华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2016年第1号）

基金管理人：华润元大基金管理有限公司
基金托管人：招商证券股份有限公司

二〇一六年七月

【重要提示】

华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2015年3月9日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2015】363号文准予募集注册。本基金基金合同于2015年5月25日正式生效。

基金管理人保证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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，谨慎、自主做出投资决策，并自行承担投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、技术风险、合规性风险及本基金的特有风险等。本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中高预期风险、高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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，本基金管理人不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

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导致的投资风险，由投资者自行负担。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2016年5月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期

2015年5月25日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华润元大基金管理有限公司

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）

办公地址：深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层

邮政编码：518048

法定代表人：路强

成立时间：2013年1月17日

注册资本：3亿元人民币

存续期限：永续经营

联系人：林婷婷

电话：（0755）88399008

传真：（0755）88399045

华润元大基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2012]1746号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
华润深国投信托有限公司	51%
元大证券投资信托股份有限公司	49%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的合法权益。公司董事会下设薪酬与提名委员会、合规审核委员会、风险控制委员会三个专业委员会，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。

公司监事会由四位监事组成，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。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理根据公司章程及董事会授权，全面主持公司日常经营管理。督察长负责公司及基金运作的监察稽核工作，由公司董事会聘任，对董事会负责。公司经营层设投资决策委员会、特定客户资产管理投资决策委员会、产品审议委员会、风险管理委员会、固有资金投资运用管理委员会、IT治理委员会作为总经理行使职权的议事决策机构。

公司按照不同业务职能，分为十个部门。其中投资部门包括投资管理部、固定收益部、特定客户资产管理部三个部门；市场部门包括营销部和市场策划部两个部门；后台运营部门包括信息技术部、运营管理部、综合管理部和财务部四个部门；同时公司还设立了独立于各业务部门的监察合规部，对公司及基金投资运作、内部管理等事项进行事前、事中、事后独立监察。

截至到2016年5月25日，公司有员工60人，其中53%的员工具有硕士及以上学历，98%的员工具有基金从业资格。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、监察稽核制度、基金会计制度、财务管理制度、信息技术管理制度、信息披露制度等公司管理制度。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

路强先生，董事长，本科学历。历任中国华润总公司进出口贸易经理，大连保税区宝利行华润国贸有限公司副总经理，华润投资开发有限公司助理总经理、董事、副总经理，华润深国投信托有限公司副总经理。现任华润深国投信托有限公司董事、总经理，深圳红树林创业投资有限公司总经理，深圳华润元大资产管理有限公司执行董事。

厉放女士，副董事长，博士学历。历任中国人民银行金融研究所高级研究助理，香港岭南大学社会科学院讲师，美国安泰国际保险公司亚太总部研究员，荷兰集团亚太区研究中心主管，荷兰国际集团全球养老金服务企业资深顾问。现任元大证券（香港）有限公司董事总经理，招商局中国基金有限公司独立董事。

孟扬女士，董事，硕士学历。历任北京大学助教，深圳国际信托投资公司租赁部业务员、副科长、科长、副经理、资产管理部经理、总经理助理，深圳国际信托投资有限责任公司副总经理，华润深国投信托有限公司董事、总经理。现任华润深国投信托有限公司董事长，华润金融控股有限公司副总经理，深圳红树林创业投资有限公司董事长，国信证券股份有限公司董事。

刘宗圣先生，董事，博士学历。历任泰国WALL RESEARCH投资策略分析师、宝来证券研发部总经研究组组长、宝来证券集团总裁特别助理、总经理室主任、国际金融部副总经理，宝来证券（香港）有限公司总经理、宝来证券投资信托股份有限公司总经理。现任元大证券投资信托股份有限公司总经理，PT AMCI Manajemen Investasi Indonesia公司（简称AMII资产管理公司）董事（Commissioner）。

刘胤宏先生，独立董事，硕士学历。历任北京金杜律师事务所公司证券部律师。现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、深圳分所主任，深圳市格林赛特环保能源科技有限公司监事，深圳市南天信息技术有限公司监事。

孙茂竹先生，独立董事，硕士学历。历任北京市第二建筑工程公司工人。现任中国人民大学商学院财务系教授、博士生导师，北京城建设计发展集团股份有限公司独立董事，洛阳轴研科技股份有限公司独立董事，北京首都开发股份有限公司独立董事。

张天鹏先生，独立董事，硕士学历。历任化学银行（Chemical Bank）经理，菲利普·莫里斯公司（Philip Morris Inc）经理，中华开发公司经理，蓝等管理顾问有限公司负责人，所罗门兄弟（Salomon Brothers）副总裁，华盛顿资本集团（Washington Capital Group）执行董事，瑞士联合银行集团（UBS）执行董事，阿凡提公司（Avant! Corporation）首席财务官，Union Nature Inc.负责人，瑞士信贷第一波士顿银行（CSFB）董事总经理，瀚宇彩晶股份有限公司独立董事。现任利统股份有限公司董事，富晶通股份有限公司独立董事，富堡工业股份有限公司董事，微端科技股份有限公司监察人法人代表。

林瑞源先生，董事，总经理，本科学历。历任元大宝来证券股份有限公司服务代理部科长，元大宝来证券投资信托股份有限公司客户服务部经理、行销部副总经理、投资理财部副总经理、通路事业部资深副总经理。现任深圳华润元大资产管理有限公司总经理。

何特先生，董事，督察长，硕士学历。历任深圳三九医药贸易有限公司财务部经理，华润深国投信托有限公司投资部经理、证券投资部信托经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管，华润深国投信托有限公司证券投资部高级信托经理、总经理助理、执行总监。现任深圳证券期货业纠纷调解中心调解员，深圳华润元大资产管理有限公司执行监事。

2、基金管理人监事会成员

卢伦女士，监事，硕士学历。历任华为技术有限公司人力资源部经理，晨星（深圳）资讯有限公司股票研究部研究员，华润（集团）有限公司财务部资本副总监。现任华润深国投信托有限公司财务管理部总经理。

林武田先生，监事，博士学历。历任英于股份有限公司董事长兼总经理，元大建设开发股份有限公司总经理，元大京华证券股份有限公司执行副总，元大创业投资股份有限公司董事长，元大国际财务顾问股份有限公司董事长，财团法人元大文教基金会执行长，元大金融控股股份有限公司执行副总。现任元大证券投资信托股份有限公司董事长。

张扬帆先生，监事，硕士学历。历任德勤华永会计师事务所高级审计师，华润深国投信托有限公司财务管理部经理。现任华润元大基金管理有限公司财务部总经理助理。

李孟霞女士，监事，硕士学历。历任台湾宝来证券新金融商品部副理，台湾中华开发工业银行金融交易部经理，台湾富邦投信ETF基金管理部基金经理，台湾元大投信指数暨量化投资事业群资深经理。现任华润元大基金管理有限公司投资管理部投资总监。

3、基金管理人高级管理人员

路强先生，董事长。简历见董事会成员介绍。

林瑞源先生，总经理。简历见董事会成员介绍。

何特先生，督察长。简历见董事会成员介绍。

4、本基金基金经理

杨伟先生，厦门大学金融工程博士，7年金融行业从业经验。历任兴业证券股份有限公司风险管理专员，平安信托有限责任公司金融工程及量化投资研究员。2013年加入华润元大基金管理有限公司，现任华润元大富时中国A50指数型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

李武群先生，中国科学院研究生院工学博士，7年金融行业从业经验。历任中信银行福州分行计划财务部统计岗，华西证券研究所量化组高级研究员、股票投资部投资经理助理。2015年加入华润元大基金管理有限公司，现任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

林瑞源（总经理）

李洋昇（投资管理部总经理兼固定收益部总经理）

李孟霞（投资管理部投资总监）

上述人员之间无近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：广东省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

成立时间：1993年8月

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币58.08亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]78号

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有200家批准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司、参股博时基金管理公司、招商基金管理公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型IT公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上人员占比100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经营情况

招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。 除此之外，招商证券于2012年10月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至2016年一季度，招商证券共托管15只公募基金。

招商证券托管部于2015年4月通过了普华永道会计师事务所提供的ISAE3402鉴证服务，成为业内第一家通过ISAE3402认证的券商托管人和基金外包服务机构。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核监察部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部财立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

（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

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

名称：华润元大基金管理有限公司

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）

办公地址：深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层

法定代表人：路强

成立时间：2013年1月17日

电话：（0755）88399008

传真：（0755）88399045

联系人：杜敏琳

客户服务电话：4000-1000-89

网址：www.cryuantafund.com

个人投资者可以通过本基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的认购、申购、赎回等业务，其认购其余细则请参阅本基金管理人网站公告。网上交易网址：www.cryuantafund.com。

2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

（1）招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：广东省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：秦湘

联系电话：0755-26951111

客服电话：95565

网址：www.newone.com.cn

（2）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

邮政编码：200040

联系人：刘晨

传真：021-22169134

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

（3）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东济南市中区经七路86号

办公地址：山东济南市中区经七路86号证券大厦2001室

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

客户服务电话：95538

电话：021-20315255

传真：02120315137

网址：www.zts.com.cn

（4）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼22楼

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（5）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

办公地址：苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：400-860-1555

网址：www.dwzq.com.cn

（6）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：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（7）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

客服电话：4008-888-888

（8）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9层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60836029

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（9）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：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼20层

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

（10）中国国际金融有限公司

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

办公地址：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：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65051156

网址：www.cicc.com

（11）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

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666 / 95521

网址：www.gtja.com

（12）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

电话：010-85156398

传真：010-65182261

客服电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

3、网上现金发售代理机构

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，详见基金份额发售公告。

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或变更上述销售机构，并及时公告。

（二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：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：（0755）25946013

传真：（0755）25987122

联系人：严峰

（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：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

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17层01-12室

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

法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

联系人：李妍明

经办注册会计师：吴翠蓉、高鹤

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金

（二）本基金类型：股票型证券投资基金

（三）基金运作方式：交易型开放式

六、基金投资目标和投资方向

（一）投资目标

本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当，以便为投资者带来长期收益。

（二）投资范围

本基金投资于中创100指数的成份股及其备选成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券等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）。

本基金投资于中创100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略

（一）投资决策依据和投资流程

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

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，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

定期调整：本基金股票组合根据所跟踪的中创100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

不定期调整：根据指数编制规则，中创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新调整时，本基金将根据中创100指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有关利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。同时，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。

为有效管理投资组合，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、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。基金投资于衍生工具的目标，是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，以便更好地实现基金的投资目标。基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的10%。基金拟投资于新推出的金融衍生产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并报告中国证监会备案后公告。在正常市场情况下，本基金力争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%。

（二）投资决策依据和投资流程

1、投资决策依据

（1）国家有关法律法规和基金合同的有关规定；

（2）公司投资及风险控制政策；

（3）本基金采用被动式指数化投资，在追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化的前提下，根据标的指数成份股的构成及其权重，形成基金投资建议；

（4）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

3、投资决策流程

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：基金经理根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的投资方法，以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行：运营管理部交易组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：投资管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：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。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%；

（2）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；

（3）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%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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；

（8）本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，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；

（9）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；

（10）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%；

（11）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；

（12）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本基金持有的股票总市值的20%；

（13）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；

（14）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%；

（15）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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（16）基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的10%；

（17）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（18）法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他投资限制。

因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规对上述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，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，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、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。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

八、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中创100指数

中创100指数选取中小板和创业板中代表性较强、流动性较好的100家公司组成样本股，能够较好反映中小企业板和创业板重点企业的运行状况。

本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，基金管理人在取得基金托管人同意后报中国证监会备案并及时公告。

九、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中高预期风险、高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

十、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2016年3月31日（财务数据未经审计）。

1.1 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	97,351,224.68	98.87
	其中：股票	97,351,224.68	98.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,105,373.27	1.12
7	其他资产	10,739.06	0.01
8	合计	98,467,337.01	100.00

1.2 报告期末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	812,910.00	0.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,000,272.12	51.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,253,982.00	3.31
F	批发和零售业	3,129,285.00	3.19
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	21,822,173.49	22.22
J	金融业	6,033,422.06	6.14
K	房地产业	576,444.00	0.59
L	租赁和商务服务业	3,325,118.15	3.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,421,856.00	2.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	564,412.50	0.57
R	文化、体育和娱乐业	4,411,349.36	4.49
S	综合	-	-
	合计	97,351,224.68	99.14

1.3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	300104	乐视网	66,700	3,921,960.00	3.99
2	300059	东方财富	73,600	3,260,480.00	3.32
3	002024	苏宁云商	273,300	3,129,285.00	3.19
4	002450	康得新	80,800	2,665,592.00	2.71
5	002415	海康威视	82,700	2,548,814.00	2.60
6	002304	洋河股份	34,395	2,297,586.00	2.34
7	002594	比亚迪	34,600	2,034,826.00	2.07
8	002736	国信证券	114,172	1,874,704.24	1.91
9	300024	机器人	31,700	1,792,635.00	1.83
10	002673	西部证券	65,500	1,769,810.00	1.80

1.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.5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

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.6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。

1.7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。

1.8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。

1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

1.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持仓股指期货。

1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

1.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

1.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

1.11投资组合报告附注

1.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

1.11.2

本报告期内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。

1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,798.24
2	应收证券清算款	380.66
3	应收股利	-
4	应收利息	560.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,739.06

1.11.4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。

1.11.5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	300104	乐视网	3,921,960.00	3.99	重大资产重组

1.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。