系人:林昊
客服电话:010-69045678
公司网站:http://www.txsec.com或www.jjm.com.cn
19) 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
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号国元大厦
法定代表人:蔡咏梅
联系人:方士涛
客服电话:05678
公司网站:www.gyzq.com.cn
20) 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:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网站:http://www.cindasc.com
21) 国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门内大街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内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
客服电话:4008188118
公司网站:www.guodu.com
22) 招商证券股份有限公司
办公地址: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
联系人:黄健
客服电话:95565
公司网站:www.newone.com.cn
23) 中国银河证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
客服电话:4008-889-888
公司网站:www.chinastock.com.cn
24) 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
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦20楼
法定代表人:王万华
联系人:芮筱婷
客服电话:95621
公司网站:www.gtja.com
25) 中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层

法定代表人:杨宝林
联系人:吴志超
客服电话:(0532) 95677
公司网站:http://www.xzwvt.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它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:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:(010)159378835
传真:(010)159378907
联系人:任丽娟
(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬
(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称:北京市东城区东长安街1号东方广场东楼A座16层
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东楼A座16层
执行事务合伙人:吴港平
电话:010-58153000
传真:010-5818298
联系人:汤敏
经办会计师:陈露、汤敏

五、基金名称
中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)
六、基金的投资目标
本基金为指数型目标,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数相似的投资回报。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。

八、基金的投资范围
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300等权重指数的成份股及备选股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规和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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他证券品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将基金资产投资。
本基金投资于沪深300等权重指数成份股及备选股成份的资产比例不低于基金资产净值的90%,除股票以外其他基金资产净值占的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过其他基金资产净值的3%,现金或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%。

九、标的指数的
本基金以沪深300等权重指数为标的指数。
沪深300等权重指数与沪深300指数具有相同的成份股,选取规模大、流动性好的300只股票作为样本,是反映沪深两市A股综合表现的股市场成份指数。不同的是,沪深300等权重指数采用了等额加权,设置等权重因子以使所有样本股票相等。沪深300等权重指数的个股与行业权重分布更为均匀,为投资者提供了新的投资标的。
如果出现因沪深300等权重指数被终止编制及发布,被其它指数替代或指数编制方法发生重大变更等原因导致该指数不宜继续作为标的指数的规定,或法律法规或监管机构对证券投资基金投资标的指数的规定进行调整,则基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更基金标的指数,投资对象和业绩比较基准。
本基金由于上述原因变更标的指数、投资对象和业绩比较基准,不需召开基金份额持有人大会通过,但应即时通知本基金托管行并报中国证监会,并在中国证监会指定的媒体上公告。

十、投资策略
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
(一)资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300等权重指数成份股和备选股成份。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,现金或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%。

十一、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
(一)资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300等权重指数成份股和备选股成份。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,现金或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%。

十二、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
(一)资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300等权重指数成份股和备选股成份。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,现金或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%。

十三、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
(一)资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300等权重指数成份股和备选股成份。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,现金或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%。

十四、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
(一)资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300等权重指数成份股和备选股成份。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%,其中中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,现金或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%。

十五、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如标的指数的指数编制规则出现其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
(三)债券投资策略
本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析,评定各品种的投资价值,同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的政府债券进行投资。

十六、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如标的指数的指数编制规则出现其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
(三)债券投资策略
本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析,评定各品种的投资价值,同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的政府债券进行投资。

十七、基金的投资组合
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如标的指数的指数编制规则出现其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
(三)债券投资策略
本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析,评定各品种的投资价值,同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的政府债券进行投资。

Vt:指数中所有成份股在t时刻的调整市值总和;
Mt,t:投资在成份股上的资金;
MO:投资总资产;
Nt,t:购买成份股的股票数量;
Pt,t:成份股在t时刻的价格。

(五)跟踪误差控制策略
基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行日常的监控与管理,其中,跟踪误差为核心监控指标,跟踪偏离度为辅监控指标。基金管理人将建立对事后跟踪误差的监控体系,实施严格的事后跟踪误差管理,同时通过对组合事前跟踪误差的估计与分解获取有效的降低跟踪误差的组合调整方法,以求有效控制投资组合相对于业绩基准的跟踪风险。
本基金跟踪偏离度及跟踪误差的定义及计算公式如下:
跟踪偏离度(Tracking Difference):采用基金份额净值(NAV)增长率与业绩基准增长率之差来衡量,计算公式如下:

跟踪误差(Tracking Error):本基金以日跟踪误差为测算指标,对投资组合进行监控与评估。采用跟踪偏离度的波动性来衡量,计算公式如下:

其中,TDt为跟踪偏离度Tdt的样本均值,n为计算区间,本基金计算区间为每周最后一个交易日起前30个交易日(含当天)。本基金将跟踪日跟踪误差的最大容忍度设定为0.25%。相应折算的年限跟踪误差约为74%,以每周为检测周期,即本基金每周计算该指标,计算区间为每周最后一个交易日起前30个交易日(含当天)。如该指标接近或超过0.25%,则基金经理必须通过归因分析,找出造成跟踪误差的来源,通过对投资组合进行进行调整,以使跟踪误差回到最大容忍范围。跟踪跟踪误差在最大容忍值以内时,由基金经理对最优跟踪误差的选择作出判断。
当本基金运作发展到一定阶段后,本基金可能会对测算基础作为代表相同跟踪误差的周期与跟踪误差。

(六)投资组合调整策略
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成份股比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等情况,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准增长率之间的跟踪误差最小化。
2.投资组合调整方法
(1)对标的指数的跟踪调整
本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的沪深300等权重指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。
定期调整
本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的沪深300等权重指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。沪深300等权重指数成份股的定期调整定于每年1月和7月的第一个交易日实施,通常在前一年的12月和当年的6月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案。

不定期调整
在以下情况出现时,本基金将对指数投资组合进行调整:
a.新上市股票,若符合快速进入指数标准,引起标的指数在其上市第十个交易日结束后发生调整,本基金将做相应调整;
b.当成份股暂停或终止上市时,相应成份股从指数计算中剔除,本基金将做相应调整;
c.当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的股权比例,进行相应调整;
d.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。
e.当个别成份股因停牌、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的权重进行购买时,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;

(七)其他需要调整的事项。
(二)限制性调整
根据法律法规中针对对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按其基准确定投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时的被动性卖出调整,并相应地对其资产类别或个股进行微调,以保证基金合法规范运行。
大额赎回调整
当发生大额赎回超过基金净值比例时,本基金将对股票投资组合进行不同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。
十一、业绩比较基准
沪深300等权重指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%
如果沪深300等权重指数被终止编制及发布,或沪深300等权重指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法变更导致沪深300等权重指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更适合作为投资的指数作为本基金的目标的指数,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调整本基金的目标的指数和业绩比较基准;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和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,不需召开基金份额持有人大会通过,但应经托管人同意并报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上公告。

十二、风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
十三、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
(一)基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利,保护基金份额持有人的利益;
(二)不谋求对上市公司的控股、不参与所投资上市公司的经营管理;

(三)有利于基金财产的安全与增值;
(四)通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的人谋取不当利益。
十三、基金投资组合报告
本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。
本基金的托管人——招商银行股份有公司根据本基金合同规定,于2014年12月5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。
本基金组合报告所载数据截至2014年9月30日,本报告所列财务数据未经审计。

(一)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	82,675,860.00	94.06	
	其中:股票	82,675,860.00	94.06	
2	固定收益投资	32,607.90	0.04	
	其中:债券	32,607.90	0.04	
	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	4,369,542.64	4.97	
7	其他各项资产	821,435.41	0.93	
8	合计	87,899,446.55	100.00	

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	575,893.32	0.66
B	采矿业	8,175,628.40	9.36
C	制造业	36,209,072.98	41.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,598,759.18	5.27
E	建筑业	4,103,333.54	4.70
F	批发和零售业	3,973,960.95	4.53
G	交通运输、仓储和邮政业	2,884,697.08	3.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,927,204.04	4.50
J	金融业	9,919,710.90	11.36
K	房地产业	3,492,045.24	4.00
L	租赁和商务服务业	1,396,400.68	1.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	897,891.84	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,633,197.88	1.87
S	综合	828,064.59	0.95
	合计	82,675,860.00	94.70

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	575,893.32	0.66
B	采矿业	8,175,628.40	9.36
C	制造业	36,209,072.98	41.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,598,759.18	5.27
E	建筑业	4,103,333.54	4.70
F	批发和零售业	3,973,960.95	4.53
G	交通运输、仓储和邮政业	2,884,697.08	3.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,927,204.04	4.50
J	金融业	9,919,710.90	11.36
K	房地产业	3,492,045.24	4.00
L	租赁和商务服务业	1,396,400.68	1.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	897,891.84	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,633,197.88	1.87
S	综合	828,064.59	0.95
	合计	82,675,860.00	94.70

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资股票
2.报告期末按行业分类的股票投资组合