



前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 招募说明书（更新） （2015 年第 2 号）摘要

基金管理人：前海开源基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
截止日：2015 年 12 月 17 日

重要提示

本基金经 2014 年 5 月 19 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2014]494 号文注册募集，基金合同已于 2014 年 6 月 17 日正式生效。

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。

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，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，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有的风险及其他风险等。

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表现的保证。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 12 月 17 日，有关财务数据和净值表现截止日 2015 年 9 月 30 日（未经审计）。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司已于 2016 年 1 月 11 日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、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）
- 3、成立日期：2013 年 1 月 23 日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可 [2012] 1751 号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755- 83181169
- 9、联系人：吴承禹
- 10、注册资本：人民币 2 亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资 1/4，北京市中盛金期投资管理有限公司出资 1/4，北京长和世纪资产管理有限公司出资 1/4，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资 1/4。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学经济学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。曾任深圳特区证券有限公司行业研究员，南方基金管理有限公司投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、自营负责人，现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

Mr Yan Charles Wang (王岩先生), 董事, 学士学位, 国籍: 加拿大。从 1993 年起, 曾任职加拿大美林证券, 美国 Clemente Capital 董事、大中国区主管, 美国纽约州立养老金另类投资部主管, 美国磐石基金大中国区主管、董事总经理, 美国橡树资本中国区主管、董事总经理, 长安街资本合伙人, 现任美国米尔斯坦中国总裁。曾是美国机构有限投资者协会(ILPA)创始会员, 中国风险协会(CVCA)顾问。现任前海开源基金管理有限公司董事。

刘新华先生, 董事, 高级经济师, 博士后, 国籍: 中国。历任广东证券研究中心负责人、泰阳证券研究中心负责人、广东省广业资产经营公司规划部副部长、华夏基金管理有限公司机构产品部副总监(主持工作)、广东金海资产管理有限公司总经理。

范镛先生, 董事, 本科学历, 国籍: 中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

向松祚先生, 独立董事, 教授, 高级经济师, 国籍: 中国。著名经济学家、国际金融战略专家, 中国人民大学博士, 美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士, 英国剑桥大学经济系和嘉丁管理学院访问学者。现任中国农业银行首席经济学家、中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币基金机构官方论坛(OMFIF)顾问委员会副主席、世界经济论坛(World Economic Forum)国际货币体系改革分论坛咨询顾问。

申嫦娥女士, 独立董事, 博士, 教授, 博士生导师, 中国注册会计师(非执业会员), 国家税务总局特邀监察员(2003-2010), 国籍: 中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授, 北京师范大学副教授、教授。

Mr Shujie Yao (姚树洁先生), 独立董事, 教授, 国籍: 英国。英国诺丁汉大学当代中国学院院长、教授, 西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长; 英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员; 全英专业团体联合会副主席; 《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》(英文)等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授, 英国牛津大学研究员, 英国朴茨茅斯大学教授、主任, 英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

2、基金管理人监事会成员

骆新都女士, 监事会主席, 经济学硕士, 经济师, 国籍: 中国。曾任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

李匆先生, 联席监事会主席, 上海交通大学工商管理博士, 美国哥伦比亚大学公共管理硕士, 中国注册会计师, 国籍: 中国香港。曾任职华银国际信托投资公司上海证券营业部、华安基金管理有限公司基金经理、香港亨茂投资集团基金经理、韩国未来资产环球投资(香港)有限公司高级基金经理、中国股票投资部主管、公司首席投资官兼亚太区投资部主管、

公司投资委员会主席。现任香港泽源资本创始人、投资总监。现任前海开源基金管理有限公司联席监事会主席。

刘彤女士，监事，硕士研究生，国籍：中国。曾任职汉唐证券有限责任公司人力资源经理、海王生物股份有限公司人事行政经理、顺丰速运集团员工关系总监、英大证券有限责任公司人力资源部主管及银泰证券有限责任公司人力运营总监、总裁助理，现任前海开源基金管理有限公司综合管理部执行总监。

任福利先生，监事，大学本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、泰达宏利基金管理有限公司基金运营部、方正富邦基金管理有限公司基金运营部，现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。

张学玲女士，监事，会计师，国籍：中国。历任武汉大学财务部副部长。

3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

李志祥先生，首席运营官，本科学历，经济师，国籍：中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长，深圳市农产品股份有限公司秘书科科长，大鹏证券有限责任公司业务秘书，南方基金管理有限公司高级经理，前海开源基金管理有限公司督察长。现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、董事会秘书、前海开源资产管理（深圳）有限公司董事。

傅成斌先生，督察长，硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、风险控制委员会主席。

4、本基金基金经理

王霞女士，管理学硕士，注册会计师，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。王霞女士具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员情况

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

王厚琼先生，工程学士，国籍：中国。历任南方证券武汉分公司证券部副经理，南方证券有限公司资产管理部副处长，南方基金管理有限公司交易管理部主管、交易管理部总监助理兼中央交易室主管、交易管理部副总监兼中央交易室主管。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资决策委员会主席。

赵雪芹女士，经济学博士研究生，国籍：中国。历任山东财经大学讲师、海通证券股份有限公司首席分析师、中信证券股份有限公司首席分析师。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

侯燕琳女士，工程硕士、管理学硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理、基金经理；益民基金管理有限公司投资总监、基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

刘静女士，经济学硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金经理、前海开源现金增利货币市场基金基金经理。

丁骏先生，经济学博士，国籍：中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

罗大林先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、专户部投资经理，中信证券股份有限公司自营部高级投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。

付柏瑞先生，硕士，国籍：中国。历任华宝兴业基金管理有限公司分析师；农银汇理基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理。2009年4月至2014年4月担任农银汇理基金管理公司农银平衡双利基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

曲扬先生，博士研究生，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009年11月至2013年1月担任南方基金香港子公司投资经

理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理、前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中国稀缺资产灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

徐立平先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命 4.0 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

邱杰先生，经济学硕士，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、研究负责人、前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金基金经理、前海开源再融资主题精选股票型证券投资基金基金经理、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王霞女士，管理学硕士，注册会计师，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

孙亚超先生，数学科博士后，国籍：中国。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、产品二部负责人；前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理、前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金经理。

谢屹先生，金融与经济数学、工程物理学硕士，国籍：德国。历任汇丰银行（德国）股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届““金牌理财” TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成

立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 306 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金

管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 1308 室

联系人：吴承禹

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

（2）前海开源基金管理有限公司网上交易

网址：www.qhkyfund.com

客服电话：4001-666-998

2、代销机构：

序号	代销机构	销售机构信息
1	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层 法定代表人：杨懿 联系人：张燕 电话：010-58325388-1588 传真：010-58325300 客服电话：400-116-1188 网址： http://8.jrj.com.cn/
2	和讯信息科技有限公司	地址：北京朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 法定代表人：王莉 联系人：于杨 电话：(021)20835779 客服电话：4009-200-022 网址： www.hexun.com
3	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室 办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F 法定代表人：汪静波 联系人：徐诚 电话：(021)38509639 传真：(021)38509777 客服电话：400-821-5399 网址： www.noah-fund.com
4	深圳众禄金融控股股份有限公司	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

		<p>联系人：童彩平 电话：(0755) 33227950 客服电话：4006-788-887 网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com</p>
5	上海天天基金销售有限公司	<p>地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼 法定代表人：其实 客服电话：4001-818-188 网址：www.1234567.com.cn</p>
6	上海好买基金销售有限公司	<p>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 客服电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com</p>
7	杭州数米基金销售有限公司	<p>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：徐映绯 电话：(021) 60897840 传真：(0571) 26697013 客服电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn</p>
8	上海长量基金销售投资顾问有限公司	<p>地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层 法定代表人：张跃伟 电话：(021) 20691832 传真：(021) 20691861 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com</p>
9	浙江同花顺基金销售有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市文二西路元茂大厦 903 室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：(0571) 88911818 传真：(0571) 88910240 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com</p>
10	北京展恒基金销售股份有限公司	<p>注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层 法定代表人：闫振杰 联系人：马林 电话：010-59601366-7024 传真：010-62020355 客服电话：400-818-8000 网址：www.myfund.com</p>
11	中期资产管理有限公司	<p>地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号 法定代表人：朱剑林 客服电话：(010) 65807609 网址：www.cifcofund.com</p>
12	北京增财基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号 法定代表人：罗细安 联系人：李皓 电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客服电话：400-001-8811</p>

		网址: www.zevc.com.cn
13	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 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 法定代表人: 梁越 联系人: 马鹏程 电话: 010-57756084 传真: 010-57756199 客服电话: 4008-980-618 网址: www.chtfund.com
14	深圳前海汇联基金销售有限公司	地址: 深圳福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 4 楼 法定代表人: 丁海 联系人: 张誉腾 电话: (0755) 32938888-6200 客服电话: (0755) 36907366 网址: www.flyingfund.com.cn
15	一路财富(北京)信息科技有限公司	注册地址: 北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室 办公地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 法定代表人: 吴雪秀 联系人: 段京璐 电话: 010-88312877 传真: 010-88312099 客服电话: 400-001-1566 网址: www.yilucaifu.com
16	北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人: 赵荣春 联系人: 高静 电话: 010-59158282 传真: 010-57569671 客服电话: 400-893-6885 网址: www.qianjing.com
17	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 办公地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 法定代表人: 张琪 联系人: 付文红 电话: 010-82625657 客服电话: 010-62675369 网址: www.xincai.com
18	中经北证(北京)资产管理有限公司	注册地址: 北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层 办公地址: 北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层 邮政编码: 100044 法定代表人: 徐福星 联系人: 李美 电话: 010-68998820-8188 传真: 010-88381550 客服电话: 400-600-0030 网址: www.bzfund.com
19	深圳市锦安基金销售有限公司	注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室 办公地址: 深圳市福田区益田路新世界中心 4 层 法定代表人: 李学东 联系人: 柯冬植

		<p>电话：0755-88914685 客服电话：0755-84669000 网址：http://tz.goldann.com.cn</p>
20	上海联泰资产管理 有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼 联系人：汤蕾 电话：021-51507071 传真：021-62990063 客服电话：4000-466-788 网址：www.91fund.com.cn</p>
21	泰诚财富基金销售 （大连）有限公司	<p>地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号 法定代表人：林卓 联系人：李春光 电话：18640999991 传真：0411-84396536 客服电话：400-6411-999 网址：www.taichengcaifu.com</p>
22	上海汇付金融服务 有限公司	<p>办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人：张晶 电话：021-33323999-8318 客服电话：400-820-2819 网址：www.chinapnr.com</p>
23	北京微动利投资管 理有限公司	<p>注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 法定代表人：梁洪军 联系人：季长军 电话：010-68854005 传真：010-68854009 客服电话：4008-196-665 网址：www.buyforyou.com.cn</p>
24	北京乐融多源投资 咨询有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 法定代表人：董浩 联系人：付瑞华 电话：010-56580666 客服电话：400-068-1176 网址：www.jimufund.com</p>
25	深圳富济财富管理 有限公司	<p>注册地址：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：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室 法定代表人：齐小贺 联系人：马力佳 电话：0755-83999907-815 传真：0755-83999926 客服电话：0755-83999913 网址：www.jinqianwo.cn</p>
26	上海陆金所资产管 理有限公司	<p>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：郭坚 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653</p>

		<p>客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com</p>
27	大泰金石投资管理有限公司	<p>注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室 办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼 法定代表人：袁顾明 联系人：何庭宇 电话：13917225742 传真：021-22268089 客服电话：400-928-2266 公司网址：www.dtfunds.com</p>
28	珠海盈米财富管理有限公司	<p>注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 法定代表人：肖雯 联系人：吴煜浩 电话：020-89629021 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn</p>
29	中国国际期货有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层 办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层 法定代表人：王兵 联系电话：(010)59539999 传真：(010)59539806 客服电话：95162 网址：www.cifco.net</p>
30	中信期货有限公司	<p>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：张磊 联系人：洪诚 电话：0755-23953913 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com</p>
31	国泰君安证券股份有限公司	<p>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：芮敏祺 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：95521 网址：www.gtja.com</p>
32	中信建投证券股份有限公司	<p>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 联系人：张颢 电话：(010)85156398 传真：(010)65182261 客服电话：4008-888-108 网址：www.csc108.com</p>
33	中信证券股份有限公司	<p>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</p>

		<p>法定代表人：王东明 联系人：顾凌 联系电话：(010)60838696 客服电话：95548 网址：www.cs.ecitic.com</p>
34	中国银河证券股份有限公司	<p>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：宋明 联系电话：(010)66568450 传真：(010)66568990 客服电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn</p>
35	海通证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：王开国 联系人：李笑鸣 联系电话：(021)23219000 客服电话：95553 网址：www.htsec.com</p>
36	申万宏源证券有限公司	<p>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：曹晔 电话：(021) 33389888 传真：(021) 33388224 电话委托：(021)962505 客服电话：95523, 4008-895-523 网址：www.swhysc.com</p>
37	万联证券有限责任公司	<p>地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼 法定代表人：张建军 客服电话：4008-888-133 网址：www.wlzq.com.cn</p>
38	渤海证券股份有限公司	<p>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：蔡霆 电话：022-28451991 传真：022-28451958 客服电话：400-651-5988 网址：www.bhzq.com</p>
39	山西证券股份有限公司	<p>地址：山西省太原市府西街 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</p>
40	中信证券（山东）有限责任公司	<p>注册地址：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：杨宝林 联系人：吴忠超 电话：(0532)85022326 客服电话：95548 网址：www.zxwt.com.cn</p>
41	信达证券股份有限公司	<p>地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼</p>

	公司	<p>法定代表人：张志刚 联系人：唐静 电话：(010)63080985 客服电话：4008-008-899 网址：www.cindasc.com</p>
42	长城证券股份有限公司	<p>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 办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人：黄耀华 联系人：刘阳 电话：0755-83516289 传真：0755-83515567 客服电话：400-666-6888 网址：www.cgws.com</p>
43	光大证券股份有限公司	<p>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 电话：(021)22169081 客服电话：95525 传真：(021)22169134 网址：www.ebscn.com</p>
44	大同证券有限责任公司	<p>注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层 法定代表人：董祥 联系人：薛津 联系电话：(0351)4130322 客服电话：4007-121-212 网址：www.dtsbc.com.cn</p>
45	华安证券股份有限公司	<p>注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室 (230081) 法定代表人：李工 联系人：甘霖 电话：(0551)65161821 传真：(0551)65161672 客服电话：4008-096-518 网址：www.hazq.com</p>
46	东莞证券股份有限公司	<p>地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人：张运勇 客服电话：(0769)961130 网址：www.dgzq.com.cn</p>
47	申万宏源西部证券有限公司	<p>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 办公地址：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：许建平 电话：(010)88085858 传真：(010)88085195 联系人：李巍 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com</p>

48	中泰证券股份有限公司	地址：山东省济南市经七路 86 号 法定代表人：李玮 联系人：吴阳 电话：(0531)68889155 客服电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn
49	中国国际金融股份有限公司	地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27、28 层 法定代表人：丁学东 客服电话：400-910-1166 网址：www.cicc.com.cn
50	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 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号 法定代表人：俞洋 联系人：杨丽娟 电话：(021)54967202 客服电话：4001-099-918, (021)32109999, (029)68918888 网址：www.cfsc.com.cn
51	中国中投证券有限责任公司	地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人：龙增来 联系人：刘毅 联系电话：(0755)82023442 客服电话：95532, 4006-008-008 网址：www.china-invs.cn
52	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大厦 7 层、8 层 办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层 法定代表人：黄扬录 联系人：刘军 电话：(0755)82943755 传真：(0755)82960582 客服电话：4001-022-011 公司网址：www.zszq.com
53	国金证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号 办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪 电话：028-86690057 传真：028-86690126 客服电话：400-660-0109 网址：www.gjzq.com.cn
54	华宝证券有限责任公司	地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层 法定代表人：陈林 联系人：刘闻川 电话：(021)68778790 传真：(021)68777992 客服电话：4008-209-898 网址：www.cnhbstock.com
55	爱建证券有限责任公司	地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼 法定代表人：钱华 联系人：王薇

		电话：(021) 32229888 传真：(021) 68728703 客服电话：4001-962-502 网址：www.ajzq.com
56	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 办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼 法定代表人：余磊 联系人：杨晨 电话：027-87610052 传真：027-87618863
57	大通证券股份有限公司	注册地址：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 办公地址：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：李红光 联系人：谢立军 电话：0411-39991807 传真：0411-82826601 客服电话：4008-169-169 网址：www.daton.com.cn
58	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 办公地址：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 联系人：黄芳 电话：(029) 63387256 客服电话：400-860-8866 网址：www.kysec.cn
59	长江证券股份有限公司	客服电话：95579 网址：www.95579.com

（二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：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：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：王兆华

联系人：任福利

电话：（0755）83180910

传真：（0755）83181121

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东信达律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

负责人：麻云燕

经办律师：杨扬、胡云云

电话：0755-88265288

传真：0755-88265537

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

联系人：胡立新

经办会计师：洪祖柏、胡立新

电话：（010）88095588

传真：（010）88091199

四、基金名称

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

（二）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，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、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金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，力求降低跟踪误差。

1、大类资产配置

本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85% 的投资比例限制。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2) 不定期调整

A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 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；

C. 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整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。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（四）投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

（6）交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

（五）业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为沪深 300 指数。

如果指数编制单位变更或停止沪深 300 指数的编制、发布或授权，或沪深 300 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

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。

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率 (税后)} \times 5\%$

沪深 300 指数是沪深证券交易所于 2005 年 4 月 8 日联合发布的反映 A 股市场整体走势

的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的，覆盖了大部分流通市值。其成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。关于指数值和成份股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。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时，本基金基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

（六）风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

（七）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；

（2）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，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；

（3）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%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

(14) 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%；

(15) 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；

(16) 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基金持有的股票总市值的 20%；

(17) 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%；

(18) 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；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

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。

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本基金合同生效之日起开始。

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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人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、有利于基金资产的安全与增值；
- 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。

（九）基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

（十）基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 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 2015 年 9 月 30 日（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	3,884,663.03	81.38
	其中：股票	3,884,663.03	81.38
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	509,843.08	10.68

7	其他资产	378,820.70	7.94
8	合计	4,773,326.81	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	8,742.00	0.21
B	采矿业	170,972.16	4.17
C	制造业	1,272,422.05	31.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,145.91	3.25
E	建筑业	202,046.40	4.93
F	批发和零售业	94,949.06	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	143,685.06	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,931.81	5.39
J	金融业	1,340,227.87	32.71
K	房地产业	168,779.38	4.12
L	租赁和商务服务业	44,099.37	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,699.80	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,528.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	40,678.58	0.99
S	综合	10,755.58	0.26
	合计	3,884,663.03	94.80

2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

3.1 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	601318	中国平安	5,200	155,272.00	3.79
2	600036	招商银行	7,900	140,383.00	3.43

3	600016	民生银行	14,400	121,680.00	2.97
4	600000	浦发银行	5,400	89,802.00	2.19
5	601166	兴业银行	5,400	78,624.00	1.92
6	000002	万科A	4,700	59,831.00	1.46
7	601328	交通银行	9,500	57,760.00	1.41
8	601766	中国南车	4,300	55,771.00	1.36
9	600030	中信证券	3,800	51,604.00	1.26
10	601398	工商银行	11,800	50,976.00	1.24

3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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序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贵金属投资明细

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

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	40,376.57
2	应收证券清算款	335,242.49
3	应收股利	-
4	应收利息	120.13
5	应收申购款	3,081.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	378,820.70

11.4 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。

11.5 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的情况。

11.6 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

11.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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
2014.6.17-2014.12.31	49.50%	1.25%	59.05%	1.23%	-9.55%	0.02%
2015.1.1-2015.9.30	-19.53%	2.61%	25.29%	1.73%	-44.82%	0.88%

2014. 6. 17- 2015. 9. 30	20. 30%	2. 14%	99. 28%	1. 54%	-78. 98 %	0. 60%
-----------------------------	---------	--------	---------	--------	--------------	--------

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

九、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、标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的标的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 4 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

上述“（一）基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（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费用支出或基金财产的损失；
- 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、基金托管费的调整

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、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、其他应披露事项

（一）本基金管理人的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司（以下简称“前海开源资管公司”）兼职及领薪情况如下：

本基金管理人总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长、法定代表人；

本基金管理人首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事；

本基金管理人汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

本基金管理人联席投资总监付柏瑞先生兼任前海开源资管公司联席总经理、投资经理；

本基金管理人专户投资部员工龚自勇、吴彦、李隽、张洋兼任前海开源资管公司投资经理。

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本基金管理人除上述人员以外未有其他董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（三）2015 年 6 月 17 日至 2015 年 12 月 17 日披露的公告：

日期	公告
2015-12-01	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加长量基金费率优惠活动的公告
2015-11-27	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-11-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-11-19	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加天风证券为代销机构并开通定投和转换业务的公告
2015-10-24	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加积木盒子为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加北京微动利为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大通证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加国金证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-15	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-29	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券开通转换业务的公告
2015-09-25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新浪仓石为代销机构并参与其

	费率优惠活动的公告
2015-09-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与华宝证券费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加锦安基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加渤海证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-08-29	前海开源基金管理有限公司关于前海开源沪深 300 指数型证券投资基金变更基金经理的公告
2015-08-25	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要
2015-08-25	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年半年度报告
2015-08-18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中金公司费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加天天基金费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金费率优惠活动的公告
2015-08-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加钱景财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-08-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长城证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-31	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 1 号）
2015-07-20	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告
2015-07-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加恒天明泽为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新兰德为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中期资产为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-01	前海开源基金管理有限公司旗下基金 2015 年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告
2015-06-26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加泰诚财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-24	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

十一、备查文件

（一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源沪深 300 指数型证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

十二、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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，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：

1、对“基金管理人”相关信息进行了更新，包括董监高人员信息等。

2、对“基金托管人”相关信息进行了更新。

3、在“相关服务机构”部分，对代销机构名单进行了更新。

4、在“基金的投资”部分，更新了“（十）基金的投资组合报告”、“（十一）基金的业绩”相关信息。

5、在“其他应披露事项”部分，披露了本基金管理人董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司兼职及领薪情况；披露了 2015 年 6 月 17 日至 2015 年 12 月 17 日期间涉及本基金的公告。

6、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一六年一月三十日