农银汇理深证100指数增强型证券投资基金招募说明书(2016年第1号更新)摘要

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2012年3月9日证监许可【2012】302号文核准。

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券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化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,由于基金份额持有人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,某一基金的特定风险等。本基金为股票型基金,其风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。投资有风险,投资者认购(申购)基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年3月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)公司概况

名称:农银汇理基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层

办公地址:上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼

法定代表人:于进

成立日期:2008年3月18日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监许可【2008】307号

组织形式:有限责任公司

注册资本:人民币贰亿零壹元

存续期限:永久存续

联系人:翟爱东

联系电话:021-61095588

股权结构:

股东	出资额(元)	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中国铝业股份有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员:

于进先生:董事长

金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作,历任信息部副处长、处长,人事部处长、副总经理,电子银行部总经理,科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。

Bernard Carayon先生:副董事长

经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员、中央风险控制部主管,东方汇理银行和东方汇理投资银行风险控制部门主管,东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总裁。

许金超先生:董事

高级经济师、经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理部总经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

Thierry Mequillet先生:董事

工商管理硕士。1979年开始从事银行工作,在Credit Agricole Indosuez工作近15年并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司,任香港地区总经理。1999年起至今任东方汇理资产管理香港有限公司亚太区行政总裁。

谢尉志先生:董事

工商管理硕士、高级会计师。1986年开始在中国海洋石油公司工作,先后任总公司财务部、资金部总经理,中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起,任中国铝业公司总经理助理,并先后兼任中铝海外控股有限公司总裁、中铝矿业国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。

华若鸣女士:董事

高级工商管理硕士、高级经济师。1989年起在中国农业银行工作,先后任中国农业银行总行国际业务部副总经理、香港分行总经理,中国农业银行电子银行部副总经理。现任中国农业银行股份有限公司金融市场部总经理兼资金交易中心总经理、外汇交易中心总经理。

王小卒先生:独立董事

经济学博士,曾任香港城市大学助理教授、世界银行顾问、联合国顾问、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院财务金融系教授,兼任香港大学商学院名誉教授和挪威管理学院兼职教授。

傅继军先生:独立董事

经济学博士,高级经济师。1973年起,任江苏省盐城汽车运输公司教师,江苏省人民政府研究中心科员。1990年3月起任中华财务咨询公司总经理。

徐信忠先生:独立董事

金融学博士、教授,曾任英国Bank of England货币政策局金融经济学家;英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授;北京大学光华管理学院副院长、金融学教授。现任中山大学岭南(大学)学院院长、金融学教授。

2、公司监事

Jean-Yves Glain先生:监事

硕士。1995年加入东方汇理资产管理公司,历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部副负责人。现任东方汇理资产管理公司国际协调与支持部负责人。

欧小武先生:监事

1985年起在中国有色金属工业总公司、中国铜铝锌集团公司工作。2000年起历任中国铝业公司和中国铝业股份有限公司处长、财务部(审计部)主任和财务部总经理。2001年至2006年任中国铝业股份有限公司监事。现任中国铝业公司审计部主任、中国铝业股份有限公司审计部总经理。

胡思琳女士:监事

工商管理硕士。2004年起进入基金行业,先后就职于长信基金管理有限公司、富国基金管理有限公司。2007年参与农银汇理基金管理有限公司筹建工作,2008年3月公司成立后任市场部总经理。

高利民先生:监事

项目管理硕士。2002年起进入资产管理相关行业,先后就职于恒生电子股份有限公司、国联安基金管理有限公司。2007年加入农银汇理基金管理有限公司参与筹建工作,现任农银汇理基金管理有限公司运营部副总经理。

杨晓玫女士:监事

管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司,现任综合管理部人力资源经理。

3、公司高级管理人员

于进先生:董事长

金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作,历任信息部副处长、处长,人事部处长、副总经理,电子银行部总经理,科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。

许金超先生:总经理

高级经济师、经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理部总经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

施卫先生:副总经理

经济学硕士、金融理学硕士。1992年7月起任中国农业银行上海市浦东分行国际部经理、办公室主任、行长助理,2002年7月起任中国农业银行上海市分行公司业务部副总经理,2004年3月起任中国农业银行香港分行副总经理,2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监,2010年10月起任中国农业银行东京分行筹备组组长,2012年12月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

翟爱东先生:督察长

高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行《中国城乡金融报》社、国际部、伦敦代表处、银行卡部工作。2004年11月起参加农银汇理基金管理有限公司筹备工作。2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书、监察稽核部总经理,2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

宋永安先生,复旦大学数学系硕士,具有基金从业资格,8年基金从业经历。2007年起历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理沪深300指数型基金经理助理。现任农银汇理沪深300指数型基金基金经理、农银深证100指数增强型基金基金经理、农银汇理中证500指数型基金基金经理、农银汇理大盘蓝筹混合型基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成:

投资决策委员会主席许金超先生,现任农银汇理基金管理有限公司总经理;

投资决策委员会成员付炳女士,投资总监,农银汇理消费主题混合型证券投资基金基金经理、农银汇理中小盘混合型证券投资基金基金经理;

投资决策委员会成员郭世凯先生,投资部副总经理,农银汇理行业成长混合型基金基金经理、农银汇理行业轮动混合型基金基金经理、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金;

投资决策委员会成员凌晨先生,研究部副总经理,农银汇理研究精选灵活配置混合型基金基金经理、农银汇理低估值高增长混合型基金基金经理、农银汇理信息传媒主题股票型基金基金经理;

投资决策委员会成员史向明女士,固定收益部总经理,农银汇理恒久增利债券型基金基金经理、农银汇理增强收益债券型基金基金经理、农银汇理7天理财债券型基金基金经理、农银汇理主题轮动灵活配置混合型基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国光大银行股份有限公司(简称"中国光大银行")

住所:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人:唐双宁

成立时间:1992年8月18日

组织形式:股份有限公司

注册资本:404,3479亿元人民币

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【2002】75号

联系人:张建春

电话:010-63639180

传真:010-63639132

网址:www.cebbank.com

(二)主要人员情况

法定代表人唐双宁先生,历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长,中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长,中国银行监督管理委员会副主席,中国光大(集团)总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任,十一届全国政协委员,中国光大集团股份公司董事长、党委书记,中国光大集团有限公司董事长,兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记,中国光大控股有限公司董事局主席,中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生,曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任IT监图实施办公室主任、总经理,中国银行北京市分行行长、党委书记,中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员,兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾珂学先生,曾任中国光大银行办公室副总经理,中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

截至2015年12月31日,中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证100指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深300指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利宝货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金共50只证券投资基金,托管基金资产规模1,559.38亿元。同时,开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:

名称:农银汇理基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层办公地址:上海浦东新区银城路9号农银大厦50楼

法定代表人:于进

联系人:叶冰沁

联系电话:4006895599(免长途电话费),021-61095610

网址:www.abc-ca.com

2、代销机构:

(1)中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:刘士余

联系人:刘峰

客服电话:95599

网址:www.abchina.com

(2)中国光大银行股份有限公司

住所:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人:唐双宁

联系人:朱红

电话:010-63639157

传真:010-63639132

网址:www.cebbank.com

(3)中国建设银行股份有限公司

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

联系人:张静

客服电话:95533

网址:www.ccb.com

(4)交通银行股份有限公司

住所: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:牛锦铭

联系人:张宏革

客服电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)渤海银行股份有限公司

住所:天津市河西区马场道201-205号

办公地址:天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦

法定代表人:李伏安

联系人:王宏

客服电话:400-888-8811

网址:www.cbhb.com.cn

(6)东方证券股份有限公司

住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客服电话:95503

网址:www.dfzq.com.cn

(7)国泰君安证券股份有限公司

住所: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

法定代表人:万建华

联系人:丙敏祺

电话:021-38676666

传真:021-38670666

客服电话:4008888666

网址:www.gtja.com

(8)申万宏源证券有限公司

住所:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人:李梅

联系人:王序微

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客服电话:95523、4008895523

网址:www.swhysc.com

(9)国信证券股份有限公司

住所: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:齐骏燕

电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(10)海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、李笑鸣

电话:021-23219000

传真:021-63410456

客服电话:400-8888-001、95553

网址:www.htsec.com

(11)中国银河证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇

电话:010-66568430

传真:010-66568990

客服电话:400-8888-888

网址:www.chinastock.com.cn

(12)中信证券股份有限公司

住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-60833722

传真:010-60833739

客服电话:95558

网址:www.citics.com

(13)中信证券(山东)有限责任公司

住所:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人:杨宝林

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客服电话:95548

网址:www.citicssd.com

(14)光大证券股份有限公司

住所: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:刘晨、李芳芳

电话:021-22169081

传真:021-22169134

客服电话:4008888788、95525

网址:www.ebscn.com

(15)方正证券股份有限公司

住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、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层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

电话:0755-82825551

传真:0755-82558355

客服电话:400-800-1001

网址:www.essence.com.cn

(16)长江证券股份有限公司

住所: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:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

客服电话:95579、4008-888-999

网址:www.95579.com

(17)广发证券股份有限公司

住所: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:黄岚

电话:020-87555888

传真:020-87555417

客服电话:95575或致电各地营业网点

网址:www.gf.com.cn

(18)中信建投证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:权唐

电话:010-85130588

传真:010-65182261

客服电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(19)国金证券股份有限公司

住所:成都市东城根上街95号

办公地址:成都市东城根上街95号

法定代表人:冉云

联系人:刘一宏

电话:028-86690700

传真:028-86690126

客服电话:4006600109

网址:www.gjzq.com.cn

(20)上海好买基金销售有限公司

住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

法定代表人:杨文斌

联系人:陆敏

电话:021-20613999

传真:021-68596916

客服电话:400-700-9665

网址:www.ehowbuy.com

(21)上海天天基金销售有限公司

住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼

办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人:其实

联系人:许云婷

电话:021-54509988

传真:021-64385308

客服电话:400-1818-188

网址:www.1234567.com.cn

(22)杭州数米基金销售有限公司

住所:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:张裕

电话:021-60897840

传真:0571-26697013

客服电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

(23)深圳众禄金融控股股份有限公司

住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址: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

传真:0755-33227951

客服电话:4006-788-887

网址:www.zlfund.cn

(24)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层

办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层

法定代表人:杨露

联系人:文雯

电话:010-83363099

传真:010-83363072

客服电话:400-166-1188

网址:http://8.jrj.com.cn

(25)和讯信息科技有限公司

住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王荣

电话:021-20835789

传真:021-20835885

联系人:刘英

客服电话:400-920-0022

网址:licaike.hexun.com

(26)上海陆金所资产管理有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人:郭坚

电话:021-20665952

联系人:何雪

客服电话:400-821-9031

网址:www.lufunds.com

(27)上海联泰资产管理有限公司

住所:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6层

法定代表人:燕斌

电话:021-52822063

传真:021-52975270

联系人:陈东

客服电话:4000-466-788

网址:http:/www.91fund.com.cn/index.html

其它代销机构名称及其信息另行公告。

(二)注册登记机构

农银汇理基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层

办公地址:上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼

法定代表人:于进

电话:021-61095588

传真:021-61095556

联系人:高利民

客户服务电话:4006895599

(三)相关法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

住所:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人:廖海

联系电话:021-51150298

传真:(021)51150398

联系人:廖海

经办律师:廖海、刘佳

(四)审计基金资产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:张勇

经办注册会计师:汪棣、张勇

四、基金名称

农银汇理深证100指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采用指数增强的投资策略,在被动复制指数的基础上结合主动管理的增强手段,力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在7.75%以内,日平均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内,以期获得超越标的指数的业绩水平。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、债券、银行存款以及法律法规或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的相关规定。其中:股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,投资于标的指数成分股及其备选股的比例不低于股票投资的80%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围;如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

八、基金的投资策略

本基金为指数增强型基金,通过对于标的指数成分股构成的适当偏离和非成分股的主动管理,以期在跟踪误差可控的前提下创造超越业绩比较基准的超额收益水平。

1、大类资产配置

本基金的大类资产由股票组合和现金组合构成。其中股票组合将以成份股在标的指数中的基准权重为基础,再进行适当的超配和低配。现金组合由现金和到期日在一年以内的政府债券组成,主要用于支付赎回款、支付增发或配股款项、支付交易费用、管理费和托管费等,现金组合占基金资产净值的比例不得低于5%;本基金的股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,且其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的80%。

2、股票投资策略

本基金主要策略为跟踪目标指数,其目标在于将基金对标的指数的跟踪误差保持在可控的范围之内。同时本基金还将利用基金管理的研究成果,对跟踪标的进行适当的有效偏离,通过指数增强力争取得超越标的指数的回报。

(1)标的指数跟踪

本基金所构建的投资组合将主要根据标的指数成分股构成的变化以及申购赎回等原因引起的组合变动进行相应的调整,主要的调整方式如下:

1)定期调整

根据深圳证券信息有限公司的指数编制规则,深证100指数的成分股原则上每半年调整一次,调整方案提前两周公布。在指数定期调整方案公布之后,基金管理人将根据调整后的成分股及权重状况,及时对现有组合的构成进行相应的调整,卖出相应比例的调出股票并买入相应比例的调入成分股,使指数投资部分尽可能接近理论复制组合。

2)不定期调整

① 指数相关的调整

由于标的指数编制方法临时发生调整,或成分股及其权重临时发生变化(包括配送股、新股上市、调入及调出成分股等)的原因,基金管理人需要及时根据情况对跟踪组合进行相应的调整,使指数投资部分尽快接近理论复制组合,从而降低指数调整对跟踪误差所可能产生的影响。

② 应对申购赎回的调整

本指数基金为开放式基金,每日的申购和赎回的现金流都会对指数投资部分的跟踪精度产生影响。尤其是在产生较大规模的申购和赎回的情况下,跟踪误差在短期内可能会加大。应对每日申购赎回所进行的调整也是指数基金日常管理中的进行调整的主要工作之一。基金管理人将通过和直销客户及销售渠道的密切沟通,以及对历史申购赎回数据的分析和规律总结,并结合市场的状况对未来的申购和赎回进行科学的预判,并据此对指数投资部分进行相应的调整以平滑整体的跟踪误差。

③ 限制性调整

根据相关法律法规和基金合同的有关投资限制的规定,本基金在根据标的指数的成分股情况进行投资时应尽量避免超越相关限定性规定,若因样本复制的原因导致出现突破投资限制的情况,则必须在规定的时间之内进行调整,以保证投资组合符合法律法规和基金合同的要求。

④ 替代性调整

部分成分股可能会因为存在严重的流动性困难,或因涨跌停、停牌等原因导致本基金无法按指数成分股要求进行投资。在这种情况下,本基金将采用处于相同行业、基本面特征相似、收益率相关性较高或历史Beta相近的股票或股票篮子进行替代投资。

⑤ 其他调整

在基金的运作过程中,因其他原因所导致的必须对当前的指数投资部分进行调整时,基金管理人可以根据实际情况,以提高跟踪精度为目标进行相应的临时调整。

(2)主动管理为辅的增强策略

本基金指数增强的目标是在基金总体跟踪误差可控的前提下,通过对标的指数构成的适当偏离和非成份股的主动管理,以期创造出超越业绩比较基准的超额收益水平。

1)主动管理的跟踪误差控制

本基金主动管理的约束是不能超过基金合同设定的跟踪误差和偏离度,因此在进行主动管理时基金管理人将重点关注跟踪误差控制的约束。基金管理人将采用量化模型化的方法,对于基金组合内的个股权重调整对于整体组合跟踪误差的影响进行客观分析,以判断主动管理的合理调整范围。同时设立跟踪误差的警戒线,结合对跟踪误差的量化分析,对于可能导致跟踪误差过大而超越相关约束的个股调整进行事先预警。

2)指数成份股的适度调整

基金管理人将结合定性和定量的方法,以标的指数的预期收益率为衡量指标,对指数成份股的估值水平及其合理性进行客观分析和判断,并将其分为三种类型:一是价格被低估并有超额收益预期的成份股,二是价格基本合理且无显著超额收益预期的成份股,三是价格被高估且可能出现负超额收益的成份股。对于上述三类成份股,基金管理人将结合对个股市值占比、流动性、投资比例限制,在不显著扩大基金组合跟踪误差的基础上,对被低估成份股进行适度超配,并对高估成份股进行适度减配,并合理保持其他成份股的配置比例与标的指数的一致性。

3)非成份股的主动管理

对于非标的指数成份股的管理,基金管理人将综合采用定性和定量的分析方法,主要依靠管理人研究团队的研究成果,审慎选择可能产生预期超额收益的个股或股票组合。主要的管理方法有:

①基金管理人将对公司股票库内的可投资标的进行四个层面的分析和筛选,包括流动性、基本面、价值、和市场面。其中流动性指标包括换手率、成交金额等指标;基本面指标包括资产收益率、利润增长率等盈利指标和净利润现金含量、财务费用比例、每股负债率、流动负债率、总资产周转率等质量指标;价值指标包括市盈率、市净率等指标;市场面指标包括动量、资金和情绪等指标。上述分析指标综合了来自市场各类投资者、公司各类报表等各方面的信息,能够有效捕捉存在潜在超额收益的被低估个股,从而为非成份股选择提供有效参考。

②前瞻性纳入部分备选成份股。若基金管理人预期标的指数的成份股会发生调整,基金管理人将根据市场流动性等实际情况,以平滑基金投资组合的跟踪误差为目标,将部分备选成份股纳入基金投资组合。

6、债券投资管理

本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产较高流动性的基础上,有效利用基金资产,为基金资产创造更好的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将灵活调整债券组合久期、科学配置债券投资品种、谨慎选择个券。基金管理人将优先选择信用等级较高、流动性较好的债券进行投资,并通过对基金现金需求的科学分析,合理分配基金资产在债券上的配置比例。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)

十、基金的风险收益特征

本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2016年3月29日复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。

本投资组合报告所载数据截至2015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	32,390,241.08	76.89
	其中:股票	32,390,241.08	76.89
2	固定收益投资	1,400,140.00	3.32
	其中:债券	1,400,140.00	3.32
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,402,597.13	5.70
7	其他资产	5,931,856.68	14.08
8	合计	42,124,834.89	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	141,794.00	0.41
B	采矿业	155,681.40	0.46
C	制造业	15,332,729.13	44.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	147,384.00	0.43
E	建筑业	183,026.64	0.53
F	批发和零售业	812,714.00	2.38
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	4,163,932.03	12.17
J	金融业	4,407,683.92	12.88
K	房地产业	2,968,077.14	8.68
L	租赁和商务服务业	498,448.78	1.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	871,085.02	2.55
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	873,560.52	2.55
S	综合	261,192.28	0.76
	合计	30,817,308.86	90.07

(2)报告期末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	3,494.00	0.01
B	采掘业	2,547.27	0.01
C	制造业	985,270.85	2.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,099.00	0.36
E	建筑业	79,020.00	0.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	548.10	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	197,953.00	0.58
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	180,000.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	1,572,932.22	4.60

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

(1)报告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	000002	万 科A	85,000	2,076,550.00	6.07
2	000333	美的集团	27,907	915,907.74	2.68
3	000651	格力电器	40,975	915,791.25	2.68
4	000001	平安银行	71,176	853,400.24	2.49
5	300104	乐视网	13,680	823,262.40	2.41
6	000725	京东方A	265,700	789,129.00	2.31
7	000858	五 粮 液	24,000	654,720.00	1.91
8	300059	东方财富	12,500	650,375.00	1.90
9	000776	广发证券	32,715	636,306.75	1.86
10	002024	苏宁云商	45,800	616,010.00	1.80

(2)报告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	002667	鞍重股份	3,000	224,400.00	0.66
2	002276	万马股份	6,914	208,111.40	0.61
3	002567	唐人神	16,000	205,440.00	0.60
4	000031	中粮地产	14,000	196,700.00	0.57
5	002739	万达院线	1,500	180,000.00	0.53

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,400,140.00	4.09
	其中:政策性金融债	1,400,140.00	4.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,400,140.00	4.09

5. 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	018001	国开1301	14,000	1,400,140.00	4.09

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