

银华中证国防安全指数分级证券投资基金
更新招募说明书摘要
(2016 年第 1 号)

基金管理人：银华基金管理有限公司
基金托管人：海通证券股份有限公司

一、重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于2015年7月8日证监许可【2015】1560号文准予募集注册。

本基金的基金合同生效日为2015年8月6日。

基金管理人保证本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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金分为股票型证券投资基金、混合型证券投资基金、债券型证券投资基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的收益风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的收益风险也越大。本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型证券投资基金、债券型证券投资基金及货币市场基金。从本基金所自动分拆/分拆的两类基金份额来看，国安A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；国安B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

本基金按照基金份额初始面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

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，投资人在投资本基金前，需充分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，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险

（如指数化投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额配对转换业务及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等）风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日银华国安份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额（包括国安 A 份额、国安 B 份额和银华国安份额）的 10%时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部银华国安份额。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为2016年2月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日，所披露的投资组合为2015年第4季度的数据（财务数据未经审计）。

二、基金管理人概况和主要人员情况

（一）基金管理人概况

名称	银华基金管理有限公司		
住所	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层		
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层		
法定代表人	王珠林	设立日期	2001 年 5 月 28 日
批准设立机关	中国证监会	批准设立文号	中国证监会证监基金字[2001]7 号
组织形式	有限责任公司	注册资本	2 亿元人民币
存续期间	持续经营	联系人	冯晶
电话	010-58163000	传真	010-58163090

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7 号文）设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为

2 亿元人民币，公司的股权结构为西南证券股份有限公司（出资比例 49%）、第一创业证券股份有限公司（出资比例 29%）、东北证券股份有限公司（出资比例 21%）及山西海鑫实业股份有限公司（出资比例 1%）。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“风险控制委员会”和“薪酬与提名委员会”2 个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由 4 位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理一部、投资管理二部、投资管理三部、量化投资部、研究部、市场营销部、机构业务部、国际合作与产品开发部、境外投资部、交易管理部、养老金业务部、风险管理部、运作保障部、信息技术部、互联网金融部、投资银行部、公司办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部、战略发展部等 22 个职能部门，并设有北京分公司、青岛分公司和上海分公司。此外，公司设立投资决策委员会作为公司投资业务的最高决策机构，同时下设“主动型 A 股投资决策、固定收益投资决策、量化和境外投资决策”三个专门委员会。公司投资决策委员会负责确定公司投资业务理念、投资政策及投资决策流程和风险管理。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

王珠林先生：董事长，经济学博士。曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师；甘肃省证券公司发行部经理；中国蓝星化学工业总公司处长，蓝星清洗股份有限公司董事、副总经理、董事会秘书，蓝星化工新材料股份公司筹备组组长；西南证券有限责任公司副总裁；中国银河证券股份有限公司副总裁；西南证券股份有限公司董事、总裁。此外，还曾先后担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、中国证券业协会投资银行业委员会委员、重庆市证券期货业协会会长、盐田港集团外部董事、国投电力

控股股份有限公司独立董事、上海城投控股股份有限公司独立董事等职务。现任银华基金管理有限公司董事长、银华国际资本管理有限公司董事长、银华财富资本管理（北京）有限公司董事、西南证券股份有限公司董事，兼任中国上市公司协会并购融资委员会执行主任、中国退役士兵就业创业服务促进会副理事长、中证机构间报价系统股份有限公司董事、中航动力股份有限公司独立董事、财政部资产评估准则委员会委员、北京大学公共经济管理研究中心研究员。

钱龙海先生：董事，经济学硕士。曾任北京京放投资管理顾问公司总经理助理；佛山证券有限责任公司副总经理。现任第一创业证券股份有限公司党委书记、董事、总裁，兼任第一创业投资管理有限公司董事长、第一创业摩根大通证券有限责任公司董事。还担任中国证券业协会第五届理事会理事，中国证券业协会投资银行业务委员会第五届副主任委员，深圳市证券业协会副会长。

李福春先生：董事，中共党员，研究生，高级工程师。曾任一汽集团公司发展部部长、吉林省经济贸易委员会副主任、吉林省发展和改革委员会副主任、长春市副市长、吉林省发展和改革委员会主任、吉林省政府秘书长。现任东北证券股份有限公司董事长、党委书记。

常忠先生：董事，中共党员，EMBA 硕士。曾任宁夏大元化工股份有限公司董事会秘书，宁夏沙湖旅游股份有限公司副董事长、副总经理，宁夏农垦局产业处副处长，汇中天恒投资有限公司董事长助理。现任海鑫钢铁集团有限公司副总经理，建龙钢铁集团有限公司投资总监。

王立新先生：董事、总经理，经济学博士。曾任中国工商银行总行科员；南方证券股份有限公司基金部副处长；南方基金管理有限公司研究开发部、市场拓展部总监；银华基金管理有限公司总经理助理、副总经理、代总经理、代董事长。现任银华基金管理有限公司董事、总经理、银华财富资本管理（北京）有限公司董事长、银华国际资本管理有限公司董事。

郑秉文先生：独立董事，经济学博士后，教授，博士生导师。曾任中国社会科学院培训中心主任，院长助理，副院长。现任中国社会科学院美国研究所党委书记、所长；中国社科院世界社会保障中心主任；中国社科院研究生院教授，博士生导师，政府特殊津贴享受者，中国人民大学劳动人事学院兼职教授，武汉大学社会保障研究中心兼职研究员，西南财经大学保险学院暨社会保障研

究所兼职教授，辽宁工程技术大学客座教授。

王恬先生：独立董事，大学学历，高级经济师。曾任中国银行深圳分行行长，深圳天骥基金董事，中国国际财务有限公司（深圳）董事长，首长四方（集团）有限公司执行董事。现任南方国际租赁有限公司副董事长，首长四方（集团）有限公司副董事总经理。

陆志芳先生：独立董事，法律硕士，律师。曾任对外经济贸易大学法律系副主任，北京仲裁委员会仲裁员，北京市律师协会国际业务委员会副主任委员，海问律师事务所律师、合伙人，浩天信和律师事务所合伙人、律师。现任北京天达共和律师事务所律师、合伙人。

刘星先生：独立董事，管理学博士，重庆大学经济与工商管理学院会计学教授、博士生导师，政府特殊津贴享受者、中国注册会计师协会非执业会员、中国会计学会理事、中国会计学会对外学术交流专业委员会副主任、中国会计学会教育分会前任会长、中国管理现代化研究会常务理事、中国优选法统筹法与经济数学研究会常务理事。

周兰女士：监事会主席，中国社会科学院货币银行学专业研究生学历。曾任北京建材研究院财务科长；北京京放经济发展公司计财部经理；佛山证券有限责任公司监事长及风险控制委员会委员。现任第一创业证券股份有限公司监事长及风险控制委员会委员。

王致贤先生：监事，硕士。曾任重庆市地方税务局办公室秘书、重庆市政府办公厅一处秘书、重庆市国有资产监督管理委员会办公室秘书、重庆市国有资产监督管理委员会企业管理三处副处长。现任西南证券股份有限公司办公室（党委办公室）主任、证券事务代表。

龚飒女士：监事，硕士学历。曾任湘财证券有限责任公司分支机构财务负责人；泰达荷银基金管理有限公司基金事业部副总经理；湘财证券有限责任公司稽核经理；交银施罗德基金管理有限公司运营部总经理。现任银华基金管理有限公司运作保障部总监。

杜永军先生：监事，大专学历。曾任五洲大酒店财务部收款主管；北京赛特饭店财务部收款主管、收款主任、经理助理、副经理、经理。现任银华基金管理有限公司行政财务部总监助理。

封树标先生：副总经理，工学硕士。曾任国信证券天津营业部经理、平安

证券综合研究所副所长、平安证券资产管理事业部总经理、平安大华基金管理有限公司总经理、广发基金机构投资部总经理等职。2011年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司总经理助理职务，现任银华基金管理有限公司副总经理，同时兼任投资管理二部总监及投资经理。

周毅先生：副总经理，硕士学位。曾任美国普华永道金融服务部部门经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009年9月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华全球核心优选证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）及银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理和公司总经理助理职务。现任银华基金管理有限公司副总经理，兼任公司量化投资总监、量化投资部总监以及境外投资部总监、银华财富资本管理（北京）有限公司董事、银华国际资本管理有限公司总经理，并同时兼任银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理职务。

凌宇翔先生，副总经理，工商管理硕士。曾任机械工业部主任科员；西南证券有限责任公司基金管理部总经理；银华基金管理有限公司督察长。现任银华基金管理有限公司副总经理及银华国际资本管理有限公司董事。

杨文辉先生，督察长，法学博士。曾任职于北京市水利经济发展有限公司、中国证监会。现任银华基金管理有限公司督察长。

2. 本基金基金经理

马君女士，硕士学位。2008年9月至2009年3月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理职务，自2012年9月4日起担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理。自2013年12月16日至2015年7月16日兼任银华消费主题分级股票型证券投资基金基金经理。自2015年8月6日起兼任本基金基金经理；自2015年8月13日起兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理；自2016年1月14日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。

3. 公司投资决策委员会成员

委员会主席：王立新

委员：封树标、周毅、王华、姜永康、王世伟、郭建兴、倪明、董岚枫

王立新先生：详见基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员情况。

封树标先生：详见基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员情况。

周毅先生：详见基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员情况。

王华先生：硕士学位，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于西南证券有限责任公司。2000年10月加盟银华基金管理有限公司（筹），先后在研究策划部、基金经理部工作，曾任银华保本增值证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理。现任银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金和银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、公司总经理助理、投资管理一部总监及A股基金投资总监。

姜永康先生：硕士学位。2001年至2005年曾就职于中国平安保险（集团）股份有限公司，历任研究员、组合经理等职。2005年9月加盟银华基金管理有限公司，曾任养老金管理部投资经理职务。曾担任银华货币市场证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金以及银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理。现任公司总经理助理、投资管理三部总监、固定收益基金投资总监以及银华财富资本管理（北京）有限公司董事，并同时担任银华增强收益债券型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理。

王世伟先生：硕士学位，曾担任吉林大学系统工程研究所讲师；平安证券营业部总经理；南方基金公司市场部总监；都邦保险投资部总经理；金元证券资本市场部总经理。2013年1月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华财富资本管理（北京）有限公司副总经理，现任银华财富资本管理（北京）有限公司总经理。

郭建兴先生：学士学位。曾在山西证券股份有限公司（原山西证券有限责任公司）从事证券自营业工作，历任交易主管、总经理助理兼监理等职；并曾就职于华商基金管理有限公司投资管理部，曾担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司，现任银华优

质增长混合型证券投资基金基金经理。

倪明先生：经济学博士；曾在大成基金管理有限公司从事研究分析工作，历任债券信用分析师、债券基金助理、行业研究员、股票基金助理等职，并曾任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司。现任银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金及银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

董岚枫先生，博士学位；曾任五矿工程技术有限责任公司高级业务员。2010年10月加盟银华基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、行业研究员、研究部副总监。现任研究部总监。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人概况

（一）基金托管人基本情况

1、基本情况

名称：海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

成立时间：1988年8月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复【1988】383号

组织形式：股份有限公司

注册资本：95.8472亿元人民币

联系电话：021-23219000

联系人：朱元元

基金托管资格批文及文号：证监许可【2013】1643号

2、基金托管部门及主要人员情况

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）成立于1988年，是国内最早成立的大型证券公司之一。海通证券A股于2007年在上海证券交易所挂牌上市并完成定向增发，H股于2012年4月在香港联合交易所挂牌上市，公司注册资本金增至95.84亿元。

海通证券设基金托管部，现有员工具有多年金融从业经历，丰富的证券相

关业务经验。全员具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，硕士以上学历占 25%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

王开国先生，海通证券董事长兼执行董事、党委书记，厦门大学经济学博士，高级经济师。1990 年 7 月至 1995 年 2 月在国家国有资产管理局科研所担任多个职位，并任科研所副所长，1992 年 3 月至 1994 年 2 月担任国家国有资产管理局政策法规司政研处处长。1995 年 2 月担任海通证券副总经理，1997 年 11 月担任海通证券总经理，1998 年 5 月起担任海通证券董事长，1998 年 12 月起担任海通证券党委书记，1999 年 4 月起担任上交所理事，2002 年 7 月起担任中国证券业协会副会长。

陈春钱先生，海通证券总经理助理，负责公司经纪业务。陈先生还兼任公司经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与 IT 治理委员会委员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于 1988 年 7 月获安徽财经学院经济学硕士学位并于 1995 年 7 月获厦门大学经济学博士学位，拥有 17 年的证券业工作及管理经验。1997 年 10 月至 1998 年 1 月，担任公司深圳分公司业务部负责人；1998 年 1 月至 2000 年 3 月，担任国际业务部副总经理；2000 年 3 月至 2000 年 12 月，担任深圳分公司副总经理；2000 年 12 月至 2006 年 5 月，担任投资管理部（深圳）总经理；2006 年 5 月至 2013 年 2 月，担任销售交易总部总经理，其间 2007 年 11 月至 2009 年 3 月兼任机构业务部总经理。

朱元元女士，海通证券基金托管部总经理，本科学历，高级经济师，拥有 22 年证券业工作及管理经验。1995 年 7 月加入海通证券，曾任海通证券绍兴营业部业务部副经理、绍兴营业部投资银行部经理、绍兴营业部总经理助理、绍兴营业部副总经理。2005 年 3 月起任海通证券绍兴营业部总经理，2010 年 1 月起任海通证券浙江分公司总经理，2014 年 6 月起任海通证券基金托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

海通证券于 2013 年 12 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司，海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托

管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应当渗透到基金托管业务的决策、执行、监督的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门和岗位，并由全体人员参与，任何决策或操作均应当有案可查；

（2）重要性原则。基金托管业务的内部控制应当在全面控制的基础上，关注基金托管业务运作的重要业务事项和高风险领域；

（3）制衡性原则。岗位设置应权责分明、相对独立、相互制衡，通过切实可行的措施来消除内部控制的盲点。

（4）适应性原则。内部控制体系应同基金托管业务规模、业务范围、竞争状况和风险水平及业务其他环境相适应，内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有超出内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当得到及时反馈和纠正；

（5）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营、保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新增业务时，先做好相关制度建设；

（6）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的负责人进行问责。

3、内部控制制度及措施

根据《基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》第 92 号令、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》等法律法规，基金托管人制

定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《海通证券证券投资基金托管业务管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务内部控制管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务保密管理规定》、《海通证券证券投资基金托管业务印章及加密设备管理规定》、《海通证券基金托管业务从业人员行为规范》、《海通证券证券投资基金托管业务档案管理规定》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请立信会计师事务所（特殊普通合伙）对基金托管业务运行进行内部控制评审。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、相关服务机构情况

（一）基金份额发售机构

1. 场外销售机构

（1）直销机构

1) 银华基金管理有限公司北京直销中心

地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层		
电话	010-58162950	传真	010-58162951
联系人	展璐	网址	www.yhfund.com.cn
全国统一客户服务电话	400-678-3333		

2) 银华基金管理有限公司网上直销交易系统

网上交易网址	trade.yhfund.com.cn/etrading
手机交易网站	m.yhfund.com.cn
客户服务电话	010-85186558, 4006783333

投资人可以通过基金管理人网上直销交易系统办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。

(2) 其他场外销售机构

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		
法定代表人	田国立		
客服电话	95566	网址	www.boc.cn

2) 交通银行股份有限公司

注册地址	上海市银城中路188号		
法定代表人	牛锡明		
客服电话	95559	网址	www.bankcomm.com

3) 招商银行股份有限公司

注册地址	深圳市福田区深南大道7088号		
法定代表人	李建红		
客服电话	95555	网址	www.cmbchina.com

4) 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		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
客服电话	400-6515-988	网址	http://www.bhzq.com

5) 大同证券有限责任公司

注册地址	大同市城区迎宾街15号桐城中央21层		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
客服电话	4007121212	网址	http://www.dtsbc.com.cn/

6) 国都证券股份有限公司

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		
------	---------------------------	--	--

法定代表人	常喆		
客服电话	400-818-8118	网址	www.guodu.com

7) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址	新疆乌鲁木齐市文艺路233号		
法定代表人	李季	联系人	李巍
客服电话	400-800-0562	网址	www.hysec.com

8) 华龙证券股份有限公司

注册地址	兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼		
法定代表人	李晓安	联系人	邓鹏怡
客服电话	95368	网址	www.hlzqgs.com

9) 江海证券有限公司

注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

10) 联讯证券股份有限公司

注册地址	中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心		
法定代表人	徐刚	联系人	郭晴
客服电话	95564	网址	www.lxzq.com.cn

11) 中泰证券股份有限公司

注册地址	山东省济南市经七路86号		
法定代表人	李玮	联系人	马晓男
客服电话	95538	网址	www.zts.com.cn

12) 山西证券股份有限公司

注册地址	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
客服电话	400-666-1618; 95573	网址	www.i618.com.cn

13) 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		
法定代表人	林义相	联系人	尹伶
客服电话	010-66045678	网址	www.tjm.com.cn

14) 西部证券股份有限公司

注册地址	西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层		
法定代表人	刘建武	联系人	梁承华

客服电话	95582	网址	www.westsecu.com.cn
------	-------	----	---------------------

15) 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		
法定代表人	张志刚	联系人	唐静
客服电话	95321	网址	www.cindasc.com

16) 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		
法定代表人	陈有安	联系人	邓颜
客服电话	400-888-8888	网址	www.chinastock.com.cn

17) 中信建投证券股份有限公司

注册地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
客服电话	400-8888-108	网址	www.csc108.com

18) 中信证券股份有限公司

注册地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层		
法定代表人	王东明	联系人	郑慧
客服电话	95558	网址	www.citics.com

19) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层(266061)		
法定代表人	杨宝林	联系人	吴忠超
客服电话	95548	网址	www.citicssd.com

20) 爱建证券有限责任公司

注册地址	上海市世纪大道1600号32楼		
法定代表人	钱华	联系人	王薇
网址	www.ajzq.com		

21) 安信证券股份有限公司

注册地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元		
法定代表人	王连志		
客服电话	400-800-1001	网址	www.essence.com.cn

22) 财富证券有限责任公司

注册地址	长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心		
法定代表人	蔡一兵	联系人	郭磊

网址	www.cfzq.com
----	--------------

23) 长城证券股份有限公司

注册地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层		
法定代表人	黄耀华		
客服电话	0755-33680000; 400-6666-888	网址	www.cgws.com

24) 长江证券股份有限公司

注册地址	武汉市新华路特8号长江证券大厦		
法定代表人	杨泽柱	联系人	奚博宇
客服电话	95579; 400-8888-999	网址	www.95579.com

25) 第一创业证券股份有限公司

注册地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
法定代表人	刘学民		
客服电话	95358	网址	www.firstcapital.com.cn

26) 东海证券股份有限公司

注册地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	朱科敏	联系人	梁旭
客服电话	95531; 400-8888-588	网址	http://www.longone.com.cn

27) 东吴证券股份有限公司

注册地址	苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦		
法定代表人	范力	联系人	方晓丹
客服电话	4008-601-555	网址	http://www.dwzq.com.cn

28) 光大证券股份有限公司

注册地址	上海市静安区新闻路1508号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨
客服电话	95525; 10108998; 400-888-8788	网址	www.ebscn.com

29) 国金证券股份有限公司

注册地址	成都市青羊区东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	刘婧漪
客服电话	4006-600109	网址	www.gjzq.com.cn

30) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号		
法定代表人	杨德红		
客服电话	400-8888-666	网址	www.gtja.com

31) 海通证券股份有限公司

注册地址	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	网址	www.htsec.com

32) 华安证券股份有限公司

注册地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号		
法定代表人	李工	联系人	范超
客服电话	96518(安徽)；400-809-6518(全国)	网址	www.hazq.com

33) 华宝证券有限责任公司

注册地址	上海市浦东新区世纪大道100号57层		
法定代表人	陈林		
客服电话	400-820-9898	网址	www.cnhbstock.com

34) 华福证券有限责任公司

注册地址	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
法定代表人	黄金琳		
客服电话	96326（福建省外请先拨0591）	网址	www.hfzq.com.cn

35) 华鑫证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元		
法定代表人	俞洋	联系人	杨莉娟
客服电话	021-32109999；029-68918888；400-109-9918	网址	www.cfsc.com.cn

36) 金元证券股份有限公司

注册地址	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
法定代表人	陆涛		

客服电话	400-888-8228	网址	www.jyzq.cn
------	--------------	----	-------------

37) 平安证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层		
法定代表人	谢永林		
客服电话	95511-8	网址	stock.pingan.com

38) 上海证券有限责任公司

注册地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	龚德雄		
客服电话	021-962518	网址	www.962518.com

39) 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		
法定代表人	李梅		
客服电话	95523; 400-889-5523	网址	www.swhysc.com

40) 太平洋证券股份有限公司

注册地址	云南省昆明市青年路389号志远大厦18层		
法定代表人	李长伟	联系人	唐昌田
客服电话	400-665-0999	网址	http://www.tpyzq.com

41) 五矿证券有限公司

注册地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元		
法定代表人	赵立功	联系人	王鹏宇
客服电话	400-184-0028	网址	www.wkzq.com.cn

42) 西藏同信证券股份有限公司

注册地址	西藏自治区拉萨市北京中路101号		
法定代表人	贾绍君	联系人	曹亦思
客服电话	400-881-1177	网址	www.xzsec.com

43) 西南证券股份有限公司

注册地址	重庆市江北区桥北苑8号		
法定代表人	余维佳		
客服电话	400-809-6096	网址	www.swsc.com.cn

44) 湘财证券股份有限公司

注册地址	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
------	-------------------------------	--	--

法定代表人	林俊波	联系人	李欣
客服电话	400-888-1551	网址	www.xcsc.com

45) 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		
客服电话	95562	网址	www.xyzq.com.cn

46) 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	宫少林	联系人	黄婵君
客服电话	400-8888-111; 95565	网址	www.newone.com.cn

47) 中航证券有限公司

注册地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼		
法定代表人	王宜四	联系人	戴蕾
客服电话	400-8866-567	网址	www.avicsec.com

48) 中山证券有限责任公司

注册地址	深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层		
法定代表人	黄扬录	联系人	罗艺琳
客服电话	400-1022-011	网址	http://www.zszq.com/

49) 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼		
联系人	童彩平		
客服电话	4006-788-887	网址	www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

50) 杭州数米基金销售有限公司

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		
联系人	徐昶绯		
客服电话	4000-766-123	网址	www.fund123.cn

51) 上海好买基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼(200120)		
联系人	罗梦		
客服电话	400-700-9665	网址	www.ehowbuy.com

52) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903		
联系人	吴杰		
客服电话	4008-773-772	网址	www.ijijin.cn

53) 上海天天基金销售有限公司

办公地址	上海市徐汇区龙田路195号 3C座9楼		
联系人	潘世友		
客服电话	400-1818-188	网址	www.1234567.com.cn

54) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址	北京市海淀区海淀南路 13 号楼 6 层 616 室		
联系人	魏争		
客服电话	400-678-5095	网址	www.niuji.net

55) 嘉实财富管理有限公司

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
联系人	费勤雯		
客服电话	400-021-8850	网址	www.harvestwm.cn

56) 北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层		
联系人	马鹏程		
客服电话	400-786-8868-5	网址	www.chtfund.com

57) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层		
联系人	单丙焯		
客服电话	400-820-2899	网址	www.erichfund.com

58) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层		
联系人	张燕		
客服电话	4008507771	网址	t.jrj.com

2. 场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交

易所会员（其具体名单可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

3. 基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构销售本基金，并按照相关规定及时公告。

（二）登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所及办公地址	中国北京西城区太平桥大街17号		
法定代表人	周明	联系人	崔巍
电话	(021) 58872625	传真	010-58598907

（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：俞卫峰

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（四）会计师事务所及经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）北京分所

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层10室

法定代表人：崔劲

经办注册会计师：吕静、姜金玲

电话：010-85207331

传真：010-85181218

联系人：吕静

五、基金的名称

银华中证国防安全指数分级证券投资基金

六、基金的类型

股票型证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国防安全指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

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，包括中证国防安全指数的成份股、备选成份股、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或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）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证国防安全指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

九、基金的投资策略

本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在中证国防安全指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国防安全指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证国防安全指数的效果可能带来影响，导致无

法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证国防安全指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证国防安全指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、股票投资组合构建

（1）组合构建方法

本基金原则上将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国防安全指数的收益表现。

（2）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证国防安全指数成份股组成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和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行实时调整。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

（1）定期调整

根据中证国防安全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。中证指数有限公司原则上每半年审核一次中证国防安全指数成份股。本基金将按照中证国防安全指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。

（2）不定期调整

A. 当上市公司发生增发、配股等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，从而有效跟踪中证国防安全指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在中证国防安全指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数基本一致。

3、债券投资策略

在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、金融衍生工具投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

本基金管理人对股指期货的运用将进行充分的论证。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当

期收益。

十、基金的业绩比较标准

$95\% \times \text{中证国防安全指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$

如本基金标的指数变化，则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。业绩比较基准的调整根据标的指数的变更程序执行。

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。

从本基金所自动分拆/分拆的两类基金份额来看，国安 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；国安 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

十二、投资组合报告

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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，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 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

1. 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	327,066.00	3.64
	其中：股票	327,066.00	3.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,646,213.36	18.33
8	其他资产	7,005,626.17	78.02

9	合计	8,978,905.53	100.00
---	----	--------------	--------

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	163,845.00	1.88
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	-	-
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	163,221.00	1.88
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	327,066.00	3.76

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

3. 报告期末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

3.1 报告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	300324	旋极信息	1,600	78,800.00	0.91
2	000901	航天科技	1,000	52,880.00	0.61
3	600271	航天信息	700	50,022.00	0.57
4	300036	超图软件	1,100	42,911.00	0.49
5	002544	杰赛科技	1,400	41,510.00	0.48
6	600990	四创电子	500	31,375.00	0.36
7	000925	众合科技	1,600	29,568.00	0.34

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

3.2 报告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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,407.64
2	应收证券清算款	7,001,362.06
3	应收股利	-
4	应收利息	856.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,005,626.17

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金在本报告期末持有可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300324	旋极信息	78,800.00	0.91	重大事项停牌
2	000901	航天科技	52,880.00	0.61	重大事项停牌
3	600271	航天信息	50,022.00	0.57	重大事项停牌
4	300036	超图软件	42,911.00	0.49	重大事项停牌
5	002544	杰赛科技	41,510.00	0.48	重大事项停牌
6	600990	四创电子	31,375.00	0.36	重大事项停牌
7	000925	众合科技	29,568.00	0.34	重大事项停牌

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金在本报告期末持有积极投资股票。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金的业绩

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代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金份额净值收益率与业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2015.8.6（基金合同生效日） 至 2015.12.31	3.94%	0.57%	6.96%	3.17%	-3.02%	-2.60%

十四、基金的费用

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁费等法律费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用、基金的银行账户维护费；
- 8、标的指数使用费；
- 9、基金上市初费和上市月费；
- 10、因基金的证券/期货交易或结算而产生的费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费

用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

自基金合同生效之日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的

1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

自基金合同生效之日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的

0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费为许可使用基点费。如指数编制机构作为使用许可方与基金管理人签订的指数使用许可协议变更费率的，本项指数许可使用费将相应调整。

标的指数许可使用基点费的计费时间从基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年，标的指数许可

使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。计费期间不足一季度的，以实际天数占当季度天数的比例乘以 5 万元和实际累计指数许可使用基点费孰高为当季应付指数许可使用基点费。

标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

若中证指数有限公司调整本基金指数许可使用费，则本基金将对指数许可使用费的收取做相应调整，且此项调整无需召开基金份额持有人大会审议。

上述“（一）基金费用的种类中除第 1、2、8 项外费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

银华中证国防安全指数分级证券投资基金招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，增加了基金合同生效日及本次更新招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期；
- 2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的概况及主要人员情况进行了更新；
- 3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新；
- 4、在“六、基金的募集”部分，增加了募集结果，删去了认购期相关描述；
- 5、在“七、基金合同的生效”部分，更新基金合同生效日期；
- 6、在“八、基金份额的申购与赎回”部分，更新了开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的时间；
- 7、在“九、基金的投资”部分，增加了最近一期的投资组合报告；
- 8、增加“十、基金的业绩”部分，更新了截至2015年12月31日的基金投资业绩；
- 9、对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司

2016年3月22日