

银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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 2012 年 10 月 12 日证监许可 2012【1358】号文核准募集。

本基金的基金合同生效日期：2012 年 12 月 13 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风险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。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、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。本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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，也包括基金自身的管理风险、流动性风险、技术风险、操作风险、合规风险以及本基金特有的风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过前一开放日基金总份额的百分之十时，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他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）所载内容截止日为 2016 年 12 月 13 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

注册地址 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。

公司具体经营管理由总经理负责，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、养老金投资部、FOF 投资管理部等 24 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副会长。

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

葛鹤军先生，博士学位；2008 年至 2011 年曾在中诚信证券评估有限公司、中诚信国际信用评级有限公司从事信用评级工作。2011 年 11 月加盟银华基金管理股份有限公司，主要从事债券研究工作，曾任基金经理助理，自 2014 年 10 月 8 日起担任本基金基金经理并同时兼任银华信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2014 年 10 月 8 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 2015 年 4 月 24 日起兼任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华恒利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月 17 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 5 日起兼任银华通利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 5 日起兼任银华上证 5 年期国债指数证券投资基

金，自 2016 年 12 月 5 日起兼任银华上证 10 年期国债指数证券投资基金。

本基金历任基金经理：

张翼女士，管理本基金的时间为 2012 年 12 月 13 日至 2014 年 5 月 8 日。

经惠云女士，管理本基金的时间为 2014 年 5 月 8 日至 2015 年 6 月 18 日。

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。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2016年09月30日，中国银行已托管502只证券投资基金，其中境内基金471只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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

(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

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. 代销机构

(1) 场外代销机构

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) 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

3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址 中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人 易会满

客服电话 95588 网址 www.icbc.com.cn

4) 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

5) 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

6) 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

- 7) 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
法定代表人 洪崎
客服电话 95568 网址 www.cmbc.com.cn
- 8) 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址 上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人 吉晓辉
客服电话 95528 网址 www.spdb.com.cn
- 9) 华夏银行股份有限公司
注册地址 北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人 吴建
客服电话 95577 网址 www.hxb.com.cn
- 10) 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
客服电话 95526 网址 www.bankofbeijing.com.cn
- 11) 中信银行股份有限公司
注册地址 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人 李庆萍
客服电话 95558 网址 <http://bank.ecitic.com>
- 12) 东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号
法定代表人 何沛良
网址 www.drcbank.com
- 13) 杭州银行股份有限公司
注册地址 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦
法定代表人 吴太普
客服电话 0571-96523、400-8888-508 网址 www.hzbank.com.cn
- 14) 上海农村商业银行股份有限公司
注册地址 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
法定代表人 冀光恒
客服电话 021-962999; 4006962999 网址 www.srcb.com
- 15) 上海银行股份有限公司
注册地址 上海市银城中路 168 号
法定代表人 金煜
客服电话 021-962888 网址 www.bankofshanghai.com

16) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司
注册地址 新疆乌鲁木齐市新华北路 8 号
法定代表人 农惠臣
客服电话 96518 网址 www.uccb.com.cn

17) 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

18) 大通证券股份有限公司
注册地址 辽宁省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 赵玺
客服电话 4008-169-169 网址 www.daton.com.cn

19) 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/>

20) 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

21) 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

22) 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

23) 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

24) 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

25) 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

26) 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
法定代表人 李刚
客服电话 400-860-8866 网址 www.kysec.cn

27) 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

28) 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

29) 国融证券股份有限公司
注册地址 呼和浩特市新城区锡林南路 18 号
法定代表人 张智河
客服电话 400-660-9839 网址 www.grzq.com

30) 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

31) 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

32) 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.tjm.com.cn

33) 西部证券股份有限公司

注册地址 西安市东新街 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

34) 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

35) 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

36) 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

37) 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

38) 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.cicc.com.cn

39) 中天证券股份有限公司
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

40) 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

41) 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

42) 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

43) 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

44) 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

45) 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

46) 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

47) 德邦证券股份有限公司

注册地址 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人 姚文平

客服电话 400-888-8128 网址 www.tebon.com.cn

48) 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

49) 东方证券股份有限公司

注册地址 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

法定代表人 潘鑫军

客服电话 95503 网址 www.dfzq.com.cn

50) 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 www.longone.com.cn

51) 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>

52) 方正证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层

法定代表人 雷杰

客服电话 95571 网址 www.foundersc.com

53) 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

54) 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>

55) 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

56) 国海证券股份有限公司

注册地址 广西桂林市辅星路13号

法定代表人 张雅锋

客服电话 95563 网址 www.ghzq.com.cn

57) 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

客服电话 95310 网址 www.gjqz.com.cn

58) 国盛证券有限责任公司

注册地址 江西省南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）

法定代表人 马跃进

客服电话 400-8222-111 网址 www.gszq.com

59) 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

60) 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

61) 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

法定代表人 蔡咏

客服电话 400-8888-777 网址 www.gyzq.com.cn

62) 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

客服电话 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址 www.htsec.com

63) 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

64) 华宝证券有限责任公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人 陈林

客服电话 400-820-9898 网址 www.cnhbstock.com

65) 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

66) 华林证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼

法定代表人 林立

客服电话 全国统一客服热线 400-188-3888；

全国统一电话委托号码：400-880-2888 网址 www.chinalions.com

67) 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

68) 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 网址 www.cfsc.com.cn

69) 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 王作义
客服电话 400-888-8228 网址 www.jyzq.cn

70) 南京证券股份有限公司
注册地址 江苏省南京市大钟亭 8 号
法定代表人 步国旬
客服电话 95386 网址 www.njqz.com.cn

71)) 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

72) 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

73) 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

74) 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 储晓明
客服电话 95523; 400-889-5523 网址 www.swhysc.com

75) 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
法定代表人 余磊
客服电话 028-86711410; 027-87618882 网址 www.tfzq.com

76) 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

77) 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

78) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址 西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

法定代表人 陈宏

客服电话 400-911-2233 网址 www.xzsec.com

79) 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

80) 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

客服电话 400-888-1551 网址 www.xcsc.com

81) 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

82) 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

83) 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

84) 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

85) 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/>

86) 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

87) 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

88) 民生证券股份有限公司

注册地址 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人 余政

客服电话 400-619-8888 网址 www.msizq.com

89) 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

90) 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/

91) 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

92) 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

93) 深圳众禄基金销售有限公司

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

94) 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

95) 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

96) 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

97) 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

98) 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

99) 蚂蚁（杭州）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 韩爱彬

客服电话 0571-26888888-37494 网址 www.fund123.cn

（以上排名不分先后）

（2）场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）注册登记机构

名称 中国证券登记结算有限责任公司

住所及办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人 周明 联系人 徐一文

电话 010-50938888, 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）
住所及办公地址 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人 毛鞍宁 联系人 马剑英
电话（010）58153000 传真（010）85188298
经办注册会计师 徐艳、马剑英

四、基金类型

债券型证券投资基金

五、基金的运作方式

上市契约型开放式

六、投资目标

本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。

七、投资范围

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括中证中票50指数的成份券及其备选成份券、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相关规定)。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、中央银行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、回购、次级债、资产支持证券、期限在一年以内（含一年）的银行存款，以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不投资股票（含一级市场新股申购）、权证和可转换公司债券（不含可分离交易可转债的纯债部分）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的90%，其中中证中票50债券指数成份券及其备选成份券的投资不低于本基金债券资产的80%；本基金持有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。

八、投资策略

本基金为被动式指数基金，采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构成组合，并根据本基金资产规模、日常申赎情况、市场流动性以及银行间和交易所债券特性、交易惯例等情况，进行取整和优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

当预期成份券发生调整时，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，或因市场流动性不足时，或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

在正常市场情况下，力争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

对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则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。

1、资产配置策略

为了实现紧密跟踪标的指数的投标目标，本基金将以不低于基金资产的 90%投资于债券资产，又将其中的 80%投资于指数成份券及备选成份券。

2、债券投资策略

本基金通过最优复制法进行被动式指数化投资，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可以采取适当方法对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（1）债券投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照中证中票 50 债券指数各成份券构成，并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入。当遇到成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等其他市场因素及预期标的指数的成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。当基金规模过小时，根据债券市场成交惯例，基金可能只能购买部分成份券；当基金规模过大时，受到市场流动性和法规限制等影响，基金将从备选成份券中挑选替代债券或替代组合满足跟踪需求。

（2）债券投资组合的调整

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中证中票 50 债券指数对其成份券的调整而进行相应调整。

②不定期调整

1)当成份券发行量变动，本基金将根据指数的新构成进行相应调整；

2)本基金处理日常申购赎回时，资金量可能无法按照标的指数构成交易相应成份券。本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券（或备选成份券）的流动性等因素，对债券投资组合进行动态调整；

3)若成份券遇到退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，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。

4)本基金将以一定仓位参与一二级市场套利交易、回购套利交易、个券套利交易和放大交易，以期减小基金运作的有关费用对指数跟踪的影响。

③替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求，基金管理人可构建替代组合。构建替代组合的方法如下：

1)按照与被替代债券久期、信用评级相似的原则，选择标的指数成份券和备选成份券作为备选库；

2)采用备选库中各债券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

3)考察备选券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，并使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

④债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，基金管理人将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，如“久期盯住”、“比例盯住”等。

1) 久期盯住

“久期盯住”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标，从而使得在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

2) 比例盯住

“比例盯住”具体又分为信用等级比例匹配和期限匹配两部分：

信用等级匹配主要是考虑到不同信用评级的中票收益率波动情况的不一致。考虑各信用评级中票的权重，力争基金组合各类型中票权重与标的指数分布相匹配，减少信用错配的跟踪误差。

期限匹配是考虑各个期限的中票的权重，力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配，减少期限利差变动造成的跟踪误差。

九、业绩比较基准

中证中票 50 指数*95%+银行活期存款利率（税后）*5%

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。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、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、风险收益特征

本基金属于证券市场中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。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中票市场相似的风险收益特征。

十一、投资组合报告

基金管理人银华基金管理股份有限公司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（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 679,824,700.00 97.37

其中：债券 679,824,700.00 97.37

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 2,933,658.15 0.42

8 其他资产 15,443,885.85 2.21

9 合计 698,202,244.00 100.00

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股票。

2.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 国家债券 29,997,000.00 5.03

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 10,881,700.00 1.83

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 638,946,000.00 107.23

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 679,824,700.00 114.09

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

序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 101575018 15 杭城建 MTN002 500,000 52,710,000.00 8.85

2 101552037 15 中油股 MTN002 500,000 51,775,000.00 8.69

3 101452027 14 电网 MTN002 500,000 51,220,000.00 8.60

4 101360018 13 乌城投 MTN001 400,000 42,688,000.00 7.16

5 101560062 15 芜湖建投 MTN001 400,000 41,072,000.00 6.89

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。

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 本基金本报告期末未持有股票，因此本基金不存在投资的前十名股票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（元）

1	存出保证金	28,391.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,415,119.40
5	应收申购款	349.98
6	其他应收款	25.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,443,885.85

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：本基金本报告期末未持有股票。

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，各分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、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。

（一）本基金 A 类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

自基金合同生效日（2012.12.13）至

2012.12.31 0.20% 0.04% 0.08% 0.03% 0.12% 0.01%

2013 年 -1.10% 0.10% -0.32% 0.09% -0.78% 0.01%

2014 年 7.97% 0.16% 7.98% 0.09% -0.01% 0.07%

2015 年 11.40% 0.10% 7.97% 0.05% 3.43% 0.05%

2016.1.1 至 2016.6.30 2.10% 0.09% 1.34% 0.06% 0.76% 0.03%

2016.7.1 至 2016.9.30 1.48% 0.04% 1.97% 0.04% -0.49% 0.00%

自基金合同生效日

（2012.12.13）起至

2016 年 9 月 30 日 23.50% 0.12% 20.18% 0.08% 3.32% 0.04%

（二）本基金 C 类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

准差④ ①-③ ②-④

自基金合同生效日（2012.12.13）至

2012.12.31 0.20%

0.04%

0.08%

0.03%

0.12%

0.01%

2013年 -1.30% 0.10% -0.32% 0.09% -0.98% 0.01%

2014年 7.58% 0.16% 7.98% 0.09% -0.40% 0.07%

2015年 11.18% 0.10% 7.97% 0.05% 3.21% 0.05%

2016.1.1 至 2016.6.30 1.94% 0.09% 1.34% 0.06% 0.60% 0.03%

2016.7.1 至 2016.9.30 1.49% 0.05% 1.97% 0.04% -0.48% 0.01%

自基金合同生效日

（2012.12.13）起至

2016年9月30日 22.40% 0.12% 20.18% 0.08% 2.22% 0.04%

十三、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、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、银行汇划费用；
- 8、证券账户开户费用、银行账户维护费；
- 9、基金上市初费和上市月费；
- 10、基金的指数使用许可费；
- 11、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 12、按照国家有关法律法规和基金合同规定可以列入的其他费用。

（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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、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 0.3%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

4、指数使用许可费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之一点五（1.5 个基点）的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元（5 万元），基金设立当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。

5、本条第（一）款第 3 至第 9、第 12 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（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等不列入基金费用；
- 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、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书依据《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，对本基金原更新招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，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，对基金托管人的相关业务经营情况进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，对直销机构、代销机构、注册登记机构和会计师事务所相关资料进行了更新。
- 5、在“十、基金的投资”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容。
- 6、在“十一、基金的业绩”部分，更新了截至 2016 年 9 月 30 日的基金投资业绩。
- 7、在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新了咨询服务、在线服务和电子交易与服务的相关内容。
- 8、对部分表述进行了更新。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 1 月 26 日