

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016 年第 2 号)

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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 2013 年 11 月 7 日证监许可【2013】1433 号文核准募集。

本基金的基金合同生效日为 2014 年 4 月 9 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。

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。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、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风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，H 股 A 份额具有预期低风险、收益相对稳定的特征；H 股 B 份额具有预期高风险、高预期收益的特征。在标的指数下跌的市场环境下，当 H 股 B 份额跌破 0.2000 元后，H 股 A 份额与 H 股 B 份额暂时将各负盈亏，H 股 A 份额持有人的本金存在可能损失的风险。同时，本基金为海外证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、主要市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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。

本基金投资于境外证券市场，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，包括市场类风险，投资工具类风险、投资管理类风险、技术类风险和特殊事件类风险、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）。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H份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额（包括银华H份额、H股A份额、H股B份额和银华H份额）的10%时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“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，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本招募说明书、本基金的基金份额发售公告以及相关公告。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为2016年10月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日，所披露的投资组合为2016年第3季度的数据（财务数据未经审计）。

一、基金的名称

本基金名称：银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

二、基金的类型

股票型基金

三、基金的投资目标

本基金力争对恒生中国企业指数进行有效跟踪，并力争将本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的绝对值控制在0.5%以内，年跟踪误差控制

在 5%以内，以实现基金资产的长期增值。

四、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，包括标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF、以及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具以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）。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后（不需召开基金份额持有人大会），可以将其纳入投资范围。

五、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用复制法，按照成份股在恒生中国企业指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪恒生中国企业指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金可以投资于跟踪同一标的指数的 ETF，基金管理人可在标的指数成份股和跟踪同一标的指数的 ETF 之间选择较优的方式实施组合构建，以达到节约成本和更好地跟踪标的指数的目的。

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恒生中国企业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恒生中国企业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。本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的

85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

2. 股票投资组合构建

（1）组合构建原则与方法

本基金将采用复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪恒生中国企业指数的收益表现。

（2）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据恒生中国企业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，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与恒生中国企业指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

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

根据恒生中国企业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 临时调整

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，从而有效跟踪恒生中国企业指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在恒生中国企业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一致。

（3）投资绩效评估

在正常市场情况下，本基金力争实现年跟踪误差不超过 5%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。

（二）投资决策

投资决策依据如下：

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；

(2) 宏观经济发展态势、区域经济发展情况、各国微观经济运行环境及其货币市场和证券市场运行状况、地缘政治和投机因素；

(3) 国家行业政策、各行业在经济周期的表现、行业的发展趋势和行业竞争格局等；公司的核心竞争力的研究、财务报表的分析和价值评估；

(4) 宏观分析师、策略分析师、股票分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

(5) 团队投资方式。本基金在境外投资决策委员会领导下，由基金管理人具体执行投资计划，争取良好投资业绩。

决策程序如下：

(1) 境外投资部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，依此提出研究分析报告；

(2) 境外投资决策委员会依据境外投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策；

(3) 根据标的指数，结合研究报告，基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合，在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低交易成本、控制投资风险；

(4) 交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易；

(5) 境外投资部的境外风险控制人员根据市场变化定期和不定期对投资组合进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制；

(6) 基金经理根据跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、境外投资风险控制人员和监察稽核部提供的绩效评估报告以及对各种风险的监控和评估结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

六、业绩比较基准

人民币/港币汇率×恒生中国企业指数收益率×95%+人民币活期存款收益率
×5%（税后）

本基金是股票型基金，以恒生中国企业指数作为跟踪标的，采用复制法，按照成份股在恒生中国企业指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪恒生中国企业指数的收益表现。使用“人民币/港币汇率×恒生中国企业指数

收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）”作为本基金的业绩比较基准，能较好的反映本基金资产配置以及指数化投资的标的构成。

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。此外，如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以变更业绩比较基准并及时公告。

其中，若标的指数变更涉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，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方法变化等），则无需召开基金份额持有人大会，在报中国证监会备案后及时公告。

七、风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，H股A份额具有预期低风险、收益相对稳定的特征；H股B份额具有预期高风险、高预期收益的特征。同时，本基金为海外证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、主要市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

八、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。

基金托管人中国建设银行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2016年9月30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（人民币元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 6,247,697,697.25 88.07

其中：普通股 6,247,697,697.25 88.07

优先股 - 0.00

存托凭证 - 0.00

房地产信托凭证 - 0.00

2 基金投资 - 0.00

3 固定收益投资 - 0.00

其中：债券 - 0.00
 资产支持证券 - 0.00
 4 金融衍生品投资 0.00 0.00
 其中：远期 - 0.00
 期货 0.00 0.00
 期权 - 0.00
 权证 - 0.00
 5 买入返售金融资产 - 0.00
 其中：买断式回购的买入返售金融资产 - 0.00
 6 货币市场工具 - 0.00
 7 银行存款和结算备付金合计 801,028,421.07 11.29
 8 其他资产 45,372,318.84 0.64
 9 合计 7,094,098,437.16 100.00

2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布
 国家（地区） 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）
 中国香港 6,247,697,697.25 89.27
 合计 6,247,697,697.25 89.27

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

3. 自 2015 年 4 月 28 日起，本基金开始通过沪港通机制投资于中国香港股票市场
 上的恒生中国企业指数成分股、备选股。截至本报告期末，本基金通过沪港通交
 易机制持有的股票的市值为 6,008,777,738.77 元，占期末净值 85.86%。

3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）
 保健 Health Care 123,653,458.47 1.77
 必需消费品 Consumer Staples 29,849,485.51 0.43
 材料 Materials 71,590,731.71 1.02
 电信服务 Telecommunication Services 148,882,083.55 2.13
 非必需消费品 Consumer Discretionary 226,181,705.00 3.23
 工业 Industrials 335,809,932.05 4.80

公共事业 Utilities 175,563,845.19 2.51
 金融 Financials 4,275,493,387.10 61.09
 能源 Energy 860,673,068.67 12.30
 合计 6,247,697,697.25 89.27

注：1. 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	03988	HKCG	港股通 中国香港	232,701,000	709,233,973.09	10.13
2	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	中国工商银行股份有限公司	01398	HKCG	港股通 中国香港	162,949,000	680,426,872.57	9.72
3	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	HKCG	港股通 中国香港	16,843,000	582,952,971.94	8.33
4	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	02628	HKCG	港股通 中国香港	23,926,000	411,991,364.40	5.89
5	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工集团公司	00386	HKCG	港股通 中国香港	80,376,000	390,987,484.67	5.59
6	PetroChina Company Limited	中国石油天然气集团公司	00857	HKCG	港股通 中国香港	67,014,000	293,677,951.82	4.20
7	Agricultural Bank Of China Limited	中国农业银行股份有限公司	01288	HKCG	港股通 中国香港	78,652,000	224,820,481.30	3.21
8	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	03968	HKCG	港股通 中国香港	12,404,000	208,676,880.54	2.98
9	China Pacific Insurance(group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	02601	HKCG	港股通 中国香港	7,631,200	188,237,211.66	2.69
10	Picc Property And Casualty Company Limited	中国人民财产保险股份有限公司	02328	HKCG	港股通 中国香港	14,798,000	163,589,741.33	2.34

注：本基金本报告期末未持有存托凭证。

5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明
细

序号 衍生品类别 衍生品名称 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 其他衍生工具_股指期货_初始 HHI1612_D 543,245,810.42 7.76

2 其他衍生工具_股指期货_冲抵 HHI1612_D -543,245,810.42 -7.76

9 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基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

10 投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 34,557,183.38

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 10,560,210.21

4 应收利息 112,503.08

5 应收申购款 142,422.17

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 45,372,318.84

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

10.6 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。

九、基金的业绩

本基金的业绩计算标准符合全球投资表现标准（GIPS）的要求。

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。

本基金合同生效日为2014年4月9日，基金合同生效以来的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效日（2014.4.9）至2014.12.31	17.21%	1.10%	14.14%	1.14%	3.07%	-0.04%
2015.1.1至2015.12.31	-21.36%	1.68%	-13.55%	1.73%	-7.81%	-0.05%
2016.1.1至2016.6.30	-6.29%	1.62%	-7.53%	1.60%	1.24%	0.02%
2016年7.1至2016.9.30	10.05%	1.08%	10.24%	1.07%	-0.19%	0.01%
自基金合同生效日（2014.4.9）至2016.9.30	-4.93%	1.46%	0.59%	1.48%	-5.52%	-0.02%

十、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称 银华基金管理股份有限公司

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 股份有限公司 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。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

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“战略委员会”、“风险控制委员会”、“薪酬与提名委员会”、“审计委员会”四个专业委员会，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，西南证券副总裁，中国银河证券副总裁，西南证券董事、总裁；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。现任公司董事长、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、中国中材股份有限公司独立董事、财政部资产评估准则委员会委员。

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；并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。

吴坚先生：董事，中共党员。曾任重庆市经济体制改革委员会主任科员，重庆市证券监管办公室副处长，重庆证监局上市处处长，重庆渝富资产经营管理集团有限公司党委委员、副总经理，重庆东源产业投资股份有限公司董事长，重庆机电股份有限公司董事，重庆上市公司董事长协会秘书长，西南证券有限责任公司董事，安诚财产保险股份有限公司副董事长，重庆银海融资租赁有限公司董事长，重庆直升机产业投资有限公司副董事长，华融渝富股权投资基金管理有限公司副董事长，西南药业股份有限公司独立董事，西南证券股份有限公司董事，西南证券股份有限公司副总裁。现任西南证券股份有限公司总裁，重庆股份转让中心有限责任公司董事长，西证国际投资有限公司董事，西证国际证券股份有限公司执行董事，重庆仲裁委仲裁员。

王立新先生：董事，总经理，经济学博士。曾就读于北京大学哲学系、中央党校研究生部、中国社会科学院研究生部、长江商学院 EMBA。先后就职于中国工商银行总行、中国农村发展信托投资公司、南方证券股份有限公司基金部；参与筹建南方基金管理有限公司，并历任南方基金研究开发部、市场拓展部总监。现任银华基金管理股份有限公司总经理、银华财富资本管理（北京）有限公司董事长。此外，兼任中国基金业协会理事、香山论坛发起理事、秘书长、《中国证券投资基金年鉴》副主编、北京大学校友会理事、北京大学企业家俱乐部理事、北京大

学哲学系系友会秘书长、北京大学金融校友联合会副会长。

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。

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、国务院“政府特殊津贴”获得者，全国先进会计（教育）工作者，中国注册会计师协会非执业会员。现任中国会计学会理事，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，中国优选法统筹与经济数学研究会常务理事。

邢冬梅女士：独立董事，法律硕士，律师。曾任职于司法部中国法律事务中心（后更名为信利律师事务所），并历任北京市共和律师事务所合伙人。现任北京天达共和律师事务所管理合伙人、金融部负责人，同时兼任北京朝阳区律师协会会长。

封和平先生：独立董事，会计学硕士，中国注册会计师。曾任职于财政部所属中华财务会计咨询公司，并历任安达信华强会计师事务所副总经理、合伙人，普华永道会计师事务所合伙人、北京主管合伙人，摩根士丹利中国区副主席；还曾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、第29届奥运会北京奥组委财务顾问。现任普华永道高级顾问，北京注册会计师协会第五届理事会常务理事。

王芳女士：监事会主席，研究生学历。2000年至2004年任大鹏证券有限责任公司法律支持部经理，2004年10月起历任第一创业证券有限公司首席律师、法律合规部总经理、合规总监、副总裁。现任第一创业证券股份有限公司副总裁、合规总监、首席风险官，兼任第一创业摩根大通证券有限公司董事。

李军先生：监事，管理学博士。曾任四川省农业管理干部学院教师，西南证券股份有限公司成都证券营业部咨询部分析师、高级客户经理、总经理助理、业务总监，西南证券股份有限公司经纪业务部副总经理。此外，还曾先后担任重庆市国有资产监督管理委员会统计评价处（企业监管三处）副处长、企业管理三处副处长、企业管理二处处长、企业管理三处处长，并曾兼任重庆渝富资产经营管理集团有限公司外部董事。现任西南证券股份有限公司运营管理部总经理。

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主管，北京赛特饭店财务部主管、主任、经理助理、副经理、经理。现任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责任公司总经理、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任公司总经理助理。现任公司副总经理，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；自2001年起任银华基金管理有限公司督察长。

现任公司副总经理，兼任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。现任银华基金管理股份有限公司督察长，兼任银华财富资本管理（北京）有限公司董事。

2. 本基金基金经理

乐育涛先生，硕士学位。曾就职于WorldCo金融服务公司，主要从事自营证券投资工作；曾就职于Binocular资产管理公司，从事股指期货交易策略研究工作；并曾就职于Evaluserve咨询公司，任职投资研究部主管。2007年4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基金经理助理职务，现任银华国际资本管理有限公司执行董事。2011年5月11日起任“银华全球核心优选证券投资基金”基金经理，自2014年4月9日起兼任本基金基金经理。

周大鹏先生，硕士学位。毕业于中国人民大学。2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职，自2011年9月26日起至2014年1月6日期间担任银华沪深300指数证券投资

基金（LOF）基金经理，自 2014 年 1 月 7 日起兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金（由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型）基金经理，自 2012 年 8 月 23 日起兼任上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2012 年 8 月 29 日起兼任银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2013 年 5 月 22 日至 2016 年 4 月 25 日兼任银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任本基金基金经理。

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、倪明、董岚枫、肖侃宁

王立新先生：详见主要人员情况。

封树标先生：详见主要人员情况。

周毅先生：详见主要人员情况。

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、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金基金经理。现任银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、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和银华优质增长混合型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、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、投资管理三部总监及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。

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、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和银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）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。

肖侃宁先生，硕士研究生，曾在南方证券武汉总部任投资理财部投资经理，天同（万家）基金管理有限公司任天同180指数基金、天同保本基金及万家货币基金基金经理，太平养老保险股份有限公司投资管理中心任投资经理管理企业年金，在长江养老保险股份有限公司历任投资管理部副总经理、总经理、投资总监、公司总经理助理（分管投资和研究工作）。2016年8月加入银华基金管理股份有限公司，现任总经理助理。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；
2. 基金托管人的托管费，含境外托管代理行收取的费用；
3. 基金合同生效后的指数许可使用费；
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁费等法律费用；
8. 基金的证券交易费用；
9. 证券账户开户费用；
10. 基金上市初费和上市月费；
11. 外汇兑换交易的相关费用；
12. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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，及时联系托管人协商解决。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.28%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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；

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按每季金额在 25,000 港币与参考下列公式逐日累计计算的金额中孰高者计。

计算方法如下：

在每个自然日：

$$H = E \times A \div \text{当年实际天数}$$

H 为每个自然日应计提的指数使用费，币种为人民币

A 等于 0.04%，为“恒生中国企业指数”指数许可使用费的费率

E 为前一自然日基金资产净值

指数使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季度首日起 15 个自然日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4. 其他基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。基金管理人最终税务的处理的真实准确负责。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

十二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长5.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,052亿元，增长6.09%，其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、

跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”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。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

十三、境外资产托管人

名称：摩根大通银行香港分行（JPMorgan Chase Bank, National Association HONG KONG BRANCH），摩根大通银行香港分行为摩根大通银行（JPMorgan Chase Bank, National Association）在香港注册的分支机构。

摩根大通银行（以下或简称摩根大通）：

注册地址：1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.

办公地址：270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070

法定代表人：James Dimon

成立时间：1799 年

信用等级：穆迪评级 Aa3（高级信用债券）

作为全球领先的金融服务公司，摩根大通拥有 2.5 万亿美元资产，在超过 60 个国家经营。在投资银行业务、消费者金融服务、小企业和商业银行业务、金融交易处理、资产管理和私募股权投资基金等方面，摩根大通均为业界领导者。

摩根大通自 1946 年开始为其美国客户提供托管服务。之后为响应客户投资海外的要求，该公司在 1974 年率先开展了一种综合性的服务率先全球托管。此后，摩根大通继续扩展服务，以满足不断变化的客户需要。通过提供优质服务和创新的产品，摩根大通始终保持其领先地位。

作为全球托管行业的领先者，摩根大通托管资产达 20.5 万亿美元（截至 2014 年 12 月 31 日），为全世界最大的机构投资者提供创新的托管、基金会计和服务以及证券服务。

摩根大通是一家真正的全球机构，在超过 60 个国家有实体运作。与很多竞争对手不同之处在于，摩根大通还可为客户提供顶级投资银行在市场领先的服务，包括外汇交易、全球期货与期权清算、股权及股权挂钩产品以及固定收益投资的交易与研究。同时，在资产负债表内和表外的现金和流动性方面，我们也有很强的解决方案能力。

此外，摩根大通还是亚太地区全球托管的先行者之一，其历史可以追溯到 1974 年，在亚太地区 15 个国家/地区均有客户：日本、澳大利亚、文莱、中国、香港、印度、马来西亚、新西兰、新加坡、韩国、台湾、菲律宾、泰国、东帝汶和越南。

十四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 直销机构

（1）银华基金管理股份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) 银华基金管理股份有限公司网上直销交易系统

网上交易网址 trade.yhfund.com.cn/etrading

移动端站点 请到本公司官方网站或各大移动应用市场下载“银华生利宝”手机APP 或关注“银华基金”官方微信

客户服务电话 010-85186558, 4006783333

2. 场内代销机构

场内代销机构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场内会员单位。（具体名单见基金份额发售公告）

3、场外代销机构

1) 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

法定代表人 王洪章

客服电话 95533 网址 www.ccb.com

2) 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

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人 周慕冰

客服电话 95599 网址 www.abchina.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

法定代表人 牛锡明

客服电话 95559 网址 www.bankcomm.com

5) 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

6) 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

网址 www.ajzq.com

7) 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

网址 www.cfzq.com

8) 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

9) 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 尤习贵

客服电话 95579; 400-8888-999 网址 www.95579.com

10) 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

11) 东莞证券股份有限公司

注册地址 东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人 张运勇

客服电话 95328 网址 www.dgzq.com.cn

12) 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 赵俊

客服电话 95531; 400-8888-588 网址 <http://www.longone.com.cn>

13) 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

客服电话 95330 网址 <http://www.dwzq.com.cn>

14) 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

客服电话 95525; 400-888-8788 网址 www.ebscn.com

15) 广发证券股份有限公司

注册地址 广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人 孙树明

客服电话 95575 或致电各地营业网点 网址 <http://www.gf.com.cn>

16) 广州证券股份有限公司

注册地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人 邱三发

客服电话 95396 网址 www.gzs.com.cn

17) 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 95521 网址 www.gtja.com

18) 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 16-26 层

法定代表人 何如

客服电话 95536 网址 www.guosen.com.cn

19) 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

客服电话 95318 网址 www.hazq.com

20) 华泰证券股份有限公司

注册地址 南京市江东中路 228 号

法定代表人 周易

客服电话 95597 网址 www.htsc.com.cn

21) 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

客服电话 021-32109999; 029-68918888 400-109-9918 网址 www.cfsc.com.cn

22) 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

23) 平安证券股份有限公司

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

24) 长城国瑞证券有限公司

注册地址 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人 王勇

客服电话 0592-5163588 网址 www.xmzq.cn

25) 上海证券有限责任公司

注册地址 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人 李俊杰

客服电话 021-962518 网址 www.962518.com

26) 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

27) 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>

28) 万联证券有限责任公司

注册地址 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人 张建军

客服电话 400-8888-133 网址 www.wlzq.com.cn

29) 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 吴坚

客服电话 400-809-6096 网址 www.swsc.com.cn

30) 英大证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区深南中路华能大厦 30、31 层

法定代表人 吴骏

客服电话 4000-188-688 网址 www.ydsc.com.cn

31) 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

客服电话 400-8888-111; 95565 网址 www.newone.com.cn

32) 浙商证券股份有限公司

注册地址 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6/7

法定代表人 吴承根

客服电话 0571-967777 网址 www.stocke.com.cn

33) 中国中投证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层
及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人 高涛

客服电话 95532 网址 www.china-invs.cn

34) 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

客服电话 400-8866-567 网址 www.avicsec.com

35) 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发展大楼 7 层、8 层

法定代表人 黄扬录

客服电话 400-1022-011 网址 <http://www.zszq.com/>

36) 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

客服电话 400-6515-988 网址 www.ewww.com.cn

37) 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

客服电话 4007121212 网址 <http://www.dtsbc.com.cn/>

38) 东北证券股份有限公司

注册地址 长春市自由大路 1138 号

法定代表人 李福春

客服电话 95360 网址 www.nesc.cn

39) 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 王少华

客服电话 400-818-8118 网址 www.guodu.com

40) 恒泰证券股份有限公司

注册地址 内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人 庞介民

客服电话 4001966188 网址 www.cnht.com.cn

41) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼
2005 室

法定代表人 韩志谦

客服电话 400-800-0562 网址 www.hysec.com

42) 华龙证券股份有限公司

注册地址 甘肃省兰州市东岗西路 638 号

法定代表人 李晓安

客服电话 95368 网址 www.hlzqgs.com

43) 华融证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人 祝献忠

客服电话 400-898-9999 网址 www.hrsec.com.cn

44) 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

客服电话 400-666-2288 网址 www.jhzq.com.cn

45) 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

客服电话 95564 网址 www.lxzq.com.cn

46) 中泰证券股份有限公司

注册地址 济南市市中区经七路 86 号

法定代表人 李玮

客服电话 95538 网址 www.zts.com.cn

47) 瑞银证券有限责任公司

注册地址 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人 程宜荪

客服电话 400-887-8827 网址 www.ubssecurities.com

48) 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

客服电话 400-666-1618;

95573 网址 www.i618.com.cn

49) 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

客服电话 010-66045678 网址 www.tjtm.com.cn

50) 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

客服电话 95582 网址 www.westsecu.com.cn

51) 新时代证券股份有限公司

注册地址 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人 田德军

客服电话 4006-98-98-98 网址 www.xsdzq.cn

52) 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

客服电话 95321 网址 www.cindasc.com

53) 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

54) 中国民族证券有限责任公司

注册地址 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人 赵大建

客服电话 4008895618 网址 www.e5618.com

55) 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

客服电话 400-888-8888 网址 www.chinastock.com.cn

56) 中天证券有限责任公司

注册地址 辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 号甲

法定代表人 马功勋

客服电话 400-6180-315 网址 www.izqzq.com

57) 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

客服电话 400-8888-108 网址 www.csc108.com

58) 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 张佑君

客服电话 95558 网址 www.citics.com

59) 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

客服电话 95548 网址 www.citicssd.com

60) 首创证券有限责任公司

注册地址 北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人 吴涛

客服电话 4006200620 网址 www.sczq.com.cn

61) 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

客服电话 400-184-0028 网址 www.wkzq.com.cn

62) 中国国际金融股份有限公司

注册地址 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人 丁学东

客服电话 400-910-1166 网址 www.ciccs.com.cn

63) 中信期货有限公司

注册地址 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人 张皓

客服电话 400-990-8826 网址 www.citicsf.com

64) 中原证券股份有限公司

注册地址 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人 菅明军

客服电话 95377 网址 www.ccnew.com

65) 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

66) 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

67) 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

68) 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

69) 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/

70) 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

71) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

联系人 徐映绯

客服电话 4000-766-123 网址 www.fund123.cn

72) 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

73) 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

74) 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

75) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区陆家嘴 1333 号 14 楼

联系人 宁博宇

客服电话 400-821-9031 网址 www.lufunds.com

76) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F

联系人 张裕

客服电话 400-821-5399 网址 www.noah-fund.com

77) 珠海盈米财富管理有限公司

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

联系人 黄敏嫦

客服电话 020-89629066 网址 www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

4. 网上直销

投资者可以通过本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本基金管理人网站公告。

网址: www.yhfund.com.cn

(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 010-66210988, 010-59378888 传真 010-66210938

(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

住所及办公地址 上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人 韩炯 联系人 黎明

电话 021-31358666 传真 021-31358600

经办律师 吕红、黎明

(四) 会计师事务所及经办注册会计师

名称 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

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安永大楼（即东3办公楼）16层

法定代表人 葛明 联系人 王珊珊

电话 010-58153280; 010-58152145 传真 010-85188298

经办注册会计师 李慧民、王珊珊

十五、对招募说明书更新部分的说明

银华恒生中国企业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，更新了招募说明书更新内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
- 2、在“四、基金的投资”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容。
- 3、在“五、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效至2016年9月30日的基金投资业绩。
- 4、在“六、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。
- 5、在“十一、（六）申购金额与赎回份额的限制”中，更新了本基金办理赎回时的最低份额和赎回后的最低保有份额；
- 6、在“二十四、相关服务机构”部分，增加了部分代销机构，并更新了部分代销机构的资料。
- 7、在“二十八、其他应披露事项”部分，更新了自本基金上次更新招募说明书以来涉及本基金的重要公告。
- 8、对部分表述进行了更新。

银华基金管理股份有限公司

2016年11月23日

