

天弘创业板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:国泰君安证券股份有限公司
日期:二〇一六年八月

重要提示
天弘创业板指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年6月18日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2015】1301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,但中国证监会接受本基金募集注册的准备,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于2015年7月8日正式生效。

本基金投资于二级市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资有风险,投资者认购(或申购)基金前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,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金份额的同时,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、基金管理人及投资经营过程中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前,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,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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,了解基金的风险收益特征,根据自身投资目标、投资经验、资产状况等判断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其他机构购买基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金净值表现的“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。

本摘要按照基金合同和基金招募说明书编写,并报备中国证监会天津监管局。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,应仔细阅读基金合同。

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,并于每个6个月结束之日起后的45日内公告。本招募说明书所载内容截止日为2016年7月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年3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56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:尹凤栋
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”)经中国证监会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5.143亿元,股权结构为:

名称	持股比例
浙江网商银行股份有限公司	51%
天弘世纪资产管理有限公司	16.6%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖海螺投资有限公司	5.6%
新疆天瑞峰丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天瑞新能源股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天瑞新能源股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天瑞新能源股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天瑞新能源股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

(二)主要人员情况
1.董事会成员基本情况
尹凤栋先生,董事长,硕士研究生。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)信息技术有限公司首席副总裁,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副总裁。
卢信群先生,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副董事长、总经理,君正国际投资(北京)有限公司董事。

黄浩先生,董事,大学本科。历任中国建设银行总行计划财务部处长,处长、部门副总经理、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。

屠剑威先生,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)有限公司合规部助理总监、华翔银行(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。历任北洋(天津)物产集团有限公司期货部交易员,中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部经理,顺驰(中国)地产有限公司资产管理部高级经理,天津信托有限责任公司投资银行部项目经理,现任天津信托有限公司自营业务部总经理。

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,研究总监,机构投资者,投资决策委员会成员,机构投资部负责人,资产管理委员会,公司运营部总经理。现任本公司总经理,天弘创新资产管理有限公司董事长、总经理。

魏新顺先生,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,天津市政府法制办法律处处长,天津达天律师事务所律师,现任天津英联律师事务所主任律师。

张军先生,独立董事,博士。现任复旦大学经济学院院长,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学院教授。

2.监事会成员基本情况
李琦先生,监事会主席,硕士研究生。历任天津市民政局人事处团委副书记,天津市人民政府法制办公室,天津外经贸委办公室干部,天津信托有限公司人事处处长、总经理助理兼财务处处长、副总经理,本公司董事长。

张杰先生,监事,注册会计师、注册审计师。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、副总经理,锦林浩特君君正能源化工(有限)有限公司董事长、锦林浩特君正能源化工(有限)有限公司执行董事、总经理,内蒙古 君正化工(有限)有限公司监事,内蒙古君正矿业(有限)有限公司监事,内蒙古中鑫能(有限)有限公司董事,内蒙古坤德物流股份有限公司监事。

方隽先生,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、福建立信信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总经理。

韩海潮先生,监事,硕士研究生。历任三峡证券天津北路营业部、勤诚通信息技术部经理,亚洲证券天津劝业场证券营业部运营总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。

杜社霞女士,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,现任本公司互联网金融业务部副总经理。

付毓女士,监事,硕士研究生。历任天弘基金监察稽核部信息披露专员、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总经理。

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。
陈钢先生,副总经理,硕士研究生。历任华龙证券分公司固定收益部高级经理,北京宸展投资管理公司机构部经理,兴业证券公司债券总部研究部经理,银华基金管理有限公司机构理财部高级经理,中国人寿资产管理股份有限公司固定收益部高级经理。2011年7月加盟本公司,现任公司副总经理,资深基金经理、固定收益总监兼固定收益部总经理,分管公司固定收益部业务。

周晓芳先生,副总经理,硕士研究生。历任中国证券投资基金业协会设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理,万通企业基金总裁助理,中工信托有限公司投资部副总监,国信证券北京投资银行一部经理,北京证券研究所副总监,嘉实基金市场部副总监,奥道部总监,香港汇丰集团高级副总裁,工银瑞信基金市场部副总监,嘉实基金产品和营销总监,盛世基金现任总经理。2011年8月加盟本公司,同月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。

董建林先生,督察长,大学本科,高级会计师。历任当阳市广证证券交易中心财务部部经理、副总经理,亚洲证券有限责任公司宜昌总办主任主管,宜昌营业部财务部经理,公司财务会计总部财务主管,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、监察稽核部副总经理,监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

4.本基金基金经理
刘冬先生,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部任宏观策略研究员,2006年11月加盟本公司,历任证券部固定收益研究员,宏观策略研究员,宏观策略分析师,天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理,天弘现金宝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)、天弘中证医药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、天弘中证移动互联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型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证环保指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证100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姓名和职务
陈钢先生,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总经理,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。

英文海先生,本公司投资管理事业部总监,基金经理。
钱文成先生,基金经理。
刘冬先生,基金经理。

刘志刚先生,基金经理。
陈尚阳先生,基金经理。
王登峰先生,基金经理。
姜晓丽女士,基金经理。

王林先生,基金经理。
黄敏女士,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:国泰君安证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号32层
法定代表人:杨红武
成立时间:1999年8月18日
组织形式:股份有限公司
批准设立机关及批准设立文号:证监机构字[1999]77号
注册资本:柒拾陆亿贰仟伍佰万元人民币
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:证监许可[2014]511号
联系人:王健
联系电话:021-38676666

国泰君安证券股份有限公司,1999年8月18日经两国公司合并新设为国泰君安证券股份有限公司,2015年6月26日国泰君安证券在上交所上市交易,证券简称为“国泰君安”,证券代码为“601211”。截至2015年7月14日,“国泰君安”证券注册资本为76.25亿元人民币,直接持有6家境内外子公司,并在全国设有31家分公司,299家证券营业部和17家期货营业部,是国内最早开展各类创新业务的券商之一。2008-2015年,公司连续八年在中国证监会证券公司分类评价中被评为A类A+级,为目前证券公司获得最高评级。

2.主要人员情况
杨红武,工商管理硕士,经济师,现任国泰君安董事长、党委书记。1989年7月起任上海国际信托投资公司投资银行二部经理,投资银行部总经理,2004年7月起兼任上海上投国际投资咨询有限公司总经理,2002年9月起历任国际集团运营公司副总经理、国际集团办公室、董事会办公室主任,2004年2月起兼任上海国际信托投资公司副总经理;2005年7月起任国际集团总裁助理、国际集团运营公司副总经理;2006年3月起任国际集团总裁助理;2008年4月起任国际集团副总裁,党委委员;2009年8月起兼任上海爱建股份有限公司总经理、党委副书记;2014年2月起任国际集团副总裁、党委副书记;2014年9月起任国泰君安党委副书记;2014年11月起任国泰君安党委副书记、副总裁;2015年1月起任国泰君安党委书记、总裁;2015年5月起任国泰君安董事长、党委书记、总裁;2015年8月起任国泰君安董事长、党委书记。

蒋以明先生,经济学博士,会计师,现任国泰君安副总裁、财务总监。1990年7月参加工作,任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理;1993年5月起历任君安财务顾问公司财务部副经理、经理,君安财务有限责任公司纪经业务部副经理、资金计划部副经理、总经理,财务总监;1999年8月起任国泰君安深圳分公司副总经理;2000年10月起任国泰君安总会计师;2004年3月起任国泰君安财务总监;2013年11月起任国泰君安副总裁、财务总监。

陈延义先生,中国国籍,无境外居留权,1970年10月出生,经济学学士,中级经济师,现任国泰君安证券资产管理部总经理。1993年参加工作,曾任职于君安证券清算部总经理,国泰君安证券资产管理部副总经理,光大证券运营管理部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“金融证券能手”称号获得者,中国证券业协会托管清算专业委员会副主任委员,带领团队设计的“直通式证券清算质量国际标准化平台”,被评为上海市2011年度金融创新奖二等奖。2014年2月起任国泰君安证券资产管理部总经理。

国泰君安证券总部投资托管部,现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历,管理人员及业务骨干具有多年基金、证券和银行从业经历,从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内部审计师等中高级专业技术职称及专业资格,专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各个领域。是一支实践经验丰富、专业分布合理、职业技能优良的资产托管从业人员队伍。

3.基金托管业务经营情况
国泰君安获得证券投资基金托管资格以来,广泛开展了公募基金、基金专户、券商资管计划、私募基金等基金托管业务,与华夏、天弘、富国、银华、鹏华、华安、长信、中融等多家基金公司及其子公司建立了托管合作关系,截止2016年6月30日托管公募基金9只,专业的服务和可靠的运营获得了管理人的一致认可。

三、基金服务机构

(一)基金销售机构
1.直销机构: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56号天津国际经济贸易中心A座16层

法定代表人:尹凤栋
电话:(022)83865560
传真:(022)83865563
联系人:司筱
客服热线:400-710-9999(免长途话费)
网址:www.thfund.com.cn

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9号
办公地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道3588号未来大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:0571-26698888
传真:0571-26698833
联系人:韩爱彬
联系人邮箱: xuyi@fund123.com
客户服务电话:400-076-123
网址:www.fund123.com

(2)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:010-6590408-8000
联系人:丁珊珊
联系人邮箱:shanshan@eastmoney.com
客户服务电话:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn

(3)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楼2楼
法定代表人:凌喆
电话:0571-88911818-8564
客服热线:4008-773-772
网址:www.5ifund.com

(4)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:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜辉
客服电话:020-89629021
客户服务热线:020-89629066
网址:www.yingmi.com

(5)国泰君安证券股份有限公司
住所: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
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮祺祺
客户服务电话:400-888-8666
网址:www.gtja.com

(6)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5047号发展银行大厦25楼J、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227960
传真:0755-82080798
联系人:童彩平
联系人邮箱: tongcp@jmmw.com
客户服务电话:400-6788-887
网址:www.zlfund.com及www.jmmw.com

(7)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
联系人:刘洋
电话:021-20835785
客服电话:400-921-0022
网址:www.licaike.com

(8)中证基金(北京)投资基金销售有限公司
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讯中心A座5层
法定代表人:彭运华
联系人:孙雯
电话:010-59336519
客服电话:010-59336512
网站:www.jnlc.com

(9)深圳众信财富管理
注册地址:深圳市福田区深港合作区前海湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区高新区高新南二道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:陈勇军
电话:0755-83999077-806
客服电话:0755-83999077
网址:www.jingjiao.com.cn

(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号972744
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系电话:021-38509680
邮政编码:200120
联系人:张裕
传真:021-38509777
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(11)上海好买基金销售有限公司
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:上海市浦东新区世纪大道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:400-700-9656
网址:www.ehowbuy.com

(12)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:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20666562
客服电话:400-821-9031
网址:www.lufunds.com

(13)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路555号裕星国际B座16层
法定代表人:张驭伟
联系人:苗明
电话:021-20691233
客服电话:400-202-2899
网址:www.erichfund.com

(14)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:深圳市福田区华武门大街天浩大厦2层16层
法定代表人:杨懿
联系人:张燕
电话:400-166-1188
客服电话:400-166-1188
网址:www.8j.com.cn

(15)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:戴妮妮
电话:13772422657
客服电话:400-675-523
网址:www.zzwalth.cn

(16)北京蛋卷财富销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京楼2单元21层220507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔C 19层
法定代表人:钟斐斐
联系人:戚晓辉
电话:4000-618-518
客服电话:4000-618-518
网址:www.ncfj.com

(17)泰信财富投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层80995房间
办公地址:北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层80995房间
法定代表人:李静
电话:15651076555
客服电话:400-688-7575
网址:www.taixincf.com

(18)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A
办公地址:上海浦东东新区峨山路91弄61号10楼12楼
法定代表人:沈伟伟
联系人:徐鹏
电话:18601735759
客服电话:400-067-6266
网址:www.leadbank.com.cn

(19)北京广达信投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市西城区阜成门内大街13号楼博闻中心B座19层
法定代表人:孙剑卿
联系人:王英俊
电话:13911468977
客服电话:400-623-6060
网址:www.niumifund.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基金的销售机构,并及时公告。

(二)注册登记机构
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56号天津国际经济贸易中心A座16层

法定代表人:尹凤栋
电话:(022)83865560
传真:(022)83865563
联系人:薄贺龙
电话:18601735759
客服电话:400-067-6266
网址:www.leadbank.com.cn

(三)出具法律意见书的律师事务所
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
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:孙睿
电话:87-714,44388
8746

(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号展恒银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨区202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛岚、周伟
联系人:周伟

四、基金的名称
本基金名称:天弘中证创业板指数型发起式证券投资基金。

五、基金的类型
本基金类型:股票型。

六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数的追求,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,以创业板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、货币回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本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%,投资于创业板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80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和期权合约保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期

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,基金管理人在履行适当程序后,可以调整。八、基金的投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法,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指数的跟踪,并根据标的指数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。本基金在严格控制跟踪误差日均跟踪偏离度和年限跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整、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,或因基金申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来跟踪误差,或因某些特殊事件导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,本基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整,力求降低跟踪误差。

1. 大类资产配置
本基金管理人主要按照创业板指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据跟踪误差及成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于创业板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80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和期权合约保证金后,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。

(1) 股票投资策略
本基金采用完全复制标的指数的方法,按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪标的指数的成份股构成存在差异,若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素),本基金将采用替代性的方法构建组合,使得跟踪组合尽可能近似于完全复制组合,以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代方法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于创业板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80%的投资比例限制。

(2) 股票投资组合的调整
本基金所构建的股票投资组合将根据创业板指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1) 定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

2) 不定期调整
A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 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;

C. 根据法律法规及基金合同的规定,对成份股在标的指数中的权重因其特殊原因发生相应变化的,本基金将对投资组合管理进行适当调整和跟踪,力求降低跟踪误差。

3) 在正常市场情况下,力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%。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。

3. 债券投资策略
本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的配置,通过主要采取组合久期配置策略,同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4. 资产支持证券投资策略
本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率的影响,同时密切关注利率变化对标的证券收益率的影响,严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

5. 其他金融工具投资策略
本基金将根据审慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资,减少交易成本,降低跟踪误差的目的,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

九、业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

创业板指数从创业板股票中选取100只组成样本股,反映创业板市场整体运行情况。创业板指数与深证成份指数、中小板指数共同构成反映深交所上市股票市值变动的综合指数。

如果指数编制单位变更或停止创业板指数的编制、发布或变更,或创业板指数或其他指数替代,或由指数编制方法发生重大变更等事项导致本基金管理人认为创业板指数不能继续作为标的指数,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维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称,其中,若变更标的指数及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则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变更公告中公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应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,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证所披露数据不存在虚假记载、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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月26日复核了本报告中的财务资料、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2016年3月31日,本报告中所列财务报表数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	92,173,006.70	83.64
2	其中:股票	92,173,006.70	83.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其他投资	13,004,996.06	11.79
10	其他资产	51,426,666.61	4.67
合计			