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

（2015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
二〇一五年十二月

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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。

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。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年11月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2015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：谭炯

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8350万元	83.5%
贝莱德投资管理（英国）有限公司	相当于人民币1650万元的美元	16.5%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

白志中（BAI Zhizhong）先生，董事长。上海交通大学工商管理专业硕士，高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任，中国银行宁夏回族自治区分行行长、党委书记，中国银行广西壮族自治区分行行长、党委书记，中国银行四川省分行行长、党委书记，中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。

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15年基金行业从业经验。

赵春堂（ZHAO Chuntang）先生，董事。南开大学世界经济专业硕士。历任中国银行国际金融研究所干部，中国银行董事会秘书部副处长、主管，中国银行上市办公室主管，中国银行江西省分行行长助理、副行长、党委委员，中国银行个人金融总部副总经理等职。现任中国银行财富管理与私人银行部副总经理（主持工作）。

宋福宁（SONG Funing）先生，董事。厦门大学经济学硕士，经济师。历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副处长、资金业务部负责人、资金业务部总经理，中国银行总行金融市场总部助理总经理，中国银行总行投资银行与资产管理部助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部副总经理。

葛岱炜（David Graham）先生，董事。国籍：英国。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理，主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。葛岱炜先生于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（Lazards）银行伦敦、香港和东京分公司任职。1992年，加入美林投资管理有限公司（MLIM），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。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理，主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。

荆新（JING Xin）先生，独立董事。国籍：中国。现任中国人民大学商学院副院长、会计学教授、博士生导师，博士后合作导师，兼任财政部中国会计准则委员会咨询专家、中国会计学会理事、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、中国人民大学商学院党委书记等职。

赵欣舸（ZHAO Xinge）先生，独立董事。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公协会（美国共同基金业行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教务长和金融MBA主任，并在中国的数家上市公司和金融投资公司担任独立董事。

雷晓波（Edward Radcliffe）先生，独立董事。法国INSEAD工商管理硕士。曾任白狐技术有限公司总经理，目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前，曾任美国电信集团零售部部门经理，贝特伯恩顾问公司董事、北京代表处首席代表、总经理，中英商会财务司库、英中贸易协会理事会成员。现任银森合伙人有限公司合伙人。

2、监事

赵绘坪（ZHAO Huiping）先生，监事。国籍：中国。中央党校经济管理专业本科、人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人事部技术干部处干部、副处长。

乐妮（YUE Ni）女士，职工监事。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士。曾分别就职于上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理公司。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14年证券从业年限，11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。

欧阳向军（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-SAC 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伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、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。

陈军（CHEN Jun）先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

4、基金经理

赵建忠（ZHAO Jianzhong）先生，金融学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015年6月至今任中银中证100指数基金基金经理，2015年6月至今任国企ETF基金基金经理，2015年6月至今任中银沪深300等权重指数基金（LOF）基金经理。具有8年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

曾任基金经理：

周小丹先生。

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（副执行总裁）、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（固定收益投资部副总经理）

列席成员：欧阳向军（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

1、基本情况

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：252.20亿元

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—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止，2015年9月30日，本集团总资产5,2223万亿元人民币，高级法下资本充足率12.79%，权重法下资本充足率12.14%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十三年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截止11月末新增托管公募开放式基金52只，新增首发公募开放式基金托管规模940.37亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入31.36亿元，同比增长65.49%，托管资产余额6.29万亿元，同比增长86.96%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

（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。英国东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会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路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）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

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5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，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2015年11月30日，招商银行股份有限公司累计托管142只开放式基金及其它托管资产，托管资产为62,901.90亿元人民币。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场内发售机构

具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）。

2、场外发售机构

（1）直销机构

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：谭炯

电话：（021）38834999

传真：（021）68872488

联系人：徐琳

（2）其他销售机构

1）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

联系人：宋亚平

网址：www.boc.cn

2）招商银行股份有限公司

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

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：www.ccb.com

4）交通银行股份有限公司

注册地址：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：牛锡明

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

5）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

联系人：姚健英

公司网站：www.cmbc.com.cn

6）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：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系人：王佺

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

7）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号中山大厦 邮政编码：350003

法定代表人：高建平

联系人：李琳

联系电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn/

8）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

法定代表人：许刚

联系人：马瑾

联系电话：61195566

公司网站：www.bocichina.com

9）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话?

公司网站：www.htsec.com

10）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二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

客服电话：95536

公司网站：http://www.guosen.com.cn

11）中信证券股份有限公司

注册地址：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：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

联系人：陈忠

联系电话：95558

公司网站：www.cs.ecitic.com

12）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

13）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京安立路66号4楼

法定代表人：张佑君

联系人：辛晨晨、许梦园

客服电话：4008-888-108

公司网站：http://www.csc108.com/

14）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

客服电话：95511-8

公司网站：http://stock.pingan.com

15）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

办公地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人：陈林

联系人：汪明丽

客服电话：400-820-9898

公司网站：www.cnhhstock.com

16）渤海证券股份有限公司

注册地址：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：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

客服电话：4006515988

公司网站：http://www.bhzq.com

17）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

客服电话：95531；400-8888-588

公司网站：www.longone.com.cn

18）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服电话：95523

公司网站：www.swhysc.com

19）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4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

客服电话：010-66045678

公司网站：http://www.txsec.com 或www.jjm.com.cn

20）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

联系人：方士清

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

21）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

22）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街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南大街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：400 818 8118

公司网站：www.guodu.com

23）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

24）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：邓颜

客服电话：4008-888-888

公司网站：www.chinastock.com.cn

25）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：万建华

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

公司网站：www.gtja.com

26）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

客服电话：（0532）96577

公司网站：http://www.zxwt.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）59378835

传真：（010）59378907

联系人：任瑞新

（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：上海市银城中路68号时代金融中心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

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

执行事务合伙人：吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：汤骏

经办会计师：陈露、汤骏

五、基金名称

中银沪深300等权重指数证券投资基金（LOF）

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金为指数型基金，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成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会允许本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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于沪深300等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%，其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%。

九、标的指数

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指数拥有相同的成份股，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股综合表现的跨市场成份指数。不同的是，沪深300等权重指数采用了等权重加权，设置等权重因子以使所有样本股权重相等。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。

如果出现沪深300等权重指数被停止编制及发布，被其他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情形，或法律法规或监管机构对证券投资基金股票投资比例限定的规定进行调整，则基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更基金的标的指数、投资对象和业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更的标的指数、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。本基金力求基金净值收益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成份股。除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%，其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%。

（二）股票投资策略

本基金采取完全复制法构建股票指数组合，即按照沪深300等权重指数成份股及权重构建指数投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金在建仓期内，按照沪深300等权重指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当的方法降低买入成本。当遇到以下情况时，本基金管理人可以根据市场的具体情况，对指数投资部分进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制：

1、预期标的指数成份股将调整；

2、标的指数成份股发生配股、增发、分红等行为；

3、指数成份股出现停牌限制、流动性问题等情况；

4、其他影响指数复制的因素。

本基金采取“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，跟踪偏离度为辅助监控指标。基金管理人将建立事后跟踪误差监控体系，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偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准增长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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，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配置。

（四）指数化投资组合

[illegible]

（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，跟踪偏离度为辅助监控指标。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偏离风险。

[illegible]

本基金将日跟踪误差的最大容忍值设定为0.25%（相应折算的年跟踪误差约为4%），以每周为检测周期，即本基金将每周计算该指标，计算区间为每周最后一个交易日起前30个交易日（含当日）。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适当的调整，以使跟踪误差回归到最大容忍值以内。当跟踪误差在最大容忍值以内时，由基金经理对是否继续跟踪基的选择作出判断。

当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪误差。

（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投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，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规则，引起标的指数在其上市第十个交易日结束后发生调整的，本基金将做相应调整；；

b.当成份股暂停或终止上市的，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权重比例，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.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；

f.其他需要调整的事项。

（2）限制性调整

● 投资比例限制调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按基准权重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，并相应地对其他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现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行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等权重指数被停止编制及发布，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等重大变更导致沪深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基准时，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，但应经托管人同意及报中国证监会核准，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）不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第三人牟取任何不当利益。

十四、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——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年12月22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。

本投资组合报告所载数据截至2015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	33,081,576.63	90.24
	其中：股票	33,081,576.63	90.24
2	固定收益投资	12,763.00	0.03
	其中：债券	12,763.00	0.03
	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	3,524,215.87	9.61
7	其他各项资产	42,490.40	0.12
8	合计	36,661,045.90	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极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	114,521.40	0.31
C	制造业	-	-
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	112,000.00	0.31
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	226,521.40	0.62

注：本基金本报告期末持有的积极投资股票为被动根据标的指数变动而调出，非为主动持有。

2.2 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	253,740.04	0.70
B	采矿业	2,378,313.63	6.53
C	制造业	14,017,980.73	38.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,825,015.37	5.01
E	建筑业	1,365,569.36	3.75
F	批发和零售业	1,353,274.33	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,674,529.38	4.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,053,486.37	5.64
J	金融业	4,032,807.89	11.08
K	房地产业	1,486,670.40	4.08
L	租赁和商务服务业	570,645.90	1.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	405,202.90	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	128,498.36	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,082,437.58	2.97
S	综合	226,882.99	0.62
	合计	32,855,055.23	90.26

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 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	002292	奥飞动漫	9,800	286,748.00	0.79
2	000024	招商地产	8,650	246,438.50	0.68
3	000963	华东医药	3,056	213,461.60	0.59
4	000778	新兴铸管	30,066	193,625.04	0.53
5	600867	通化东宝	8,110	181,745.10	0.50
6	600153	建发股份	10,183	176,267.73	0.48
7	002415	海康威视	5,382	175,345.56	0.48
8	300070	碧水源	4,000	174,760.00	0.48
9	600886	国投电力	19,640	173,617.60	0.48
10	601866	中海集运	19,432	169,641.36	0.47

3.2 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

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	600395	盘江股份	18,178.00	114,521.40	0.31
2	002416	爱施德	12,500.00	112,000.00	0.31

注：本基金本报告期末持有的积极投资股票为被动根据标的指数变动而调出，非为主动持有。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	12,763.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10