中银中证100指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要（2017年第2号）

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一七年十月

重要提示

本基金经中国证监会2009年7月20日证监许可[2009]651号文核准募集，基金合同于2009年9月4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。

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等。

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。

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。

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。

基金管理人保证本基金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。

本摘要所载内容截止日为2017年9月3日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日，财务数据未经审计。本基金托管人中国建设银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书中与托管业务相关的内容。

一.基金合同生效日

2009年9月4日

二.基金管理人

(一)基金管理人概况

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1650万元的美元 16.5%

(二)主要人员情况
1.董事会成员
白志中（BAIZhizhong）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（LIDaobin）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。
王超（WANGChao）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（SONGFuning）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（PaulTsang）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（JINGXin）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（ZHAOXinge）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、副教务长和金融 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（EdwardRadcliffe）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。现任银硃合伙人有限公司合伙人。

杜惠芬（DUhuifen）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

乐妮（YUENi）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。

3.管理层成员

李道滨（LIDaobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（JasonX.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-SACExecutiveProgram)毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院(IveySchoolofBusiness,WesternUniversity)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（ZHANGJiawen）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（CHENJun）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（YANGJun）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。具备基金从业资格。

4、基金经理

现任基金经理：

赵建忠（ZHAOJianzhong）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，2016 年 8 月至今任中银宏利基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银丰利基金基金经理。具有 10 年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

曾任基金经理：

吴域（WUYu）先生，2009 年 9 月至 2010 年 10 月担任本基金基金经理。

陈军（CHENJun）先生，2009 年 9 月至 2013 年 10 月担任本基金基金经理。

周小丹（ZHOUXiaodan）先生，2010 年 11 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
1．基本情况
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)67595096
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)。
资产负债稳步增长。2016 年末，本集团资产总额 20.96 万亿元，较上年增加 2.61 万亿元，增幅 14.25%，其中客户贷款总额 11.76 万亿元，较上年增加 1.27 万亿元，增幅 12.13%。负债总额 19.37 万亿元，较上年增加 2.47 万亿元，增幅 14.61%，其中客户存款总额 15.40 万亿元，较上年增加 1.73 万亿元，增幅 12.69%。
核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润 2,323.89 亿元，较上年增长 1.53%。手续费及佣金净收入 1,185.09 亿元，在营业收入中的占比较上年提升 0.83 个百分点。平均资产回报率 1.18%，加权平均净资产收益率 15.44%，净利息收益率 2.20%，成本收入比为 27.49%，资本充足率 14.94%，均居同业领先水平。
2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016 中国最佳银行，《环球金融》2016 中国最佳消费者银行、2016 亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016 年世界银行 1000 强排名中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。
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。
2．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。
龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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。
原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务

管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3．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、(R)QFII、(R)QDII、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 2017 年一季度末，中国建设银行已托管 719 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家 QFII 等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家最佳托管银行。

四.相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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：021-38834788，400-888-5566

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：021-38834788，400-888-5566

电子信箱：clientservice@bocim.com

联系人：张磊

2、基金管理人指定的其他销售机构：

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

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：陈四清

客户服务电话：95566

联系人：陈洪源

网址：www.boc.cn
2）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：易会满
客服电话：95588
联系人：王佺
公司网址：www.icbc.com.cn
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）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
6)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
7)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 9 号
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号
法定代表人：李庆萍
客户服务电话：95558
联系人：赵树林
网址：http://bank.ecitic.com
8）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
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人：李民吉
客户服务电话：95577
联系人：刘军祥
公司网站：http://www.hxb.com.cn
9）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/
10）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：宁敏
联系人：李澎
联系电话：61195566
公司网站：www.bocichina.com
11）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：杨德红
联系人：李明霞
客服电话：95521
公司网站：www.gtja.com
12）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：薛峰
联系人：姚巍
客服电话：95525
公司网站：www.ebscn.com
13）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：詹露阳
联系人：周一涵、吴琼
客服电话：95511-8
公司网站：http://stock.pingan.com
14）华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路 357 号
法定代表人:李工
联系人:甘霖
客户电话:0551-96518

公司网站:http://www.huaans.com.cn
15）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：姜晓林
联系人：孙秋月
客服电话：（0532）96577
公司网站：http://www.zxwt.com.cn
16）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：陈共炎
联系人：徐小琴、肖克
客服电话：4008-888-888
公司网站：www.chinastock.com.cn
17）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：周杰
联系人：刘佳
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
18）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:刘闻川、胡星煜
客服电话：400-820-9898
公司网站：www.cnhbstock.com
19）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
20）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼
法定代表人：孙树明
联系人：吴韵琪
客服电话：95575 或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn
21）长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人:尤习贵
联系人:陈娟
客服电话:4008-888-999
公司网址:www.95579.com
22）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京安立路 66 号 4 号楼
法定代表人：王常青
联系人：刘芸
客服电话：4008-888-108
公司网站：http://www.csc108.com/
23）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：王连志
联系人：郑效义、杨天枝
客服电话：4008001001
公司网址：www.essence.com.cn
24）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：李红
客服电话：95578
公司网址：www.gyzq.com.cn
25）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：赵俊
联系人：王一彦
客服电话：95531；400-8888-588
公司网址：http://www.longone.com.cn/
26）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：张佑军
联系人：汤迅、侯艳红
联系电话：95558
公司网站：www.cs.ecitic.com
27）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：黄婵君、罗苑峰
客服电话：95565
公司网站：www.newone.com.cn

28）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:蒋刻真
客服电话:010-66045678
公司网站:http://www.txsec.com 或 www.jjm.com.cn
29）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人：丁学东
联系人：罗春蓉、肖婷
联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部
公司网站：http://www.cicc.com.cn
30）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：张志刚
联系人：唐静
客服电话：400-800-8899
公司网站：http://www.cindasc.com
31）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
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人：黄金琳
联系人：林晓东、王虹
客服电话：96326（福建省外加拨 0591）
公司网站：www.hfzq.com.cn
32）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：张丽、李颖
客服电话：95536
公司网站：http://www.guosen.com.cn
33）华泰证券股份有限公司
办公地址：南京市中山东路 90 号
法定代表人：周易
联系人：盛芸
客服电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn
34）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：天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人：王春峰

联系人：张彤
客服电话：4006515988
公司网站：http://www.bhzq.com
35）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北武汉东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼
办公地址：湖北武汉江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座
法定代表人：余磊
联系人：翟璟
客服电话：028-86712334
公司网站：www.tfzq.com
36）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：王少华
联系人：李航
客服电话：4008188118
公司网站：www.guodu.com
（37）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
法定代表人：胡学勤
联系人：宁博宇
客户服务电话：4008219031
公司网址：www.lufunds.com
38）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦
法定代表人：其实
客户服务电话：95021/4001818188
联系人：唐湘怡
网址：http://fund.eastmoney.com/
39）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
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
法定代表人：陈柏青
客户服务电话：4000-766-123
联系人：韩爱彬
网址：www.fund123.cn
40）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室
法定代表人：杨文斌
联系人：刘芸、许梦园
客服电话：王诗玙
公司网站：www.ehowbuy.com

3、场内销售机构

场内销售机构是指具有中国证监会认定的开放式基金销售资格，符合深圳证券交易所（以下简称深交所）有关规定并经本基金管理人认可的，可通过深交所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深交所会员单位（具体名单请参见深交所相关文件）。场内销售机构的相关信息同时通过深圳证券交易所网站（www.szse.cn）登载。

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）基金份额注册登记机构

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

律师事务所名称：北京市金杜律师事务所上海分所

住所：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层

办公地址：上海市淮海中路 1045 号淮海国际广场 28-30 楼

负责人：王玲

经办律师：靳庆军、黄晓黎

电话：021-24126000

传真：021-24126150

联系人：黄晓黎

(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

中银中证 100 指数增强型证券投资基金

六.基金的类型

股票指数增强型基金

七.基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对中证 100 指数的有效跟踪并力争实现超越，谋求基金资产的长期增值。

八.基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括中证 100 指数成分股及其备选成分股、新股（一级市场首次发行或增发）、债券（国债、金融债、企业债、可转债等债券资产）、权证，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，投资于标的指数－中证 100 成分股、备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

九.标的指数

本基金标的指数为中证 100 指数。

如果中证 100 指数被停止编制及发布，或中证 100 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中证 100 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他代表性更强、更合适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，在充分考虑持有人利益的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象；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。

本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象，需履行适当程序，并在中国证监会指定的媒体上公告。

十.投资策略

（一）投资策略

本基金采用指数化投资作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离业绩比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1.资产配置策略

为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于中证 100 指数成分股、备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金将采用完全复制为主，增强投资为辅的方式，按标的指数的成份股权重构建被动组合，通过加入增强型的积极手段，对基金投资组合进行适当调整，以保证本基金投资目标的实现。

2.股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下的方法，依靠公司宏观、中观以及微观研究，优先在中证 100 指数成份股中对行业、个股进行超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数中证 100 指数成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

(1)构建被动投资组合

本基金在建仓期内，将按照中证 100 指数各成分股的基准权重对其逐步买入，在控制好跟踪误差的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重购买某成份股、预期标的指数的成份股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，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小被动组合相对标的指数的跟踪误差。

(2)构建增强型投资组合

1)基于成分股的增强性投资

在被动投资组合采用完全复制法复制标的指数的基础上，本基金管理人将通过判断当前国内外宏观经济形势、所处经济周期的阶段，分析经济周期各个阶段不同行业表现的差异以及当前各个行业景气度水平和估值水平，并采用数量化分析与基本面研究相结合的方法，在重点研究的标的指数成份股中选择业绩增长明确、价值被市场低估的品种进行行业和个股的增强性配置。

2)基于非成分股的增强性投资

替代部分无法投资的标的指数成份股

标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被列入本公司禁止投资股票等因素，导致本基金无法投资该成份股。本基金将首选与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代；若成份股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

前瞻性纳入部分备选成份股

若明确预期标的指数成份股将发生调整，本基金将综合考虑跟踪误差、流动性冲击等因素，在某个限定的时间内，严格按照事先设定的交易计划对相关成份股进行替换。

主动投资潜力较大的非成份股

本基金将依托于公司投研团队自下而上的研究成果，精选数量较少的成份股之外的股票作为增强股票库，在最有把握的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。

3.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。

4.投资组合调整策略

（1）投资组合调整原则

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、新股增发因素等变化，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间的跟踪误差最优化。

（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中证 100 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

定期调整

根据中证指数公司按照既定指数编制方法公布的中证 100 指数成分股定期调整结果，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

不定期调整

根据指数编制规则，当中证 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司发布的临时调整公告，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

2）限制性调整

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，以保证基金合法规范运行。

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。

5、跟踪误差控制策略

本基金为控制投资组合相对标的指数的偏离，以跟踪误差为指标，控制基金相对标的指数的偏离风险。

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。其中：

跟踪误差=，其中

＝第 i 日基金份额净值收益率－第 i 日业绩比较基准；

，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）。

将日跟踪误差的最大容忍值设定为 0.5%（相应折算的年跟踪误差约为 7.75%），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 0.5%，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，具体变化将另行公告。

（二）投资决策依据和程序

1.投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和本基金基金合同等的相关规定；

(2)宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；

(3)标的指数的编制方法及其变更。

2.投资决策机制

本基金管理人实行的投资决策机制是：在投资决策委员会授权范围内，投资总监领导下的基金经理负责制。

(1)投资决策委员会：定期召开会议，负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金经理提出的指数基金建仓方案、维护方案及指数调整期投资组合调整方案；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。如遇重大事项，投资决策委员会可召开临时会议做出决策。

(2)基金经理：负责指数基金投资组合的计划、实施、跟踪、调整和日常管理，负责增强性投资的个股选择等。

3.投资决策程序

(1)研究支持：数量分析小组利用数量模型和风险监测模型，对总体累积偏差、行业偏差以及日跟踪误差进行测算，提供研究报告；基金经理和分析员从基本面对行业、个股和市场走势提出研究报告；基金运营部提供基金申购、赎回的动态情况，供基金经理参考；

(2)投资决策：投资决策委员会依据上述研究报告，定期（月）或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。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)组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股权重的方法构建被动组合，并在控制跟踪误差的前提下，通过增强型投资方法对投资组合进行适当的主动调整；

(4)交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责；

(5)投资绩效评估：数量分析小组定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合；

(6)组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，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以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

（三）投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)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％；

(2)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％；

(3)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％；

(4)本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，投资于标的指数－中证 100 成分股、备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%；

(5)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％；

(6)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％；

(7)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%；

(8)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%；
(9)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；
(10)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；
(11)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％；
(12)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。
如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
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，法律法规另有规定的从其规定。
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基金合同生效之日起开始。
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)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，但是国务院另有规定的除外；
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
(7)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；
(8)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
十一.业绩比较基准
本基金业绩比较基准为：中证 100 指数收益率 90%+银行同业存款利率 10%。
中证 100 指数具有市场代表性好、历史业绩表现突出、编制规则透明度高、成份股数目适合跟踪、流动性强、市场认知程度高、指数运作体系完备、未来创新潜力较大等综合优势，本基金管理人认为中证 100 指数满足本基金标的指数的要求。
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的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。
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、债券型基金及货币市场基金。
十三.基金管理人代表基金份额持有人利益行使证券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、有利于基金财产的安全与增值；
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。
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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 9 月 11 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 2017 年 6 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 297,427,289.09 91.79

其中：股票 297,427,289.09 91.79

2 固定收益投资 10,251,703.50 3.16

其中：债券 10,251,703.50 3.16

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 15,530,423.18 4.79

7 其他各项资产 829,253.06 0.26

8 合计 324,038,668.83 100.00

（二）期末按行业分类的股票投资组合

1.积极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 306,118.38 0.09

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 717,520.82 0.22

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 1,023,639.20 0.32

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 - -

B 采矿业 8,732,905.82

2.70

C 制造业 88,269,070.48 27.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 8,847,874.18 2.74

E 建筑业 15,371,114.73 4.76

F 批发和零售业 1,827,495.00 0.57

G 交通运输、仓储和邮政业 6,245,475.53 1.93

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 7,512,007.72 2.32

J 金融业 139,938,211.71 43.30

K 房地产业 16,440,981.94 5.09

L 租赁和商务服务业 733,408.00 0.23

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 1,440,219.78 0.45

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 1,044,885.00 0.32

S 综合 - -

合计 296,403,649.89 91.71

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港股通投资股票。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 601318 中国平安 472,224 23,427,032.64 7.25

2 600036 招商银行 449,618 10,750,366.38 3.33

3 600519 贵州茅台 21,901 10,333,986.85 3.20

4 601166 兴业银行 543,310 9,160,206.60 2.83

5 000651 格力电器 209,810 8,637,877.70 2.67

6 601328 交通银行 1,380,975 8,506,806.00 2.63

7 000333 美的集团 197,341 8,493,556.64 2.63

8 600016 民生银行 1,030,713 8,472,460.86 2.62

9 000002 万科 A 296,807 7,411,270.79 2.29

10 601288 农业银行 1,990,638 7,007,045.76 2.17

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

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 600959 江苏有线 67,160.00 709,881.20 0.22

2 603801 志邦股份 1,406.00 47,522.80 0.01
3 603043 广州酒家 1,810.00 45,738.70 0.01
4 300666 江丰电子 2,276.00 43,448.84 0.01
5 603335 迪生力 2,230.00 24,864.50 0.01

（四）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 - -
2 央行票据 - -
3 金融债券 9,957,000.00 3.08
其中：政策性金融债 9,957,000.00 3.08
4 企业债券 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 - -
7 可转债 294,703.50 0.09
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 10,251,703.50 3.17

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 170204 17 国开 04 100,000 9,957,000.00 3.08
2 127004 模塑转债 2,550 294,703.50 0.09

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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
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持有股指期货。
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
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。
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。
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
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。
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。
3、其他各项资产构成
序号 名称 金额（元）
1 存出保证金 9,113.35
2 应收证券清算款 214,205.57
3 应收股利 -
4 应收利息 99,609.57
5 应收申购款 506,324.57
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 829,253.06

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。
5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。
（2）期末积极投资前五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 600959 江苏有线 709,881.20 0.22 重大事项停牌

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2009年9月4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 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 - -
2009年9月4日（基金合同生效日）至2009年12月31日 4.80% 1.13% 13.76% 1.56% -8.96% -0.43%
2010年1月1日至2010年12月31日 -17.79% 1.47% -17.24% 1.42% -0.55% 0.05%
2011年1月1日至2011年12月31日 -19.70% 1.20% -18.80% 1.14% -0.90% 0.06%
2012年1月1日至2012年12月31日 11.24% 1.13% 9.90% 1.10% 1.34% 0.03%
2013年1月1日至2013年12月31日 -10.63% 1.36% -11.62% 1.31% 0.99% 0.05%
2014年1月1日至2014年12月31日 51.54% 1.22% 52.75% 1.20% -1.21% 0.02%
2015年1月1日至2015年12月31日 0.68% 2.36% -0.62% 2.22% 1.30% 0.14%
2016年1月1日至2016年12月31日 -1.64% 1.21% -6.54% 1.13% 4.90% 0.08%
2017年1月1日至2017年6月30日 17.22% 0.53% 13.58% 0.53% 3.64% 0.00%
自基金合同生效起至2017年6月30日 21.00% 1.42% 19.65% 1.38% 1.35% 0.04%

十六.基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、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）基金财产拨划支付的银行费用；

（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）与基金使用相关指数有关的费用；

（9）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

（10）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

3、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 1.0%年费率计提。计算方法如下：

H＝E 年管理费率当年天数

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 年托管费率当年天数

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

（3）基金指数使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；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 0.016%年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

H=E0.016％/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）

如果基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用基点费的下限，则该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。

（4）除管理费和托管费之外的基金费用，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。

4、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。

5、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。

（二）与基金销售有关的费用

申购费率 申购金额 申购费率

小于 100 万元 1.5%

100 万元（含）-200 万元 1.2%

200 万元（含）-500 万元 0.6%

大于 500 万元（含） 1000 元

场外赎回费率 持有期限 赎回费率

1 年以内 0.5%

1 年（含）-2 年以内 0.25%

2 年（含）以上 0

场内赎回费率 不区分持有期限 0.5%

注 1：就场外赎回费率的计算而言，1 年指 365 日，2 年 730 日，以此类推。

注 2：上述持有期是指在注册登记系统内，投资者持有基金份额的连续期限。

1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、基金管理人可以在基金合同的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 2 个工作日前在指定报刊和网站上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

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、监事、管理层成员的信息进行了更新；

(三)在基金托管人部分，对基金托管人信息进行了更新；

(四)在相关服务机构部分，对基金份额销售机构的信息进行了更新；

(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以来的投资业绩；

(七)在其他应披露事项部分，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

2017 年 10 月 17 日