

# 中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人： 中银基金管理有限公司

基金托管人： 招商银行股份有限公司

二〇一七年七月

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  
金 更新招募说明书摘要

## 重要提示

本基金经 2012 年 12 月 26 日中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1743 号文核  
准

募集，基金合同于 2013 年 3 月 19 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  
本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金招募说明书，全面认识本  
基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，本基金投资于境外证券市  
场，

基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下三类，

一是境外投资风险，包括海外市场风险、汇率风险、政治风险、税务风险等；二是开放式  
基

金一般风险，包括流动性风险、管理风险、会计核算风险、信用风险、法律风险、衍生品  
风

险等；三是本基金特有的风险。 本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合型  
基

金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的  
表

现，具有与标的指数、以及与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金力  
求

通过完全复制法以较低成本实现对标普全球精选自然资源等权重指数的紧密跟踪，在中长  
期

通胀预期升温的背景下，为投资者提供理想的抗通胀和分散单一市场、单一货币汇率波动  
风

险的投资工具。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、

时机、数量等投资行为作出独立决策。

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也不构成对本  
基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作  
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，由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基

金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认

和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。  
基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断

或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要  
日为 2016 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商银行股份有限公司已复

核了本次更新的招募说明书。

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

#### 一、 基金合同生效日

2013 年 3 月 19 日

#### 二、 基金的名称

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金（QDII）

#### 三、 基金的类型

股票型基金

#### 四、 基金的投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现对标普全球自然资源等权重指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。本基金控制目标为基金净值收益率

与标的指数收益率之间的年跟踪误差不超过 5%。

#### 五、 基金的投资范围

本基金主要投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股（包括股票和/或存托凭证，下同）、备选成份股，与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基

金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍生产品等，固定收益类证券、银行存款、现

金等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产品或金融工具，但须

符合中国证监会的相关规定。

本基金投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股、备选成份股以及与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产

品及金融衍生产品的比例为基金资产的 80%—95%，其中投资于与标普全球精选自然资源等

权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍

生

产品的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监

会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%—20%，其中投资于现金或者到期日

在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。在保证流动性的前提下，本基金

现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  
金 更新招募说明书摘要  
货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，

基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制，不需经基金份额持有人大会审议。

本基金管理人自《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上述相关规定。

## 六、 基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标普全球精选自然资源等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股

及其权重的变化进行相应调整，达到有效跟踪标的指数的目的。但在因特殊情况（如股票停

牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进

行适当的替代。

本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金以及结构性产品，以优化投资组合的构建，达到节约交易成本

和有效追踪标的指数表现的目的。

本基金在投资过程中，由于必须保有一定比例的现金资产，导致在市场上涨的过程中，基金投资组合的表现可能会落后于标的指数的表现。另外，基金投资组合权重与标的指数成

份股权重的不一致、股票买卖价格与股票收盘价的差异、指数成份股构成调整与指数成份股

权重调整所产生的交易费用、基金运作过程中的各项费用与开支都会使基金投资组合产生跟

踪误差。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪误差的控制提供量化决策依据。在正常情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过

0.5%，年化跟踪误差不超过 5%（以美元资产计价）。

未来，随着跟踪标普全球精选自然资源等权重指数投资工具的增加，本基金可相应调整

和更新相关投资策略，并在《招募说明书》更新中公告。

本基金的跟踪偏离度及跟踪误差的定义及计算公式如下：

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

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

1.1

t<sub>1</sub>

t<sub>2</sub>

t<sub>3</sub>

t<sub>4</sub>

NAV<sub>1</sub>

NAV<sub>2</sub>

TD

业绩比较基准

业绩比较基准

跟踪误差（Tracking Error）：采用跟踪偏离度的波动性来衡量，计算公式如下：

1

) (

1

2

n

TD<sub>1</sub> TD<sub>2</sub>

TE

n

t<sub>1</sub>

t<sub>2</sub>

t<sub>3</sub>

其中，

TD

为跟踪偏离度

t

TD

的样本均值。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

本基金对于标普全球精选自然资源等权重指数成份股和备选成份股的投资，根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的

变动进行相应调整。

## 1. 投资组合的构建

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1) 确定目标组合：基金管理人根据完全复制法确定目标组合。

2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

3) 逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数的要求。

本基金将在《基金合同》生效之日起 6 个月的时间内达到规定的投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回等因素导致基金不符合规定投资比例的，基金管理人

将在合理的期限内进行调整。

## 2. 投资组合的管理

### 1) 每日投资组合管理

#### (1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司行为（如：增发、配股、拆股、缩股、分红、停牌、复牌、暂停交易等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组

合调整分析，为投资决策提供依据。

#### (2) 标的指数的跟踪与分析

跟踪分析标的指数的调整等变化，确定标的指数的变化是否与预期相一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理人更新招募说明书摘要

#### (3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析

根据本基金每日申购和赎回的信息，分析由此对组合产生的系列影响。

#### (4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析

基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

#### (5) 组合调整：

① 利用数量化分析模型，确定将实际组合调整到目标组合的最优方案和组合交易计划。

② 如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，及时提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。

③ 调整组合，达到目标组合的持仓结构。

### 2) 定期投资组合管理

(1) 每月末，根据《基金合同》中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

(2) 每月末，在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合跟踪偏离度情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

(3) 每月末，投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

### 3) 投资组合调整

#### (1) 投资组合调整原则

本基金为指数型基金，基金所构建的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、申购赎回变动情况等变

化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

**(2) 成份股构成的调整**

每年，根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并制定投资组合调整策略，尽量减少因成份股构成变动带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

**(3) 成份股权重的调整**

根据指数编制规则，标普全球精选自然资源等权重指数每季度对成份股的权重进行调整，使每一个指数成份股的权重重新回至 1%。本基金将根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股权重变动公告，及时进行相应调整。当标普全球精选自然资源等权重指数成份股因增发、

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要  
送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股公司的股权变动公告及时计算需要调整的权重比例，并适时进行相应调整。  
调整期间原则上定为：对于每季度成份股权重的定期调整，在调整日之前的 5 个交易日与之后的 5 个交易日内完成。对于因公司行为进行成份股调整时，在标普全球精选自然资源等权重指数调整决定公布日起至该股票除权日后的 5 个交易日内进行调整。

**(4) 其它调整**

**① 限制性调整**

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。

**② 大额赎回调整**

由于本基金开放式基金的特点，当大额赎回超过最高现金保有比例 5%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。

**3. 金融衍生产品投资策略**

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。本基金金融衍生品投资主要遵循以下原则：

- 1) 利用金融衍生产品的跨市场交易的特点，减少因为限制投资、交易假期和时差对跟踪指数的拖累；
- 2) 利用金融衍生产品的杠杆作用，减少现金头寸或者某些成份股的交易流动性可能带来的跟踪误差；
- 3) 利用金融衍生产品来对冲一些外汇市场汇率波动造成的跟踪误差；
- 4) 适当利用金融衍生品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用。

本基金对金融衍生产品的投资将严格遵守法律法规及监管机构的相关规定。

**七、 基金的业绩比较基准**

本基金的标的指数为标普全球精选自然资源等权重指数（NTR）（S&P Global Resources中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要Select Equal Weighted Index）。

1

本基金业绩比较基准：人民币计价的标普全球精选自然资源等权重指数（NTR）收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。

如果指数编制机构变更或停止标普全球精选自然资源等权重指数的编制及发布、或停止对本基金的指数使用授权、或标普全球精选自然资源等权重指数由其他指数替代、或由于指

数编制方法发生重大变更等原因导致标普全球精选自然资源等权重指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投

资者合法权益的原则，变更基金的标的指数。

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，在报中国证监会备案后及时公告。

#### 八、 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及

与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### 九、 基金投资组合报告

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。

本基金托管人招商银行根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 4 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

1

标普道琼斯指数公司（以下简称“标普”）或其第三方许可人并未赞助、担保、出售或推广本基金。标普或

其第三方许可人均未就标普全球精选自然资源等权重指数或其成分股的投资可行性，向本基金的投资者或任

何公众成员作出明示或默示的声明或保证。标普与其第三方许可人同本基金管理人唯一的关联是授权其使用

标普与第三方许可人的商标与商号，以及授权其使用标普或其第三方许可人在未考虑本基金的情况下而确定、

编辑并计算的指数。标普与其第三方许可人在确定、编辑并计算指数的过程中，并无义务考虑本基金投资者

的需求。标普与其第三方许可人均不负责且从未参与确定本基金的价格、数量及本基金发行或出售的时间安

排，也不承担关于本基金管理、营销或交易的责任或义务。

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 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 42,257,263.49 86.03

其中：普通股 32,534,265.17 66.23

存托凭证 9,722,998.32 19.79

优先股 -- 房地产信托 --2 基金投资 --3 固定收益投资 -- 其中：债券 -- 资产支持证券 --4

金融衍生品投资 -- 其中：远期 -- 货币 -- 期权 -- 权证 --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 货币市场工具 --7

银行存款和结算备付金合

计 5,342,521.52 10.88

8 其他各项资产 1,521,354.35 3.10

9 合计 49,121,139.36 100.00

### 2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区） 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例 (%)

美国 22,794,472.21 49.08

加拿大 7,978,675.05 17.18

英国 7,417,449.92 15.97

中国香港 2,410,284.05 5.19

澳大利亚 1,656,382.26 3.57

合计 42,257,263.49 90.98

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，此处股票包括普通股和优先  
中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  
更新招募说明书摘要  
股；

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

#### 3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例 (%)

原材料 25,848,102.45 55.65

能源 13,122,886.46 28.25

必需消费品 2,082,553.23 4.48

金融 1,203,721.35 2.59

合计 42,257,263.49 90.98

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资  
明细

序号

公司名称(英文)  
公司名称(中文)  
证券代码  
所在证券市场  
所属国家  
(地区)  
数量  
(股)  
公允价值(人民币元)  
占基金资产净值比例(%)  
1  
ROSN  
EFT  
OIL  
CO  
PJSCREG  
GDR  
俄罗斯石油公司  
ROSN  
LI  
伦敦证券交易所  
英国 11,364  
512,408.  
44  
1.10  
2

ENI  
SPA-S  
PONS  
ORED  
ADR  
埃尼集  
团  
E US  
纽约  
证券  
交易  
所  
美国 2,244  
501,868.  
09  
1.08  
3  
LUKOI  
L  
PJSC-S  
PON  
卢克石  
油公司  
LKOD  
LI  
伦敦  
证券  
交易  
所  
英国 1,229  
478,284.  
65  
1.03  
中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  
金 更新招募说明书摘要  
ADR  
4  
PHOS  
AGRO  
OAOGDR  
REG S  
PhosAg  
ro 公开  
合股公  
司

PHOR  
LI  
伦敦  
证券  
交易  
所  
英国 4,511  
477,215.

31  
1.03

5  
FIBRI

A  
CELU  
LOSE  
SA-SP  
ON  
ADR

Fibria  
Celulos  
e 公司

FBR  
US  
纽约  
证券  
交易  
所  
美国 7,109  
473,918.

43  
1.02

6  
ELDO

RADO  
GOLD

CORP  
埃尔拉  
多黄金  
公司

ELD  
CN  
多伦  
多证  
券交

易所

加拿大 21,320

473,461.

60

1.02

7

CAME

CO

CORP

Cameco

公司

CCO

CN

多伦

多证

券交

易所

加拿大 6,529

471,224.

20

1.01

8

NOVA

TEK

PJSC-S

PONS

GDR

REG S

诺瓦泰

克公司

NVTK

LI

伦敦

证券

交易

所

英国 521

469,120.

17

1.01

9

BP

PLC

碧辟公

司  
BP/  
LN  
伦敦  
证券  
交易  
所  
英国 10,542

457,142.

24

0.98

10

KAPS

TONE

PAPER

AND

PACK

AGIN

G

KapSto

ne 纸业

包装公  
司

KS US

纽约

证券

交易

所

美国 2,983

456,282.

22

0.98

4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  更新招募说明书摘要

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8. 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细  
本基金本报告期末未持有基金。

#### 10. 投资组合报告附注

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

10.2 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。

#### 10.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -2 应收证券清算款 -3 应收股利 74,853.67

4 应收利息 790.19

5 应收申购款 404,657.83

6 其他应收款 1,041,052.66

7 待摊费用 -8 其他 -

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理人更新招募说明书摘要

9 合计 1,521,354.35

#### 10.4 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。

#### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1 报告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中不存在流通受限情况

10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

#### 10.6 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、 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 2013 年 3 月 19 日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

阶段

净值增长

率①

净值增长率

标准差②

业绩比较基

准收益率③

业绩比较基

准收益率标

准差④

①-③ ②-④

自基金合同生效起至

2013 年 12 月 31 日

-0.10% 0.67% -8.67% 1.01% 8.57% -0.34%

2014 年 1 月 1 日至 2014

年 12 月 31 日

-12.31% 0.80% -8.32% 0.86% -3.99% -0.06%

2015 年 1 月 1 日至 2015

年 12 月 31 日

-23.51% 1.45% -22.67% 1.52% -0.84% -0.07%

2016 年 1 月 1 日至 2016

年 12 月 31 日

47.98% 1.35% 58.55% 1.46% -10.57% -0.11%

自基金合同生效起至

2016 年 12 月 31 日

-1.30% 1.15% 2.65% 1.26% -3.95% -0.11%

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

## 十一、 基金的费用概览

### (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，含境外托管人的托管费;
- 3) 基金合同生效以后的标的指数许可使用费与指数数据费;
- 4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用）；
- 5) 《基金合同》生效以后的信息披露费用;
- 6) 基金份额持有人大会费用;
- 7) 基金收益分配过程中发生的费用;
- 8) 为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用;
- 9) 《基金合同》生效以后的会计师费、律师费和税务顾问费;
- 10) 基金的资金汇划费用和外汇兑换交易的相关费用;
- 11) 除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用;
- 12) 基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及  
相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等;
- 13) 为了基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用;
- 14) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

#### 2、 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

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

$E$  为前一日基金资产净值

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。在首期支付

基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。如需要变更

更收款账户，基金管理人应提前 10 个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。

## 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 0.30% 年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

## 3) 标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人签署的指数使用许可协议的约定向指数公司支付指数许可使用费。指数许可使用费自本基金合同生效之日起开始计提，按前一日基金资产

净值的 0.06% 年费率计提，且指数许可使用费收取下限为每年 3 万美元，即若不足 3 万

美元则按照 3 万美元收取。计算方法如下：

$$H = E \times 0.06\% \div \text{当年天数}$$

$H$  为每日应计提的指数许可使用费

$E$  为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计提，逐日累计。基金合同生效日起及其后的 12 个月为第一个指数许可使用费的支付周期，依此类推。基金管理人将于基金合同生效日支付首个支付周期

期的指数许可使用费下限（3 万美元），在首个支付周期到期后，若根据上述公式计提的指

数许可使用费大于 3 万美元，基金管理人在 30 天内向基金托管人发送指数许可使用费划款

指令，将超出部分的指数许可使用费支付给指数所有人。以后各个支付周期的指数许可使

用

费支付方法依此类推。

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

此项调整无需召开基金份额持有人大会。

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。在首期支付

基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。如需要变更

更收款账户，基金管理人应提前 10 个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。

4) 本条第（一）款第 4 至第 14 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律法规及

相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

### 3、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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。

### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非《基金合同》  
、  
相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有  
有  
人大会。

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

申购费用和赎回费用

申购费率

申购金额（M） 申购费率

$M < 100$  万 1.5%

$100 \leq M < 200$  万 1.2%

$200 \leq M < 500$  万 1.0%

$M \geq 500$  万 1000 元/笔

赎回费率

持有限期（天） 赎回费率

1 年以内 0.5%

1 年（含）-2 年 0.25%

2 年（含）以上 0%

注：1 年指 365 天，2 年指 730 天，以此类推。

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。

2、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。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

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

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、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

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，针对以特定交易方式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。

### (三) 其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

## 十二、 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

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（BAI Zhizhong）先生，董事长。国籍：中国。上海交通大学工商管理专业硕士，高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任，中国银行宁夏回

族自治区分行行长、党委书记，中国银行广西壮族自治区分行行长、党委书记，中国银行四

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基 金 更新招募说明书摘要

川省分行行长、党委书记，中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。

李道滨（LI Daobin）先生，董事。国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000 年 10 月至 2012 年 4 月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总

监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有 17 年基金行业从业经验。

王超（WANG Chao）先生，董事。国籍：中国。美国 Fordham 大学工商管理硕士。现任中国银行总行人力资源部副总经理。历任中国银行总行人力资源部经理、高级经理、主管，

中银国际证券有限责任公司人力资源部总经理、董事会办公室负责人、董事会秘书等职。

宋福宁（SONG Funing）先生，董事。国籍：中国。厦门大学经济学硕士，经济师。

历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副处长、资金业务部负责

人、资金业务部总经理，中国银行总行金融市场总部助理总经理，中国银行总行投资银行与

资产管理部助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部副总经理。

曾仲诚（Paul Tsang）先生，董事。国籍：中国。为贝莱德亚太区首席风险管理总监、

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

荆新（JING Xin）先生，独立董事。国籍：中国。现任中国人民大学商学院副院长、会计学教授、博士生导师、博士后合作导师，兼任财政部中国会计准则委员会咨询专家、中国会计学会理事、全国会计专业学位教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事、安泰科技股份有限公司独立董事、风神轮胎股份有限公司独立董事。曾任中国人大会计系副主任，中国人大审计处处长、中国人大商学院党委书记等职。

赵欣舸（ZHAO Xinge）先生，独立董事。国籍：中国。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会（美国共同基金业行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教务长和金融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（Edward Radcliffe）先生，独立董事。国籍：英国。法国 INSEAD 工商管理硕士。曾任白狐技术有限公司总经理，目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前，曾任英国电信集团零售部部门经理，贝特伯恩顾问公司董事、北京代表处首席代表、总经理，中英商会财务司库、英中贸易协会理事会成员。现任银砾合伙人有限公司合伙人。

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基  
杜惠芬（DU huifen）女士，独立董事。国籍：中国。山西财经大学经济学学士，美国俄克拉荷马州梅达斯经济学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学经济学博士。现任中央财经大学金融学院教授，兼任新时代信托股份有限公司独立董事。

曾任山西财经大学计统系讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院（筹）教授、副院长、中央财经大学金融学院副院长等职。

## 2. 监事

乐妮（YUE Ni）女士，职工监事。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士。曾分别就职于上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理公司。2006年7月加入

中银基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。具有16年证券从业年限，13年基金行业从业经验。

### 3. 管理层成员

李道滨（LI Daobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会-沃顿商学院高级管理培训班（Wharton-SAC Executive Program）毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院（Ivey School of Business, Western University）工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。

曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从

事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通

基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文（ZHANG Jiawen）先生，副执行总裁。国籍：中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行

行长、苏州分行副行长、党委委员。

陈军（CHEN Jun）先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

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

### 4. 基金经理

陈学林先生，中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工商管理硕士。曾任统一期货股份有限公司交易员，凯基证券投资信托股份有限公司基金经理。2010年加入中银基金管理

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理人更新招募说明书摘要

有限公司，曾担任中银全球策略（QDII-FOF）基金经理助理。2013年3月至今任中银标

普全球资源等权重指数（QDII）基金经理，2013年7月至今任中银全球策略（QDII-FOF）

基金经理。具有15年证券从业年限。具备基金从业资格。

### 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。

### 十三、 基金托管人

#### 基金托管人概况

##### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

##### 2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发

行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准

上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基 金 更新招募说明书摘要

3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2017 年 3 月 31 日，本集团总资产

产 60,006.74 亿元人民币，高级法下资本充足率 14.43%，权重法下资本充足率 12.08%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产

托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职

能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金

托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托

管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管

理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企

业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核

心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，

不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系

统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股票型私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

#### 十四、境外托管人

名称：布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）

地址：140 Broadway New York, NY 10005

法定代表人：William B. Tyree (Managing Partner)

组织形式：合伙制

存续期间：持续经营

成立于1818年的布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）是全球领先的托管银行之一。BBH自中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金管理人，更新招募说明书摘要于1928年起已经开始在美国提供托管服务。1963年，BBH开始为客户提供全球托管服务，

是首批开展全球托管业务的美国银行之一。目前全球员工约5700千人，在全球18个国家和地区设有分支机构。

BBH的惠誉长期评级为A+，短期评级为F1。

#### 十五、相关服务机构

##### （一）基金份额发售机构

###### 1、直销机构

中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼

法定代表人：白志中

电话：(021)38834999

传真：(021)68872488

###### 1) 中银基金管理有限公司直销柜台

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](mailto: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](http://www.bocim.com)）

官方微信服务号（在微信中搜索公众号“中银基金”并选择关注）

中银基金官方 APP 客户端（在各大手机应用商城搜索“中银基金”下载安装）

客户服务电话：021-3883 4788， 400-888-5566

电子信箱：[clientservice@bocim.com](mailto:clientservice@bocim.com)

联系人：张磊

2、基金管理人指定的其他销售机构

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

(1) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

联系人：宋亚平

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(2) 招商银行股份有限公司

住所：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](http://www.cmbchina.com)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 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

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

联系人：赵树林

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(5) 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](http://www.cib.com.cn)

(6) 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: 胡学勤

客户服务电话: 4008219031

联系人: 宁博宇

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(7) 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 (东方财富大厦)

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 (东方财富大厦)

法定代表人: 其实

客户服务电话: 95021/4001818188

联系人: 王超

网址: <http://fund.eastmoney.com/>

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构销售本基金, 并及时履行信息披露义务。

(二) 登记结算机构

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

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基 金 更新招募说明书摘要

传真: (010) 59378907

联系人: 任瑞新

(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: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

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

电话: (021) 31358666

传真: (021) 31358600

经办律师: 吕红、安冬

联系人: 吕红

(四) 审计基金财产的会计师事务所

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

十六、 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“基金的投资”部分，披露了基金最近一期的投资组合情况；
- 中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 更新招募说明书摘要
- (三) 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；
  - (四) 在“基金管理人”部分，对董事会成员、监事、基金经理的信息进行了更新；
  - (五) 在“基金托管人”部分，对基金托管人概况、 基金托管业务经营情况等内容进行了更新；
  - (六) 在“境外托管人”部分，对相关信息进行了更新；
  - (七) 在“相关服务机构”部分，对基金份额发售机构的相关信息进行了更新；
  - (八) 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

二〇一七年七月七日