

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

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

二〇一六年十二月

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 2016 年 11 月 17 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 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、27 楼、45 楼

法定代表人：白志中

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 万元的美金 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。国籍：中国。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 16 年基金行业从业经验。

王超（WANG Chao）先生，董事。国籍：中国。美国 Fordham 大学工商管理硕士。现任中国银行总行人力资源部副总经理。历任中国银行总行人力资源部经理、高级经理、主管，中银国际证券有限责任公司人力资源部总经理、董事会办公室负责人、董事会秘书等职。

宋福宁（SONG Funing）先生，董事。国籍：中国。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。

曾仲诚（Paul Tsang）先生，董事。国籍：中国。为贝莱德亚太区首席风险管理总监、董事总经理，负责领导亚太区的风险管理工作，同时担任贝莱德亚太区执行委员会成员。曾先生于 2015 年 6 月加入贝莱德。此前，他曾担任摩根士丹利亚洲首席风险管理总监，以及其亚太区执行委员会成员，带领独立的风险管理团队，专责管理摩根士丹利在亚洲各经营范围的市场、信贷及营运风险，包括机构销售及交易（股票及固定收益）、资本市场、投资银行、投资管理以及财富管理业务。曾先生过去亦曾于美林的市场风险管理团队效力九年，并曾于瑞银的利率衍生工具交易\结构部工作两年。曾先生现为中国清华大学及北京大学的风险管理客座讲师。他拥有美国威斯康辛大学麦迪逊分校工商管理学士学位，以及宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士学位。

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。国籍：中国。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，并曾为美国投资公司协会（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、副教授和金融 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。国籍：英国。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，曾任英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。现任银砾合伙人有限公司合伙人。

杜惠芬(DU huifen)女士，独立董事。国籍：中国。山西财经大学经济学学士，美国俄克拉荷马州梅达斯经济学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学经济学博士。现任中央财经大学金融学院教授，兼任新时代信托股份有限公司独立董事。曾任山西财经大学计统系讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院(筹)教授、副院长、中央财经大学金融学院副院长等职。

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15年证券从业年限，12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。

杨军(YANG Jun)先生，副执行总裁。国籍：中国。统计学硕士。曾任中国银行总行金融市场总部主管。2012年加入中银基金管理有限公司，曾任资深投资经理。

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9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(ZHOU Xiaodan)先生，2012年5月至2015年6月担任本基金基金经理。

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(副执行总裁)、奚鹏洲(固定收益投资部总经理)、李建(权益投资部总经理)

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。截至 2016 年 6 月 30 日，本集团总资产 5.5373 万亿元人民币，高级法下资本充足率 13.91%，权重法下资本充足率 13.90%。

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。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至 9 月末新增托管公募开放式基金 64 只，新增首发公募开放式基金托管规模 464.83 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 36.29 亿元，同比增长 30.06%，托管资产余额 9.42 万亿元，同比增长 59.41%。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”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行，该行“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

（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2016年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管215只开放式基金及其它托管资产，托管资产为9.42亿元人民币。

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

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、27楼、45楼

法定代表人：白志中

电话：（021）38834999

传真：（021）68872488

1）中银基金管理有限公司直销中心柜台

地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

客户服务电话：021-3883 4788， 400-888-5566

电子信箱：clientservice@bocim.com

联系人：周虹

2）中银基金管理有限公司电子直销平台

本公司电子直销平台包括：

中银基金官方网站（www.bocim.com）

官方微信服务号（在微信中搜索公众号“中银基金”并选择关注）

中银基金官方APP客户端（在各大手机应用商城搜索“中银基金”下载安装）

客户服务电话：021-3883 4788， 400-888-5566

电子信箱：clientservice@bocim.com

联系人：张磊

（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： 王姝

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： 李博

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： 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址： 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人： 薛峰

联系人： 刘晨、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 号楼

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.cnhbstock.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：天津市南开区滨水西道 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.bhjq.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：万士清

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：汤骏、许培菁

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

指数型证券投资基金

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。

如果出现因沪深 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

指数化投资组合采取完全复制标的指数的方法，按照个股在标的指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。完全复制方法将使用下列模型：

$$W_{i,t} = V_{i,t} / V_t$$

$$M_{i,t} = M_0 \cdot W_{i,t}$$

$$N_{i,t} = M_{i,t} / P_{i,t}$$

其中：

$W_{i,t}$ ：成份股 i 在指数中所占的权重；

$V_{i,t}$ ：成份股 i 在 t 时刻经等权重因子调整后的调整市值；

V_t ：指数中所有成份股在 t 时刻的调整市值总和；

$M_{i,t}$ ：投资在成份股 i 上的资金；

M_0 ：投资总资金；

$N_{i,t}$ ：购买成份股 i 的股票数量；

$P_{i,t}$ ：成份股 i 在 t 时刻的价格。

（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。

本基金跟踪偏离度及跟踪误差的定义及计算公式如下：

跟踪偏离度（Tracking Difference）：采用基金份额净值（NAV）增长率与业绩基准增长率之差来衡量，计算公式如下：

跟踪误差（Tracking Error）：本基金以日跟踪误差为测算指标，对投资组合进行监控与评估。采用跟踪偏离度的波动性来衡量，计算公式如下：

其中，为跟踪偏离度的样本均值。 n 为计算区间，本基金计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当天）。

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，由基金经理对最优跟踪误差的选择作出判断。

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。

1 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。

1 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

1 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，以保证基金合法合规运行。

1 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更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准；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 2016 年 12 月 16 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 2016 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	33,287,832.81	92.90
	其中：股票	33,287,832.81	92.90
2	固定收益投资	--	--
	其中：债券	--	--
	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	2,542,561.33	7.10
7	其他各项资产	2,596.10	0.01
8	合计	35,832,990.24	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

无。

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 117,976.40 0.33

B 采矿业 1,857,168.03

5.21

C 制造业 13,285,180.71 37.28

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,970,514.50 5.53

E 建筑业 1,279,700.27 3.59

F 批发和零售业 1,229,669.13 3.45

G 交通运输、仓储和邮政业 1,601,856.90 4.49

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,701,051.73 7.58

J 金融业 4,934,123.55 13.84

K 房地产业 1,662,977.17 4.67

L 租赁和商务服务业 786,577.54 2.21

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 363,271.33 1.02

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 117,081.04 0.33

R 文化、体育和娱乐业 1,046,967.10 2.94

S 综合 333,717.41 0.94

合计 33,287,832.81 93.40

2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

(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 000413 东旭光电 12,600 182,826.00 0.51

2 000839 中信国安 14,150 158,338.50 0.44

3 600068 葛洲坝 18,600 147,126.00 0.41

4 002424 贵州百灵 6,600 145,662.00 0.41

5 000651 格力电器 6,482 144,030.04 0.40

6 600188 兖州煤业 11,545 143,735.25 0.40

7 000423 东阿阿胶 2,406 143,157.00 0.40

8 601216 君正集团 29,068 141,851.84 0.40

9 600309 万华化学 6,883 141,514.48 0.40

10 600547 山东黄金 3,702 141,379.38 0.40

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

无。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五) 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

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 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

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

(十一) 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,004.22

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 502.34

5 应收申购款 1,089.54

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 2,596.10

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限的情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资股票中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十五、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预示其未来表现。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2012年5月17日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

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

2012年5月17日（基金合同生效日）至2012年12月31日 0.80% 1.07% -7.70% 1.24% 8.50% -0.17%

2013年1月1日至2013年12月31日 -1.98% 1.29% -2.95% 1.30% 0.97% -0.01%

2014年1月1日至2014年12月31日 42.51% 1.10% 41.28% 1.11% 1.23% -0.01%

2015年1月1日至2015年12月31日 16.83% 2.57% 19.53% 2.49% -2.70% 0.08%

2016年1月1日至2016年9月30日 -14.41% 1.73% -15.08% 1.74% 0.67% -0.01%

自基金成立起至2016年9月30日 40.80% 1.69% 28.46% 1.68% 12.34% 0.01%

十六、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；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的指数使用费；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、依法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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用

费。按照目前签订的指数使用许可协议的约定，指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费，E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，当季标的指数许可使用费不足 50,000 元，按照 50,000 元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月最后一个工作日前将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4、除管理费、托管费和指数许可使用费之外的基金费用，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。

（三） 不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与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。

（四） 费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

（五） 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十七、 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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，结合本基金运作的实际情况，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一） 在“重要提示”部分，对招募说明书所载内容的截止日进行更新；

（二） 在“基金管理人”部分，对董事会成员、管理层成员、基金经理、投资决策委员会成员的姓名及职务的信息进行了更新；

（三） 在“基金托管人”部分，对基金托管人概况、基金托管业务经营情况等部分信息进行了更新；

（四） 在“相关服务机构”部分，对基金份额发售机构的相关信息进行了更新；

（五） 在“投资组合报告”部分，根据《信息披露内容与格式准则第 5 号》及《基金合同》，披露了本基金最近一期投资组合报告的内容；

（六） 在“基金的业绩”部分，披露了基金自合同生效日以来的投资业绩；

（七） 在“其他事项”部分，列明了前次招募说明书公布以来的其他应披露事项。

中银基金管理有限公司

2016 年 12 月 30 日