

天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
日期:二〇一六年八月

重要提示
天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年6月17日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2015】1282号)。
本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会备案,自中国证监会接受本基金募集注册之日起,招募说明书即行生效,且不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于2015年6月30日正式生效。
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。投资者在认购(或申购)基金时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和产品特性,充分认识到自身的投资风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人因投资经营活动产生的操作风险以及本基金特有的风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,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。

本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
本基金并非保本基金,基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。
投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的机构购买本基金。
基金的风险收益特征并不预示其未来表现,基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,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。

本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
本基金并非保本基金,基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。
投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的机构购买本基金。
基金的风险收益特征并不预示其未来表现,基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,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。
基金招募说明书自基金合同生效之日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告。本招募说明书所载内容截止日为2016年6月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:天弘基金管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
成立日期:2004年11月8日
法定代表人:尹波
联系电话:(022)183310208
组织形式:有限责任公司
注册资本及股权结构:
天弘基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)经中国证券监督管理委员会批准(证监基金字[2004]164号),于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币1.43亿元,股权结构为:

股东名称	持股比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51.1%
天津信托有限责任公司	16.03%
内蒙古弘正能源化工集团股份有限公司	15.03%
安徽高投投资有限公司	5.0%
新疆天恒丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.0%
新疆天恒源股权投资合伙企业(有限合伙)	3.0%
新疆天恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	3.0%
新疆天恒顺股权投资合伙企业(有限合伙)	3.0%

(二)主要人员情况
1.董事会成员基本情况
尹波先生,董事长,硕士。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴(中国)信息技术有限公司财务总监、支付宝(中国)网络技术有限公司首席财务官、浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司首席运营官,现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司总裁。
卢倩群先生,副董事长,硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书,北京博晖创新光电技术股份有限公司监事,现任北京博晖创新光电技术股份有限公司董事长、总经理,君正国际投资有限公司(中国)有限公司董事。
黄涛先生,董事,大学本科。历任中国建设银行总行计划财务部副处长,北京广厦集团副总经理、中德住房储蓄银行行长,中国建设银行总行网络金融部总经理,现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司副总裁。
屠剑成先生,董事,硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长,香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理,花旗银行(中国)有限公司合规助理,永亨银行(中国)有限公司法律合规部主管,现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司法务及合规部资深总监。
付岩先生,董事,大学本科。历任北京(天津)物产集团有限公司期货资产管理部,中国经济开发信托投资公司天津证券部投资助理,顺融(中国)地产有限公司资产管理高级经理,天津信托有限责任公司投资银行项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部副经理。

郭树强先生,董事,总经理,硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理,研究员,机构投资总监,投资决策委员会委员,机构投资决策委员会主任,公司董事会委员,公司总经理助理。现任本公司总经理,天弘创新资产管理有限责任公司董事长、总经理,魏新刚先生,独立董事,大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长,天津市政府法制办经济法规处处长,天津达天律师事务所所务所主任。现任天津英联律师事务所主任。

张军先生,独立董事,博士。现任复旦大学经济学院教授,中国经济研究中心主任。
贺强先生,独立董事,本科。现任中央财经大学金融教授。
2.监事会成员基本情况
陈炳生,监事会主席,硕士研究生。历任天津市民政局社区团委书记,天津市人民政府法制办公室、天津市外经委办公室干部,天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长,天津公司副董事长。
张杰先生,董事,注册会计师,注册会计师。现任内蒙古君正能源化工集团 股份有限公司董事、董事会秘书,财务总监,魏林浩特市君正能源化工有限公司董事,魏林浩特市君正能源化工(中国)有限公司执行董事,内蒙古君正化工有限公司监事,乌鲁木齐市君正矿业有限责任公司监事,内蒙古中鑫能源有限公司内蒙古坤德物流股份有限公司监事。
冯勇先生,监事,硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经理,福建立信御都会计师事务所副主任会计师,立信会计师事务所厦门分所副主任会计师。现任芜湖高新投资有限公司副经理。
韩海潮先生,监事,硕士研究生。历任三晋实业天津白垩路营业部、渤海道营业部技术部经理,亚洲证券天津渤海道营业部运营总监。现任本公司运营总监、信息技术总监,泰达农投先生,监事,硕士研究生。历任新华社上海证券财经要闻部记者,本公司市场部电子商务专员,电子商务部业务拓展主管、总经理助理。现任本公司互联网业务部副经理。

付颖女士,监事,硕士研究生。历任本公司监察稽核部信息数据专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司监察稽核部副经理。
3.高级管理人员基本情况
郭树强先生,董事,总经理,简历参见董事会成员基本情况。
陈炳生,副总经理,硕士研究生。历任华龙证券有限责任公司固定收益部高级经理,北京宸星投资管理公司投资经理,兴业证券公司债券总部研究部经理,恒华基金管理有限公司机构管理部高级经理,中国人寿资产管理有限责任公司固定收益部高级投资经理。2011年7月加盟本公司,现任公司副总经理,资深基金经理,固定收益权益兼固定收益部总经理,分管公司固定收益投资业务。
周晓刚先生,副总经理,硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理,万通企业集团副总经理,中信信托中心投资部副经理,国信证券北京投行部一部经理,天津证券投行部副经理,嘉实基金机构管理部副总监、渠道部总监,香港汇丰集团高级副总监,工银瑞信基金市场部副总监,嘉实基金产品和营销总监,盛世基金高级投资经理。2011年8月加盟本公司,同年被任命为公司首席市场官,现任公司副总经理,分管公司电子商务业务。
张磊先生,副总经理,硕士研究生。历任清华兴业投资管理公司证券分析师,嘉实基金直销助理,泰信基金北京理财中心经理,华夏基金机构理财部总经理,九鼎投资管理咨询有限公司副总经理和合伙人,北京东思亿能资产管理公司执行董事等。2012年10月加盟本公司,2012年11月任命为公司总经理助理,现任公司副总经理,分管公司证券发行业务。
董建林先生,督察长,大学本科,高级会计师。历任当阳市证券公司证券交易中心财务部经理、副总会计师,亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务总监兼财务主管,华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管,本公司基金会计、监察稽核部副经理,监察稽核部副经理。现任本公司督察长。

截至本招募说明书及摘要披露日,张磊先生已离任本公司副总经理职务,敬请投资者关注本公司于2016年7月2日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。
4.本基金基金经理
刘冬生,经济学硕士,10年证券从业经验。历任长江证券股份有限公司研究所任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司,历任投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、宏观策略分析师,天弘永利债券证券投资基金基金经理助理,天弘现金管家货币市场基金基金经理(2012年6月至2013年8月期间)、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理(2012年8月至2013年8月期间)、天弘永利债券证券投资基金(LOP)基金经理(2011年11月至2013年9月)。现任天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证证券100指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证银行指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证电子指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理,天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理。
5.基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务
陈炳生先生,本公司副总经理,投资决策委员会联席主席、固定收益总监兼固定收益部副经理,基金经理。
陈勤先生,本公司总经理助理,投资决策委员会联席主席、股票投资总监兼机构投资总监。
姜文海先生,本公司投资管理事业部二部总监,基金经理。
姜文成先生,基金经理。
刘冬先生,基金经理。
肖志刚先生,基金经理。
陈炳生先生,基金经理。
王彦斌先生,基金经理。
姜晓丽女士,基金经理。
王林先生,基金经理。
黄颖女士,研究总监。
上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况
1.基本情况
名称:招商证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:广东省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
成立日期:1993年8月1日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币58.08亿元
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:证监许可[2014]78号
联系人:秦海
联系电话:0755-26951111
招商证券是百年招商局旗下金融企业,经过二十多年创业发展,已成为拥有证券市场业务牌照的“一流券商”,并经中国证监会资产管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力,科学合理的风险管理架构,专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有200家标准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券股份有限公司、招商期货有限公司、招商致远资产管理公司、招商证券投资基金管理有限公司、招商证券资产管理分公司,参股博时基金管理公司,招商基金管理人,构成国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越

的金融服务实现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2.主要人员情况
招商证券托管部员工多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验,会计师事务所审计经验,以及大型IT公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域,其中本科以上人员占比100%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。
3.基金托管业务经营范围
招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外,招商证券于2012年10月获得了证监会准予开展私募基金综合托管服务试点的正式批文,成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至2016年二季度,招商证券托管托管15只公募基金。

招商证券托管部于2015年4月通过了普华永道会计师事务所提供的ISA E3402鉴证服务,成为业内第一家通过ISA E3402认证的券商托管人和基金外包服务机构。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构
1.直销机构
(1)天弘基金管理有限公司直销中心
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
法定代表人:尹波
联系电话:(022)83865660
传真:(022)83865663
联系人:司璇
客服电话:400-717-9999(免长途话费)
(2)天弘基金管理有限公司网上直销平台
办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层
电话:(010)83571789
传真:(010)83571730
联系人:许从良
网址:www.tfund.com.cn
(3)天弘基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层
电话:(010)83571789
传真:(010)83571900
联系人:申尚阳
(4)天弘基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号30层E-F单元
电话:(021)50128808
传真:(021)50128801
联系人:徐远安
(5)天弘基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市天河区华夏路26号12楼V16房
电话:(020)38927920
传真:(020)38927986
联系人:袁宇婧
2.其他销售机构:
(1)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道海曙路8号2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:0571-26888888
传真:0571-26889533
联系人:张振彬
联系人邮箱:xyuf@fund123.cn
客户服务专线:400-0766-123
网址:www.fund123.cn
(2)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227960
传真:0755-82080798
联系人:童彩屏
联系人邮箱:tongc@jmmw.com
客户服务专线:400-0766-887
网址:www.zlfund.cn, www.jmmw.com
(3)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人:其实
电话:021-54509888
传真:010-61989048-8000
联系人:丁姗姗
联系人邮箱:shanghai@eastmoney.com
客户服务专线:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn
(4)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:021-20835785
客服电话:400-920-0022
网址:www.hexun.com
(5)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:刘宇
电话:0571-88911818-8554
客服电话:4008-773-773
网址:www.5ifund.com
(6)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法人代表:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89620021
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(7)深圳济财资产管理股份有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新科技园七道12号惠恒集团二期418室
法人代表:李永刚
联系人:陈勇军
联系电话:0755-83999907-806
客服电话:0755-83999907
网址:www.jincaifu.com
(8)中汇基金(北京)投资管理有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层
法定代表人:彭延华
联系人:孙雯
电话:010-51039315
客服电话:010-50636512
网址:www.jlcf.com
(9)上海买卖基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区南汇东路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:陆敏
电话:021-20211847
客服电话:400-700-9665
网址:www.buyfundsuy.com
(10)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:汪静波
联系人:张倩
电话:021-38696860
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(11)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:陈坚
电话:021-20696592
客服电话:400-821-9031
网址:http://www.lufunds.com
(12)上海长投基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2号楼220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路526号裕康国际B座16层
法定代表人:李海斌
联系人:曹颖
电话:021-20691923
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(13)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006F
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:杨鹏
联系人:张琳
电话:400-166-1188
客服电话:400-166-1188
网址:http://8.jrj.com.cn
(14)上海中正达广投资管理有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉瑕
电话:13774232992
客服电话:400-6767-523
网址:www.zzhfund.com
(15)北京恒泰基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元21层22207
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元21层22207
法定代表人:邵健
电话:021-20691923
联系人:戚晓嵩
电话:4000-618-518
客服电话:4000-618-518
网址:www.htcfund.com
(16)泰信财富投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京亚东大街30号院3号楼8层8095房间
办公地址:北京市朝阳区望京亚东大街30号院3号楼8层8095房间
法定代表人:李静
联系人:周杨
电话:15510736555
客服电话:400-168-7575
网址:www.taixincf.com
(17)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦10楼

办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈晓明
联系人:徐鹏
电话:18601735759
客服:400-067-6266
网址:www.leaibank.com.cn
(18)北京广源达信投资管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
法定代表人:尹波
电话:13911468997
客服:400-623-6060
网址:www.niuniuni.com
3.基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构,并及时公告。
(二)登记机构
名称:天弘基金管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号
办公地址:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
法定代表人:尹波
电话:(022)83865660
传真:(022)83865663
联系人:薄海龙
(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:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路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:黎明、陆晔
联系人:孙睿
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)22268888
传真:(021)22238800
经办注册会计师:薛岩、周晔
联系人:周晔

四、基金的名称
五、基金的类型
本基金名称:天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金。
本基金类型:股票型。

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的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证全指运输指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股),含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规和中国证监会允许本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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证全指运输指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的90%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可调整上述投资组合的投资比例。

八、基金的投资策略
本基金采用完全复制制的方法,进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制投资组合日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相仿的投资收益。

由于标的指数的编制方法原因,成份股及其权重发生变化(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)的原因,或因基金的申购赎回等因素对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变更和调整,力求降低跟踪误差。

九、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全指运输指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

中证全指运输指数由中证全指成份股中归属于运输二行业的全部股票组成,反映了沪深A股市场中运输业股票的整体表现,并为该行业产品提供创新的标的。中证全指运输指数由其他指数单位,或由由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证全指运输指数不能客观反映该行业的表现,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据审慎原则,在不损害基金份额持有人利益的前提下,变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称,其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则本基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资组合投资范围无实质性影响(包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征
本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

本基金的董事会及董事保证提供真实资料,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。
基金托管人招商证券股份有限公司(以下简称“基金托管人”)于2016年7月20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。

本报告期为报告所载数据截至2016年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
基金单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	29,532,177.09	50.46
2	其中:国债	29,532,177.09	50.46

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	应收股利	0.00	0.00
2	应收利息	0.00	0.00
3	其他应收款	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
5	其他流动资产	0.00	0.00
6	其他资产	0.00	0.00
7	负债	0.00	0.00
8	合计	29,532,177.09	50.22

2.报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
1.报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合
基金单位:人民币元

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及生产供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	29,532,177.09	93.22
H	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
I	金融业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	租赁和商务服务业	0.00	0.00
L	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
M	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
N	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
O	教育	0.00	0.00
P	卫生和社会工作	0.00	0.00
Q	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
R	综合	0.00	0.00
合计	合计	29,532,177.09	93.22

2.报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
1.报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合
基金单位:人民币元

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	0.00	0.00
2	采矿业	0.00	0.00
3	制造业	0.00	0.00
4	电力、热力、燃气及生产供应业	0.00	0.00
5	建筑业	0.00	0.00
6	批发和零售业	0.00	0.00
7	交通运输、仓储和邮政业	29,532,177.09	93.22
8	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
9	金融业	0.00	0.00
10	房地产业	0.00	0.00
11	租赁和商务服务业	0.00	0.00
12	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
13	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
14	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
15	教育	0.00	0.00
16	卫生和社会工作	0.00	0.00
17	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
18	综合	0.00	0.00
合计	合计	29,532,177.09	93.22

2.报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
1.报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合
基金单位:人民币元

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	0.00	0.00
2	采矿业	0.00	0.00
3	制造业	0.00	0.00
4	电力、热力、燃气及生产供应业	0.00	0.00
5	建筑业	0.00	0.00
6	批发和零售业	0.00	0.00
7	交通运输、仓储和邮政业	29,532,177.09	93.22
8	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
9	金融业	0.00	0.00
10	房地产业	0.00	0.00
11	租赁和商务服务业	0.00	0.00
12	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
13	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
14	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
15	教育	0.00	0.00
16	卫生和社会工作	0.00	0.00
17	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
18	综合	0.00	0.00
合计	合计	29,532,177.09	93.22

2.报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
1.报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合
基金单位:人民币元

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	0.00	0.00