

前海开源中证军工指数型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2016 年第 2 号)

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

截止日：2016 年 11 月 27 日

重要提示

本基金经 2014 年 3 月 14 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2014]294 号文注册募集，基金合同已于 2014 年 5 月 27 日正式生效。

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。

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，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，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有的风险及其他风险等。

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表现的保证。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

本基金托管人交通银行股份有限公司已于 2016 年 12 月 20 日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、成立日期：2013 年 1 月 23 日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可 [2012] 1751 号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169

9、联系人：谢燕婷

10、注册资本：人民币 2 亿元

11、存续期限：持续经营

12、股权结构：开源证券股份有限公司出资 1/4、北京市中盛金期投资管理有限公司出资 1/4、北京长和世纪资产管理有限公司出资 1/4、深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资 1/4。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

龚方雄先生，荣誉董事长，宾夕法尼亚大学沃顿商学院金融经济学博士。国籍：中国香港。曾任纽约联邦储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席市场策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席。2009年9月起担任摩根大通亚太区董事总经理、中国投资银行主席。现任前海开源基金管理有限公司荣誉董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学经济学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。曾任深圳特区证券有限公司行业研究员，南方基金管理有限公司投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、自营负责人，现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理有限公司董事长。

Mr Yan Charles Wang（王岩先生），董事，学士学位，国籍：加拿大。从1993年起，曾任职加拿大美林证券，美国 Clemente Capital 董事、大中国区主管，美国纽约州立养老金另类投资部主管，美国磐石基金大中国区主管、董事总经理，美国橡树资本中国区主管、董事总经理，长安街资本合伙人，现任美国米尔斯坦中国总裁。曾是美国机构有限投资者协会（ILPA）创始会员，中国风险协会（CVCA）顾问。现任前海开源基金管理有限公司董事。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

向松祚先生，独立董事，教授，高级经济师，国籍：中国。著名经济学家、国际金融战略专家，中国人民大学博士，美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士，英国剑桥大学经济系和嘉丁管理学院访问学者。现任中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币金融机构官方论坛（OMFIF）顾问委员会副主席、世界经济论坛（World Economic Forum）国际货币体系改革分论坛咨询顾问，曾任中国农业银行首席经济学家。

申嫦娥女士，独立董事，博士，教授，博士生导师，中国注册会计师（非执业会员），国家税务总局特邀监察员（2003-2010），国籍：中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授，北京师范大学副教授、教授。

Mr Shujie Yao（姚树洁先生），独立董事，教授，国籍：英国。英国诺丁汉大学当代中国

学学院院长、教授，西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学的特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长；英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员；全英专业团体联合会副主席；《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》（英文）等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授，英国牛津大学研究员，英国朴茨茅斯大学教授、主任，英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

2、基金管理人监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师，国籍：中国。曾任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

李匆先生，联席监事会主席，上海交通大学工商管理博士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，中国注册会计师，国籍：中国香港。曾任职华银国际信托投资公司上海证券营业部、华安基金管理有限公司基金经理、香港亨茂投资集团基金经理、韩国未来资产环球投资(香港)有限公司高级基金经理、中国股票投资部主管、公司首席投资官兼亚太区投资部主管、公司投资委员会主席。现任香港泽源资本创始人、投资总监，前海开源基金管理有限公司联席监事会主席。

张学玲女士，监事，会计师，国籍：中国。历任武汉大学财务部副部长。

任福利先生，监事，大学本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、泰达宏利基金管理有限公司基金运营部、方正富邦基金管理有限公司基金运营部，现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。

刘彤女士，监事，硕士研究生，国籍：中国。曾任职汉唐证券有限责任公司人力资源经理、海王生物股份有限公司人事行政经理、顺丰速运集团员工关系总监、英大证券有限责任公司人力资源部主管及银泰证券有限责任公司人力运营总监、总裁助理，现任前海开源基金管理有限公司人力资源部执行总监。

3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理有限公司董事长。

李志祥先生，首席运营官，本科学历，经济师，国籍：中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长，深圳市农产品股份有限公司秘书科科长，大鹏证券有限责任公司业务秘书，南方基金管理有限公司高级经理，前海开源基金管理有限公司督察长。现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、董事会秘书、前海开源资产管理有限公司董事。

傅成斌先生，督察长，硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、风险控制委员会主席。

4、本基金基金经理

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、

高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命 4.0 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。薛小波先生具备基金从业资格。

柯海东先生，中山大学财务学硕士，华中科技大学工学学士，武汉大学管理学双学士，6 年证券从业经历。历任中国中投证券研究总部食品饮料行业分析师，国泰君安证券研究所食品饮料行业分析师。现任前海开源基金管理有限公司投资副总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。柯海东先生具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员情况

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理有限公司董事长。

王厚琼先生，工程学士，国籍：中国。历任南方证券武汉分公司证券部副经理，南方证券有限公司资产管理部副处长，南方基金管理有限公司交易管理部主管、交易管理部总监助理兼中央交易室主管、交易管理部副总监兼中央交易室主管。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资决策委员会主席。

赵雪芹女士，经济学博士研究生，国籍：中国。历任山东财经大学讲师、海通证券股份有限公司首席分析师、中信证券股份有限公司首席分析师。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、研究部行政负责人，前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深大消费主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

侯燕琳女士，工程硕士、管理学硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理、基金经理；益民基金管理有限公司投资总监、基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

刘静女士，经济学硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金经理、前海开源现金增利货币市场基金基金经理、前海开源恒泽保本混合型证券投资基金基金经理。

丁骏先生，经济学博士，国籍：中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源恒泽保本混合型证券投资基金基金经理。

罗大林先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、专户部投资经理，中信证券股份有限公司自营部高级投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。

付柏瑞先生，硕士，国籍：中国。历任华宝兴业基金管理有限公司分析师；农银汇理基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理。2009 年 4 月至 2014 年 4 月担任农

银汇理基金管理公司农银平衡双利基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

曲扬先生，博士研究生，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009年11月至2013年1月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理、前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中国稀缺资产灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源人工智能主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深龙头精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源鼎裕债券型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

徐立平先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

邱杰先生，经济学硕士，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金基金经理、前海开源再融资主题精选股票型证券投资基金基金经理、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源恒远保本混合型证券投资基金基金经理。

王霞女士，管理学硕士，注册会计师，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

孙亚超先生，数学科博士后，国籍：中国。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监；前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理、前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

谢屹先生，金融与经济数学、工程物理学硕士，国籍：德国。历任汇丰银行（德国）股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深汇鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源鼎安债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

？

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。

1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2015 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 17 位，较上年上升 2 位；根据 2015 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 190 位，较上年上升 27 位。

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 80,918.10 亿元。2016 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 525.78 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，

2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

3、基金托管业务经营情况

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 206 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

2、内部控制原则

(1) 合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

(3) 独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

(4) 制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(5) 有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

(6) 效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、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《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》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。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

(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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理

办法》和有关证券法规的规定，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。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，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)其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构

(1)前海开源基金管理有限公司直销柜台

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 1308 室

联系人：谢燕婷

电话：(0755) 83181190

传真：(0755) 83180622

(2)前海开源基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

微信公众号：qhkyfund

2、代销机构：

序号 代销机构 销售机构信息

1 中国农业银行股份有限公司 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：李紫钰

传真：(010)85109219

客服电话：95599

网址：www.abchina.com

2 中国建设银行股份有限公司 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

传真：(010)66275654

联系人：张静

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

3 交通银行股份有限公司 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

4 中国邮政储蓄银行股份有限公司 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

5 北京银行股份有限公司 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

客服电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

6 平安银行股份有限公司 平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

客服电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com>

7 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 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 1006#

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：杨懿

联系人：张燕

电话：010-58325388-1588

传真：010-58325300

客服电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

8 和讯信息科技有限公司 和讯信息科技有限公司

地址：北京朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

电话：(021)20835779

客服电话：4009-200-022

网址：www.hexun.com

9 厦门市鑫鼎盛控股有限公司 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

10 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

电话：(021)38509639

传真：(021)38509777

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

11 深圳众禄金融控股股份有限公司 深圳众禄金融控股股份有限公司

地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：(0755)33227950

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

12 上海天天基金销售有限公司 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

客服电话：4001-818-188

网址：www.1234567.com.cn

13 上海好买基金销售有限公司 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

14 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 蚂蚁（杭州）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文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：陈柏青

联系人：徐映绯

电话：(021)60897840

传真：(0571)26697013

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

15 上海长量基金销售投资顾问有限公司 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：(021)20691832

传真：(021)20691861

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

16 浙江同花顺基金销售有限公司 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

电话：(0571)88911818

传真：(0571)88910240

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

17 北京展恒基金销售股份有限公司 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

18 上海利得基金销售有限公司 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

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：沈继伟

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

客服电话：400-067-6266

网址：www.leadbank.com.cn

19 中期资产管理有限公司 中期资产管理有限公司

地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

法定代表人：朱剑林

客服电话：(010)65807609

网址：www.cifcofund.com

20 北京创金启富投资管理有限公司 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：李婷婷

客服电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

21 众升财富（北京）基金销售有限公司 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-059-8888

网址：www.zscffund.com

22 北京增财基金销售有限公司 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

客服电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

23 深圳腾元基金销售有限公司 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 单元

法定代表人：曾革

联系人：叶健

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：400-990-8600

网址：www.tenyuanfund.com

24 北京恒天明泽基金销售有限公司 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

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

法定代表人：梁越

联系人：马鹏程

电话：010-57756084

传真：010-57756199

客服电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

25 深圳前海汇联基金销售有限公司 深圳前海汇联基金销售有限公司

地址：深圳福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 4 楼

法定代表人：丁海

联系人：张誉腾

电话：(0755)32938888-6200

客服电话：(0755)36907366

网址：www.flyingfund.com.cn

26 北京汇成基金销售有限公司 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：18001102931

传真：010-62680827

客服电话:400-619-9059

网址:www.fundzone.cn

27 北京晟视天下投资管理有限公司 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

联系人：许骛

电话：010-58170859

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

28 一路财富（北京）信息科技有限公司 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客服电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

29 北京钱景财富投资管理有限公司 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158282

传真：010-57569671

客服电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

30 北京广源达信投资管理有限公司 北京广源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：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

联系人：王英俊

电话：4006236060

传真：82055860

客服电话：400-623-6060

网站：www.niuniufund.com

31 北京新浪仓石基金销售有限公司 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906

办公地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906

法定代表人：张琪

联系人：付文红

电话：010-62676405

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

32 中经北证（北京）资产管理有限公司 中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68292745

传真：010-68292964

客服电话：400-600-0030

网址：www.bzfunds.com

33 深圳市锦安基金销售有限公司 深圳市锦安基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室

办公地址：深圳市福田区益田路新世界中心 4 层

法定代表人：李学东

联系人：柯冬植

电话：0755-88914685

客服电话：400-071-9888

网址：www.ananj.cn

34 上海联泰资产管理有限公司 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

35 泰诚财富基金销售（大连）有限公司 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：李春光

电话：18640999991

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

36 上海汇付金融服务有限公司 上海汇付金融服务有限公司

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：张晶

电话：021-33323999-8318

客服电话：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

37 北京微动利投资管理有限公司 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军

电话：010-52609656

传真：010-51957430

客服电话：4008-196-665

网址：www.buyforyou.com.cn

38 深圳前海京西票号基金销售有限公司 深圳前海京西票号基金销售有限公司

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：深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场 B 座 211

法定代表人：吴永宏

联系人：张媛媛

电话：0755-66606451

客服电话：400-800-8668

网址：www.ph6.com

39 北京乐融多源投资咨询有限公司 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

联系人：付瑞华

电话：010-56580666

客服电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

40 深圳富济财富管理有限公司 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

联系人：马力佳

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

41 武汉市伯嘉基金销售有限公司 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：郭成

电话：027-87006009

传真：027-87006010

客服电话：027-87006003

网址：www.buyfunds.cn

42 上海陆金所资产管理有限公司 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：鲍东华

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

43 大泰金石投资管理有限公司 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：13917225742

传真：021-22268089

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

44 珠海盈米财富管理有限公司 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

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

45 奕丰金融服务（深圳）有限公司 奕丰金融服务（深圳）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（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

邮编 518054

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

办公电话：0755 8946 0500

传真号码：0755 2167 4453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

46 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：陈超

联系人：江卉

客服电话：95118（个人业务）、400-088-8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com/>

47 北京电盈基金销售有限公司 北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室

法定代表人：程刚

联系人：张旭

电话：010-56176118

传真：010-56176117

客服电话：400-100-3391

网址：www.dianyingfund.com

48 深圳市金斧子投资咨询有限公司 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

49 北京蛋卷基金销售有限公司 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服电话：400-0618-518

网址：danjuanapp.com

50 深圳市华融金融服务有限公司 深圳市华融金融服务有限公司

注册地址：深圳市福田区滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302

办公地址：深圳市福田区滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302

法定代表人：喻天柱

联系人：王攀峰

电话：0755-83191351

传真：0755-82945664

客服电话：400-600-0583

网址：www.hrjijin.com

51 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人：高锋
联系人：廖苑兰
电话：0755-83655588
传真：0755-83655518
客服电话：4008-048-688
网址：www.keynesasset.com

52 中国国际期货有限公司 中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层
法定代表人：王兵
联系电话：(010)59539999
传真：(010)59539806
客服电话：95162
网址：www.cifco.net

53 中信期货有限公司 中信期货有限公司
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：张磊
联系人：韩钰
电话：010-60833754
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

54 国泰君安证券股份有限公司 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
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：杨德红
联系人：朱雅崴
电话：(021)38676767
客服电话：95521
网址：www.gtja.com

55 中信建投证券股份有限公司 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
办公地址：北京市朝内大街 188 号
法定代表人：王常青
联系人：张颢
电话：(010)85156398
传真：(010)65182261
客服电话：4008-888-108
网址：www.csc108.com

56 国信证券股份有限公司 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
联系人：周杨
电话：(0755)82130833
传真：(0755)82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

57 广发证券股份有限公司 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、18、19、36、38、39、41-43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020)87555888

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

58 中信证券股份有限公司 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：顾凌

电话：(010)60838696

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

59 中国银河证券股份有限公司 中国银河证券股份有限公司

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：陈共炎

联系人：邓颜

电话：(010)66568292

传真：(010)66568990

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

60 海通证券股份有限公司 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 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

电话：(021)23219000

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

61 申万宏源证券有限公司 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：曹晔

电话：(021) 33389888

传真：(021) 33388224

电话委托：(021)962505

客服电话：95523，4008-895-523

网址：www.swhysc.com

62 安信证券股份有限公司 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 楼、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：(0755)82555551

客服电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

63 万联证券有限责任公司 万联证券有限责任公司

地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：张建军

客服电话：4008-888-133

网址：www.wlzq.com.cn

64 国元证券股份有限公司 国元证券股份有限公司

地址：安徽合肥寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

联系人：李蔡

电话：(0551)68167423

传真：(0551)68167421

客服电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

65 渤海证券股份有限公司 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：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451958

客服电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

66 华泰证券股份有限公司 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

67 山西证券股份有限公司 山西证券股份有限公司

地址：山西省太原市府西街 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

68 中信证券（山东）有限责任公司 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 1 号楼 2001
办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：(0532)85022326
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn

69 东兴证券股份有限公司 东兴证券股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
电话：(010)66555316
客服电话：4008-888-993
网址：www.dxzq.net

70 信达证券股份有限公司 信达证券股份有限公司
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
电话：(010)63080985
客服电话：95321
网址：www.cindasc.com

71 长城证券股份有限公司 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
办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：胡永君
电话：0755-83516289
传真：0755-83515567
客服电话：400-666-6888
网址：www.cgws.com

72 光大证券股份有限公司 光大证券股份有限公司
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
电话：(021)22169081
传真：(021)22169134
客服电话：95525
网址：www.ebscn.com

73 广州证券股份有限公司 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
办公地址：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
联系人：梁微
电话：(020)88836999

客服电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

74 大同证券有限责任公司 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

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：（0351）4130322

客服电话：4007-121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

75 平安证券股份有限公司 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

办公地址：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

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

76 华安证券股份有限公司 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：(0551)65161821

传真：(0551)65161672

客服电话：95318，4008-096-518

网址：www.hazq.com

77 国海证券股份有限公司 国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

电话：(0755)82047857

传真：(0755)82835785

客服电话：95563

电话委托：95563

网址：www.ghzq.com.cn

78 东莞证券股份有限公司 东莞证券股份有限公司

地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心

法定代表人：张运勇

客服电话：(0769) 961130

网址：www.dgzq.com.cn

79 申万宏源西部证券有限公司 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

办公地址：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：许建平

联系人：唐岚

电话：(010)88085258

传真：(010)88085195

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

80 中泰证券股份有限公司 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：(0531)68889155

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

81 华龙证券股份有限公司 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

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

客服电话：400-689-8888

网址：www.hlzq.com

82 中国国际金融股份有限公司 中国国际金融股份有限公司

地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27、28 层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

电话：(010)85679888-6035

传真：(010)85679535

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

83 华鑫证券有限责任公司 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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨丽娟

电话：(021)54967202

客服电话：4001-099-918，(021)32109999，(029)68918888

网址：www.cfsc.com.cn

84 中国中投证券有限责任公司 中国中投证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：(0755)82023442

客服电话：95532，4006-008-008

网址：www.china-invs.cn

85 中山证券有限责任公司 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

办公地址：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

联系人：刘军

电话：(0755)82943755

传真：(0755)82960582

客服电话：4001-022-011

网址：www.zszq.com

86 联讯证券股份有限公司 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

客服电话：95564

网址：www.lxsec.com

87 国金证券股份有限公司 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

88 爱建证券有限责任公司 爱建证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

法定代表人：钱华

联系人：王薇

电话：(021)32229888

传真：(021)68728703

客服电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

89 英大证券有限责任公司 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三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：吴尔晖

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

客服电话：400-018-8688

网址: www.ydsc.com.cn

90 华融证券股份有限公司 华融证券股份有限公司

地址: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

联系电话: (010)85556100

传真: (010)85556153

客服电话: 400-898-9999

网址: www.hrsec.com.cn

91 财达证券股份有限公司 财达证券股份有限公司

注册地址: 河北省石家庄市自强路 35 号

办公地址: 河北省石家庄市自强路 35 号庄家金融大厦 24 层

法定代表人: 翟建强

联系人: 马辉

电话: 0311-66006342

传真: 0311-66006427

客服电话: 400-612-8888

网址: www.s10000.com

92 天风证券股份有限公司 天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人: 余磊

联系人: 杨晨

电话: 027-87610052

传真: 027-87618863

客服电话: 400-800-5000

网址: www.tfzq.com

93 大通证券股份有限公司 大通证券股份有限公司

注册地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座大连期货大厦 38、39 层

办公地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座大连期货大厦 38、39 层

法定代表人: 李红光

联系人: 谢立军

电话: 0411-39991807

传真: 0411-82826601

客服电话: 4008-169-169

网址: www.daton.com.cn

94 开源证券股份有限公司 开源证券股份有限公司

注册地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

联系人: 袁伟涛

电话: (029)63387289

客服电话: 400-860-8866

网址：www.kysec.cn

95 长江证券股份有限公司 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

办公地址：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

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579

网址：www.95579.com

（二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：王兆华

联系人：任福利

电话：（0755）83180910

传真：（0755）83181121

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市君合（深圳）律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 20C

负责人：张建伟

经办律师：胡义锦、袁嘉妮

电话：（0755）25870765

传真：（0755）25870780

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

联系人：郭红霞

经办会计师：张富根、郭红霞

电话：（010）88095588

传真：（010）88091199

四、基金名称

前海开源中证军工指数型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证军工指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证军工指数的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的上市股票)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)、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或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。

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**85%**，投资于中证军工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需缴纳的交易保证金后，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，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，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。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，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，或因基金的申购和赎回等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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，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中证军工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。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的**85%**，投资于中证军工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需缴纳的交易保证金后，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。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

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。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，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**85%**，投资于中证军工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中证军工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、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不得超过 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投资，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、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（四）投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

(2) 研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果, 构建股票备选库、精选库, 对拟投资对象进行持续跟踪调研, 并提供个股、债券决策支持。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的投资战略, 设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括: 每日基金申购和赎回净现金流量; 基金合同的投资限制和比例限制; 研究员的投资建议; 基金经理的独立判断; 绩效与风险评估小组的建议等。

(4) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析, 并形成决策纪要。

(5) 根据决策纪要, 基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案, 交由交易部执行。

(6) 交易部按有关交易规则执行, 并将有关信息反馈基金经理。

(7) 基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估, 并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

(8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责, 尤其重点关注基金投资组合的风险状况; 基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(五) 业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证军工指数。

如果指数编制单位变更或停止中证军工指数的编制、发布或授权, 或中证军工指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证军工指数不宜继续作为标的指数, 或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出, 本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则, 变更本基金的标的指数。

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。

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 中证军工指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

若本基金标的指数发生变更, 基金业绩比较基准随之变更。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时, 本基金基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。本基金由于上述原因变更业绩比较基准, 无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

(六) 风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

(七) 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 85%, 投资于中证军工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%;

(2) 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;

(3) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(17) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(18) 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）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、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；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、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，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十) 基金的投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 12 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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日（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 1,059,890,799.78 93.88

其中：股票 1,059,890,799.78 93.88

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 68,634,805.77 6.08

8 其他资产 496,618.57 0.04

9 合计 1,129,022,224.12 100.00

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 986,322,559.43 87.66

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 8,325,582.60 0.74
 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 57,919,976.70 5.15
 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 7,322,681.05 0.65
 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 1,059,890,799.78 94.20

2.2 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通过沪港通机制投资港股。

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

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	601989	中国重工	15,232,518	94,441,611.60	8.39
2	600893	中航动力	1,610,031	55,240,163.61	4.91
3	000768	中航飞机	2,309,718	48,365,494.92	4.30
4	600482	中国动力	1,373,195	45,136,919.65	4.01
5	002465	海格通信	2,657,497	33,989,386.63	3.02
6	600271	航天信息	1,483,754	32,746,450.78	2.91
7	600118	中国卫星	983,955	31,319,287.65	2.78
8	600685	中船防务	1,149,831	30,780,975.87	2.74
9	000738	中航动控	973,380	25,736,167.20	2.29
10	600372	中航电子	1,343,155	25,573,671.20	2.27

4. 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。

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

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

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

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

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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没有出现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 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 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 70,853.48

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 12,398.45

5 应收申购款 413,366.64

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 496,618.57

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未持有可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 002465 海格通信 33,989,386.63 3.02 重大事项

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

?

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。

前海开源中证军工指数 A

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

2014.5.27-

2014.12.31 48.60% 1.74% 60.30% 1.87% -11.70% -0.13%

2015.1.1-

2015.12.31 36.27% 3.45% 43.14% 3.21% -6.87% 0.24%

2016.1.1-

2016.9.30 -20.00% 2.30% -21.62% 2.12% 1.62% 0.18%
2014.5.27-
2016.9.30 62.00% 2.74% 79.84% 2.59% -17.84% 0.15%

前海开源中证军工指数 C

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

2015.11.30-
2015.12.31 2.96% 1.02% -1.51% 1.26% 4.47% -0.24%
2016.1.1-
2016.9.30 -20.15% 2.30% -21.62% 2.12% 1.47% 0.18%
2015.11.30-
2016.9.30 -17.79% 2.19% -22.80% 2.04% 5.01% 0.15%

注：本基金的业绩比较基准为：中证军工指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

九、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、标的指数许可使用费；
- 4、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 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

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$

H 为每日应付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收取下限为每季度人民币 4 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

4、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 5—11 项费用”，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

- 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）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

？

十、其他应披露事项

（一）前海开源基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的从业人员在前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管公司”或“子公司”）兼任董事、监事及领薪情况如下：

本公司总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长；

本公司首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（二）2016年5月27日至2016年11月27日登载于指定报刊和本基金管理人官方网站上的公告：

2016-11-11 前海开源基金管理有限公司关于广源达信费率调整的公告

2016-11-11 前海开源基金管理有限公司关于新浪仓石费率调整的公告

2016-11-07 前海开源基金管理有限公司关于钱景财富费率调整的公告

2016-11-07 前海开源基金管理有限公司关于华融金融费率调整的公告

2016-11-04 前海开源基金管理有限公司关于降低旗下开放式基金在同花顺销售平台申购金额下限的公告

2016-10-26 前海开源中证军工指数型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016-10-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-10-19 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-09-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并开通定投和转换业务的公告

2016-09-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行费率优惠活动的公告

2016-09-09 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加华融金融为代销机构及开通定投和转换业务的公告

2016-08-29 前海开源中证军工指数型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016-08-29 前海开源中证军工指数型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016-08-29 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加北京肯特瑞为代销机构并参与其费率优惠活动的公告

2016-08-24 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加蛋卷基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-08-23 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金赎回份额下限的公告

2016-07-28 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在新浪仓石开通定投业务的公告

2016-07-28 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在中期资产开通转换业务的公告

2016-07-27 前海开源基金管理有限公司关于诺亚正行费率调整的公告
2016-07-27 前海开源基金管理有限公司关于华安证券费率调整的公告
2016-07-26 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加广源达信为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2016-07-19 前海开源中证军工指数型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告
2016-07-19 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加晟视天下为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2016-07-09 前海开源中证军工指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）
2016-07-09 前海开源中证军工指数型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）
2016-06-30 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行申购费率优惠活动的公告
2016-06-24 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2016-06-21 前海开源基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告
2016-06-21 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告
2016-06-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰证券费率优惠活动的公告
2016-06-16 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券为代销机构并开通定投业务的公告
2016-06-07 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加京西票号为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2016-06-06 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加凯恩斯基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2016-06-01 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富申购补差费率优惠活动的公告

十一、备查文件

（一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源中证军工指数型证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源中证军工指数型证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源中证军工指数型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

- 1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

？

十二、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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，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：

- 1、对“基金管理人”相关信息进行了更新。
- 2、对“基金托管人”相关信息进行了更新。
- 3、对“相关服务机构”相关信息进行了更新。
- 4、对“基金份额的申购与赎回”相关信息进行了更新。
- 5、在“基金的投资”部分，更新了“基金的投资组合报告”、“基金的业绩”相关信息。
- 6、在“其他应披露事项”部分，披露了期间涉及本基金的公告。
- 7、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一七年一月十日