

深证300交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第1号)

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司
 基金托管人: 中国工商银行股份有限公司
 重要提示
 本基金经2011年6月7日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】886号文核准募集。本基金基金合同于2011年9月16日正式生效。

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。

在投资本基金前, 投资者应认真阅读本招募说明书, 全面认识本基金产品的风险收益特征, 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, 基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险, 等等。

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。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证投资者保证基金一定盈利, 也不向投资者保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的基础招募说明书编写, 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。本基金投资者自依基金合同取得基金份额, 即成为本基金的份额持有人和本基金合同当事人, 其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受, 并按《基金法》、基金合同及其他有关法律享有权利、承担义务。基金投资者欲了解本基金持有人的权利和义务, 应仔细阅读基金合同。

本招募说明书更新截止日为2017年3月16日, 有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31日, 有关基金管理人的内容截至招股公告日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一) 基金管理人简介
 名称: 汇添富基金管理股份有限公司
 住所: 上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
 办公地址: 上海市富锦路99号震旦国际大厦22楼
 法定代表人: 李文
 成立时间: 2005年2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: 证监基金字[2005]15号
 注册资本: 人民币132,724,224元
 联系人: 李羿
 联系电话: 021-28932888
 股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	36.412%
上海鼎晖股权投资管理合伙企业(有限合伙)	24.056%
上海上投资产管理有限公司	19.966%
东航金融控股有限责任公司	19.966%
合计	100%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员
 李文先生, 2015年4月16日担任董事长。国籍: 中国, 1967年出生, 厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长, 历任中国人民银行厦门市中心支行副科长, 中国人民银行杏林支行, 国家外汇管理局杏林支副行长、副局长, 中国人民银行厦门市中心支行外汇管理一处、二处副处长, 东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理, 稽核总部总经理, 东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理, 汇添富基金管理股份有限公司督察长。
 肖顺成先生, 2000年4月20日担任董事。国籍: 中国, 1963年出生, 复旦大学EMBA。现任东航金融控股有限公司董事长兼党委书记, 东航集团财务有限责任公司董事长, 东航期货有限责任公司董事长, 东航国际控股(香港)有限公司董事长, 东航国际金融(香港)有限公司董事长, 历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理, 东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

程峰先生, 2016年11月20日担任董事。国籍: 中国, 1971年出生, 上海交通大学工商管理硕士。现任上海投信基金集团副总经理, 上海上投资产管理有限责任公司董事长, 上海文化产权交易所股份有限公司董事长, 上海瑞力投资管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会上海贸易委员会书记, 书记, 上海机械进出口(集团)有限公司副总经理, 上海市对外经济贸易委员会技术进出口处副处长, 上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长, 处长, 上海国际集团有限公司办公室主任, 上海国际集团有限公司行政管理总部总经理, 上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理, 上海国际集团金融服务股份有限公司党委书记、董事长、总经理, 上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长, 上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

张晖先生, 2015年4月16日担任董事, 总经理。国籍: 中国, 1971年出生, 上海财经大学数量经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理, 汇添富资产管理(上海)有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师, 富国基金管理有限公司高级分析师, 研究主管兼基金经理, 汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监, 投资决策委员会副主席, 曾任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

韦夫杰(Jeffrey R. Williams)先生, 2007年3月2日担任独立董事。国籍: 美国, 1963年出生, 哈佛大学商学院工商管理硕士, 哈佛大学肯尼迪政府学院艾什民主治理与创新中心高级研究员等。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长, 美国运通银行台湾分行副总裁, 台湾美国运通国际股份有限公司副总裁, 渣打银行台湾分行总裁, 深圳发展银行行长, 哈佛大学中国董事总经理。

林志军先生, 2015年4月16日担任独立董事。国籍: 中国香港, 1956年出生, 厦门大学经济学博士, 加拿大Saskatchewan大学工商管理学硕士。现任厦门大学科技大学商学院院长、教授、博导, 历任福建省科学技术委员会计划财务处处长。五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多多分所审计员, 厦门大学会计师事务所副主任会计师, 厦门大学经济学院讲师、副教授, 伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者, 美国伊利诺大学Stateville University会计学访问学者, 加拿大Lethbridge University管理学院会计学讲师、副教授、教授, 香港大学商学院访问教授, 香港中文大学商学院会计与法律系教授、博导。

杨青茂女士, 2011年12月19日担任独立董事。国籍: 中国, 1971年出生, 复旦大学经济学硕士。现任第一财经日报副总编辑, 第一财经研究院院长, 中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员, 《第一财经日报》创刊编委之一, 第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创办人及主持人, 《波士堂》第一档目资深评论员。曾任《解放日报》记者, 《第一财经日报》编委, 2002-2003年期间受邀成为约翰·霍普金斯大学访问学者。

2、监事会成员
 任福良先生, 2004年10月20日担任监事, 2015年6月30日担任监事会主席。国籍: 中国, 1963年出生, 大学学历, 会计师, 非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上投资产管理有限公司董事会秘书兼监事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员, 发展协调办专员, 信贷业务规划发展总部总经理助理, 秘书处主任(主持工作), 东方证券研究所证券市场战略策略研究员, 董事会办公室资深主管, 现任公司监事会主席。

毛海东, 2015年4月16日担任监事, 国籍: 中国, 1978年出生, 国际金融学硕士。现任东航金融控股有限责任公司总经理助理兼财务管理中心总经理。曾任于东航期货有限责任公司, 东航集团财务有限责任公司。

王静女士, 2008年2月23日担任职工监事。国籍: 中国, 1977年出生, 中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任任职于中国东方航空公司宣传部, 东航航空管理有限责任公司研发发展部。

林旋女士, 2008年2月23日担任职工监事, 国籍: 中国, 1977年出生, 华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监, 汇添富资产管理(上海)有限公司监事。曾任任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生, 2013年8月8日担任职工监事, 国籍: 中国, 1979年出生, 北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任任职于罗兰贝格管理咨询有限公司, 泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、督察人员
 李文先生, 董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)
 张晖先生, 2015年6月26日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

雷耀明先生, 2012年3月7日担任副总经理。国籍: 中国, 1971年出生, 工商管理硕士。历任中国银监会国际信托投资公司网上交易部副经理, 中国民族证券有限责任公司营业部总经理, 经纪业务总监, 总经理助理, 2011年12月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任公司副总经理。兼投女士, 2013年1月7日担任副总经理。国籍: 中国, 1971年出生, 金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司, 华夏证券股份有限公司, 嘉实基金管理有限公司, 招商基金管理有限公司, 华夏基金管理有限公司, 以及富达基金北京与上海代表处工作, 负责投资管理, 证券投资决策, 以及基金产品策划、机构理财等工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任公司副总经理。

袁建军先生, 2015年8月5日担任副总经理。国籍: 中国, 1972年出生, 金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究员, 汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理, 并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2006年4月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生, 2017年3月3日担任副总经理。国籍: 中国, 1969年出生, 武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长, 厦门建行信用卡部处长、处长, 厦门建行信息技术部部长, 建行北京开发中心负责人, 建信信息技术管理部副总经理, 建信信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任, 建信信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生, 2015年6月26日担任督察长。国籍: 中国, 1978年出生, 上海交通大学经济学博士, 历任上海证监局主任科员、副处长, 上海农商银行同业金融部副总经理, 汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理
 (1) 现任基金经理
 赖立先生, 国籍: 中国, 学历: 北京大学中国经济研究中心金融学硕士, 15年证券从业经验, 从业经历: 曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部分析师, 量化投资部基金助理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理, 2015年6月30日至今任汇添富基金金融主题基金(LOF)的基金经理, 2012年11月1日至今任汇添富基金全球资产配置(ODI)基金的基金经理, 2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(ODI)基金的基金经理, 2015年1月6日至今任汇添富中证300ETF基金、汇添富中证300ETF基金联接基金的基金经理, 2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势混合基金的基金经理, 2016年12月29

日至今任汇添富中证环境治理指数(LOF)基金的基金经理。
 过伟女士, 国籍: 中国, 学历: 中国科学技术大学金融工程博士, 曾任德意志银行, 中国, 从业经历: 曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师, 量化投资部基金助理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理, 2015年6月30日至今任汇添富基金全球资产配置(ODI)基金、中证医药卫生ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富中证主题优选ETF联接基金的基金经理, 2015年8月18日至今任汇添富中证300ETF基金、汇添富中证300ETF基金联接基金的基金经理, 2016年12月29日至今任汇添富中证生物科技指数(LOF)基金的基金经理, 2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数(LOF)基金的基金经理。
 (2) 历任基金经理
 吴蔚翔先生, 2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
 汪洋先生, 2013年9月13日至2015年1月6日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
 5、投资决策委员会
 主席: 袁建军先生(副总经理)
 成员: 韩贤旺先生(首席经济学家)、王栩(权益投资总监)、陆文磊(总经理助理, 固定收益投资总监)、劳杰男(研究副总监)
 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

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
 办公地址: 1984年1月1日
 法定代表人: 易会满
 注册资本: 人民币35,640,625.71万元
 联系电话: 010-66105799
 联系人: 郭明
 (二) 主要人员情况
 截至2016年9月末, 中国工商银行资产托管部共有员工210人, 平均年龄30岁, 96%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, 依靠严谨科学的风险管理和内部控制体系, 规范的管理模式, 先进的系统设施和专业的管理团队, 严格履行托管人职责, 为海内外广大投资者、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, 展业信誉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、企业年金基金、QDII资产、ODI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、ODI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2016年9月, 中国工商银行共托管证券投资基金624只。自2003年以来, 本行连续十二年获得香港《亚洲货币》、《美国《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》等海内外权威财经媒体评选的95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
 1、申购赎回代理机构
 (1) 渤海证券股份有限公司
 住所: 天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
 办公地址: 天津市滨海新区开发区第二大街142号
 法定代表人: 刘广平
 电话: 022-28451861
 传真: 022-28451892
 联系人: 王兆光
 网址: www.bhzq.com
 客户服务电话: 400-6515-988
 2、长城证券股份有限公司
 注册地址: 深圳市福田区深南大道6088号特区报业大厦14、16、17层
 办公地址: 深圳市福田区深南大道6088号特区报业大厦14、16、17层
 法定代表人: 黄耀华
 电话: 0755-83516089
 传 真: 0755-83515667
 3、东方证券股份有限公司
 注册地址: 上海市中山南路318号2号楼22层-29层
 法定代表人: 潘鑫军
 联系人: 吴宇
 电话: 021-63325888
 传真: 021-63326173
 客户服务热线: 95503
 东方证券网站: www.dfzq.com.cn
 4) 广发证券股份有限公司
 法定代表人: 林治海
 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)
 办公地址: 广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
 联系人: 黄岚
 统一客户服务热线: 95575或致电各地营业网点
 开放式基金业务传真: (020) 87555305
 公司网站: www.gf.com.cn
 5) 广州证券有限责任公司
 注册地址: 广州市先烈中路669号东山广场主楼十七楼
 办公地址: 广州市先烈中路669号东山广场主楼十七楼
 法定代表人: 刘东
 开放式基金咨询电话: 020-9613033
 开放式基金业务传真: 020-87232606
 联系人: 林洁茹
 联系电话: 020-87322668
 6) 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29楼
 法定代表人: 王建华
 客户服务热线: 4008888666
 网址: www.gtja.com
 7) 国信证券股份有限公司
 注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
 十六层
 法人代表人: 何如
 基金业务联系人: 齐晓燕
 电话: 0755-82130633
 传真: 0755-82130622
 全国热线: 95536
 公司网址: www.guosen.com.cn
 8) 海通证券股份有限公司
 注册地址: 上海市淮海中路90号
 办公地址: 上海市广东路689号
 法定代表人: 王开国
 电话: 021-23219000
 传真: 021-23219100
 联系人: 金芸、李奕鸣
 客服电话: 95553
 9) 招商证券股份有限公司
 注册地址: www.htsec.com
 9) 招商证券股份有限公司
 注册地址: 深圳市福田区北京路155号91号红塔大厦9楼
 办公地址: 云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
 法定代表人: 况雨林
 电 话: 0871-3577398
 传 真: 0871-3578827
 10) 中国民族证券有限责任公司
 注册地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
 办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
 法定代表人: 赵大伟
 联系人: 李薇
 联系电话: 400-889-5618
 11) 齐鲁证券有限公司
 注册地址: 山东省济南市市中区经七路86号
 办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号
 法定代表人: 李琦
 联系人: 吴昊
 电话: 0531-68889155
 传真: 0531-68889752
 客服电话: 95538
 网址: www.qlzq.com.cn
 12) 申银万国证券股份有限公司
 注册地址: 上海市常熟路171号
 办公地址: 上海市常熟路171号
 法定代表人: 丁国荣
 电话: 021-54033888
 传真: 021-54038844
 客服电话: 95523或4008895523
 电话委托: 021-925050
 网址: www.sygw.com
 13) 信达证券股份有限公司
 注册(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
 联系电话: 010-63081000
 传真: 010-63080978
 客服电话: 400-800-8899
 公司网址: www.cindasc.com
 14) 兴业证券股份有限公司
 注册地址: 福州市湖东路268号
 法定代表人: 兰荣
 办公地址: 浦东新区民生路1199号证大五道口广场1号楼21层
 客服电话: 95562
 业务联系电话: 021-38665785
 业务联系人: 谢高得
 传真: 021-38669565
 兴业证券网站: www.xyzq.com.cn
 15) 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号国际企业大厦C座
 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: 顾伟国
 开放式基金业务电话: 4008-888-888
 开放式基金咨询电话: 4008-888-888
 联系人: 田薇
 联系电话: 010-66564300
 网址: www.chinastock.com.cn
 16) 招商证券股份有限公司
 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: 肖志林
 电话: 0755-82943666
 传真: 0755-82943636
 联系人: 林生迎
 客户服务电话: 95565, 4008881111
 公司网址: www.newone.com.cn
 17) 中航证券有限责任公司
 注册地址: 江西省南昌市抚河北路291号
 办公地址: 江西省南昌市抚河北路291号
 法定代表人: 杜航
 电话: 0791-6768681
 联系人: 戴蕾
 客户服务电话: 400-8866-567
 网址: www.avicsec.com
 2、二级市场交易代理机构
 包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构, 并及时公告。

(二) 登记结算机构
 名称: 中国证券登记结算有限责任公司
 地址: 北京市西城区太平桥大街17号
 法定代表人: 金颖
 联系人: 严峰
 电话: (0755) 25946013
 传真: (0755) 25987122
 (三) 律师事务所和经办律师
 名称: 上海市通力律师事务所
 住所: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人: 俞卫华
 电话: (021) 31358666
 传真: (021) 31358600
 经办律师: 吕红、黎明
 联系人: 陈颖华
 (四) 会计师事务所和经办注册会计师
 名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
 首席合伙人: 吴港平
 住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦门16层
 办公地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦门16层
 邮政编码: 100738
 公司电话: (010) 581513000
 公司传真: (010) 85188298
 签字会计师: 陈露、商莉华
 业务联系人: 陈露、商莉华

四、基金名称

本基金名称: 深证300交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金主要投资于标的指数成份股, 备选成份股。在建仓完成后, 本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%, 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例不超过法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种, 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
 本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数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。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时, 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, 或因其他特殊情况导致流动性不足时, 或因其他原因导致无法复制或跟踪误差较大时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等, 主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约, 通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低基金仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

1. 决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金资产的投资依据。

2. 投资管理体制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数基金调整的投资决策, 其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策; 基金经理负责决定日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3. 投资流程
 研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资决策流程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: BTF投资管理小组依托基金管理人整体研究平台, 整合内外部信息和研究成果, 开展对标的指数的跟踪研究, 对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数的成份股流动性分析, 对基金的跟踪误差及时进行归因分析等工作, 并撰写相关研究报告, 作为基金投资决策的重要支持。

(2) 投资决策: 投资决策委员会依据BTF投资管理小组提供的研究报告, 定期或遇重大事件时召开投资决策会议, 决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上, 进行基金投资的日常管理。

(3) 组合构建: 跟踪标的指数, 结合BTF投资管理小组的研究报告, 基金经理在完全复制标的指数的方法构建组合, 在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, 降低买入成本, 控制投资风险。

(4) 交易执行: 中央交易室负责具体的交易执行, 同时履行一线监控的职责。

(5) 风险监控: 风险控制人员根据实时风险监控系统, 在交易期间对ETF的各类风险进行监控。一旦发现异常立即通知基金经理, 基金经理根据风险的具体情况, 确定适当的应急处理方案。

6. 绩效评估: 基金经理定期和不定期对基金进行投资绩效评估, 并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期, 对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析, 基金经理据此检查投资策略, 进而调整投资组合。

(7) 组合维护: 基金经理跟踪标的指数的变动, 结合成份股的流动性状况、基金申购和赎回情况以及组合投资绩效评估的分析结果, 对投资组合进行跟踪和调整, 密切跟踪标的指数。

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 对上述投资管理程序和 程序做出调整, 并在更新的招募说明书中公告。

(二) 投资组合管理

1. 构建投资组合
 制定建仓策略制定建仓策略和逐步组合调整。
 本基金采取完全复制法和逐步组合调整。
 本基金采取完全复制法制定目标组合, 根据指数成份股的流动性和需求数量建立基金的建仓策略, 在基金合同生效之日起3个月内, 按照建仓策略将不低于90%的基金资产投资于标的指数的成份股、备选成份股。此后, 如因标的指数的成份股调整、基金申购赎回带来等因素导致基金不符合这一投资比例的, 基金管理人将在规定期限内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析, 如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。

2. 日常投资组合管理
 (1) 可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析: 基金管理人将对标的指数的成份股的调整、股本变化、分红、停牌/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等影响因素进行密切跟踪, 分析其对跟踪误差的影响。
 (2) 投资组合的调整: 利用数量化分析模型, 优选组合调整方案, 并利用BTF投资管理信息系统适时调整投资组合, 以实现更好的跟踪标的指数的目的。

对比指对指数与组合的每日及累计的绩效数据, 检测跟踪误差及其趋势; 分析由于持仓与组合只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势; 找出跟踪误差的来源, 进而决定需要对组合调整的部分及调整方法, 并初步确定下一交易日的投资组合调整方案。
 (4) 制作并公布申购赎回清单: 以T-1日基金持有的证券及其比例为基础, 根据上市公司公告, 考虑T+1日可能发生的上市公司变动情况, 制作T日的申购赎回清单并公告。

3. 定期投资组合管理

基金管理人将定期(每月或每半年)进行投资组合管理, 主要完成下列事项:
 (1) 定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析, 制定改进方案, 经投资决策委员会审批后实施;
 (2) 根据标的指数的编制规则及调整公告, 制定组合调整方案, 经投资决策委员会审批后实施;
 (3) 根据基金合同中基金管理费、基金托管费等费用的支付要求, 及时检查组合中现金的比例, 进行每月支付现金的准备。

4. 投资绩效评价

(1) 每日对基金的绩效评估进行, 主要对跟踪偏离度和跟踪误差进行评估;
 (2) 每月末, 金融工程部门对本基金的运行情况进行量化评估;
 (3) 每月末, 基金经理根据量化评估报告, 重点分析本基金偏离度和跟踪误差产生原因, 现金的控制情况, 标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下, 本基金日均跟踪误差的绝对值不超过0.1%, 年跟踪误差率不超过2%。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, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(三) 投资限制

1. 投资组合限制
 (1) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不超过上一交易日基

金资产净值的0.5%, 基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的10%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的3%。法律法规或中国证监会另有规定的, 从其规定;
 (2) 本基金参与股指期货交易另有规定, 所申报的金额不得超过本基金总资产, 所申报的股票数量不得超过该发行股票公司本次发行股票的总量;

(3) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%, 在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过该投资资产的100%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过该基金持有的股票总市值的20%; 在任何交易日日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金;
 (4) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

(5) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。
 《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在10个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;
 (2) 向他人贷款或提供担保;
 (3) 从事承担无限责任的投资;
 (4) 买卖其他基金份额, 但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期前内承销的证券;

(7) 从事内幕交易, 操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
 (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为;

对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资标的指数的成份股或备选成份股, 基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下, 将结合使用其他合法投资方式进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金管理人可在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

九、基金的投资业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证300指数。深证300指数于2009年11月4日发布, 其针对沪深股市沪深300指数的样本股, 根据平均流通市值及平均成交额进行综合排名, 选取排名靠前的300只股票组成样本。