

B070 信息披露 Disclosure

中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要

(2015年第1号)

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
截止日：2015年12月29日

重要提示

本基金经中国证监会2014年4月15日证监许可〔2014〕408号文注册募集，基金合同已于2015年6月29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，并自行承担投资基金过程中出现的各类风险，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，基金管理人在基金实施过程中产生的基金管理人风险，同时由于本基金是跟踪中证500信息技术指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数变动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、赎回资金替代支付的风险、基金份额赎回对价的变化风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、不可抗力风险等。本基金跟踪标的指数的指数“中证500信息技术指数”，因此，本基金的业绩表现与中证500信息技术指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在前结算规则下，T+1申购的基金份额当日可卖出，T+1申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功前T+2日可卖出和赎回。因此，为投资人办理申购业务的证券商若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到损害。

投资人投资本基金时需具有上海证券交易所以A股账户或基金账户。其中，上海证券交易所以基金账户只能进行基金的资金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证500信息技术指数的股份中的上海证券交易所以外股票资产与网上股票资产或基金的资金、赎回，则应开立上海证券交易所以A股账户，如投资人需要使用中证500信息技术指数股份中的深圳证券交易所以外股票资产与网上股票资产，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面了解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，谨慎做出投资决策。基金的投资运作并不预示其未来表现。基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。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、基金份额净值与交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同约定基金当事人之间权利义务，是基金投资者自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《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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年12月29日，有关财务数据均未经审计。截止日为2015年9月30日（未经审计）。

1 基金管理人

1.1基金管理人概况
名称：南方基金管理有限公司
住所及办公地址：深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层楼
成立日期：1998年3月6日
法定代表人：吴万善
注册资本：3.12亿元人民币
电话：(0755) 82763888
传真：(0755) 82763889
联系人：鲍文星
 南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2004年，经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股，注册资本增加至1亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字[2006]201号文批准进行增资扩股，注册资本增加至15亿元人民币。2010年，经证监许可[2010]073号文核准，将名称变更为南方基金管理有限公司。2014年公司进行增资扩股，注册资本金达3.12亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

1.2主要人员情况
1.2.1董事成员
 吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师，中国籍。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科长、中国人民银行南京市分行工交银行科、华泰证券股份有限公司副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券股份有限公司、董事长兼党委副书记。现任南方基金管理有限公司董事长。

张清先生，董事，中国籍，1994年8月毕业于南京大学经济及管理专业，获学士学位，中国籍，1994年8月加入华泰证券，历任总裁秘书、投资银行一部业务助理，上海总部投资银行一部副经理、公司董事兼秘书、总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁、党委书记，现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委书记；华泰长城期货有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

姜健先生，董事，中国籍，1994年12月毕业于南京林业大学经济及管理专业，获硕士学位，中国籍，1994年12月加入华泰证券一直在华泰证券工作，历任人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行总部股票事务部副经理、投资银行一部副经理、投资银行一部高级经理、投资银行一部副经理兼投行部总经理、资产管理部总经理、投资银行总部业务总监、总裁助理、副总裁、董事会秘书等职务。现任华泰证券股份有限公司的副总裁、党委书记、董事会秘书；华泰联合证券有限责任公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、江苏股权交易中心有限公司董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事、江苏银行股份有限公司董事、证通股份有限公司董事。

夏桂英女士，董事，中共党员，高级经济师，26年法律专业管理经济工作经历。毕业于中国政法大学法律专业，获法学硕士学位，中国籍。曾先后担任中国政法大学中国法制研究所教师、深圳市人大立法处办公室主任、深圳市光通发展有限公司办公室主任、深圳市投资管理公司总经理助理、深圳市对外劳动服务有限公司党总支书记、董事长等职。2004年10月加入深圳市投资控股有限公司，历任法律事务部部长、企业一部部长职务。现任深圳市投资控股有限公司副总经理、深圳市招商局有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司董事、深圳市城市建设开发（集团）公司董事、深圳中小企业信用融资担保集团有限公司董事。

项建国先生，董事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于中南财经大学会计学专业，中国籍。曾在江西财经大学任教并担任审计教研室主任，其后在深圳蛇口信德会计师事务所、深圳市招商局投资控股公司、深圳市投资控股有限公司任职，历任深圳市投资控股有限公司投资部部长、投资发展部部长、企业一部部长、战略发展部部长、长期从事投融资、股权投资、股东事务等工作。现任深圳市投资控股有限公司资产管理部总经理、中国深圳对外服务（集团）有限公司董事、深圳市高新投投资有限公司监事、华恒五生肉类食品（深圳）有限公司董事、深圳市建筑设计研究总院有限公司董事。

李自成先生，董事，中共党员，硕士研究生学历，中国籍，历任厦门大学哲学系团总支副书记、厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、财经理部、公司总经理助理、厦门国际信托投资有限公司副总经理、厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司总经理。

任贤芳女士，董事，工商管理硕士，经济师，中国籍。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证（香港）金融控股有限公司董事。

杨小松先生，总裁，中共党员，经济学硕士，注册会计师，中国籍。历任德勤国际会计师事务所专业翻译，光大银行证券部职员，美国 NASDAQ 国际公司、证监会处长、副主任，2012年加入南方基金，担任督察长，现任南方基金管理有限公司董事、总裁、党委副书记。

姚剑刚先生，独立董事，经济学硕士，中国籍。历任国家经委副部长、商业政策研究室副处长、国际合同处处长、副部长、中国国际贸易促进会行业分会副会长、常务副会长、国际贸易部业务发展中心主任、中国商业联合会副会长、秘书长、安徽省政协副主席、安徽省新闻业联合会、安徽省统计局长、党组书记、国家统计局局长助理兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员，中国经济50人论坛成员，中国统计学会副会长。

李心丹先生，独立董事，金融学博士，国务院特殊津贴专家，国务院学位委员会、教育部全国金融硕士专业学位指导教师委员会委员，中国籍。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授，现任南京大学工商管理学院金融、金融工程研究中心主任、南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师、江苏省省委政策咨询专家、上海证券交易所上市公司委员会及公司治理委员会委员、上海证券交易所、深圳证券交易所、国信证券等单位的博士后指导教师、中国金融学会常务理事、国家留学基金委评审专家、江苏省资本市场研究会会长、江苏省科技创新协会副会长。

周翰海先生，独立董事，工商管理博士，香港证券及投资学会高级资深会员，中国香港，曾任香港证券及期货市场监管委员会、香港证券及期货专员办事处，及香港证监会及期货事务监察委员会，退休前为该会的法规执行部总监。其后曾任证监会法规执行部副总监及香港汇业控股集团有限前首席行政非执行董事。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，中共党员，经济学硕士，20年以上证券从业资格，中国籍。毕业于行政管理专业，曾任深圳市人民政府、深圳蛇口会计师事务所、深圳会计师事务所等机构，先后担任主任、经理、副主任等职务。现任深圳会计师事务所“特殊普通合伙”董事合伙人，中国证监会上市公司并购重组审核咨询委员会委员。

周慧女士，独立董事，硕士研究生学历，中国籍。曾工作于北京市万商天凯（深圳）律师事务所、北京市中伦（深圳）律师事务所、北京市信利（深圳）律师事务所、现任北京市金杜（深圳）律师事务所华南地区管理合伙人、全联期货商会“广东分会”副会长、广东律师协会华南分会副会长、深圳市中小企业创业投资协会专家、深圳中小企业公共法律服务联盟主席、深圳市展览展示服务有限公司独立董事。

1.2.2监事会成员
 孙小松先生，监事，15年的证券行业工作经历，毕业于杭州电子工业学院会计专业，获学士学位，中国籍。曾任杭州南电电子集团公司，担任财务处处长工作，1998年10月加入华泰证券，历任计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理，现任华泰证券股份有限公司财务负责人、计划财务部总经理，华泰联合证券有限责任公司监事会主席、华泰长城期货有限公司副董事长、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士，监事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于深圳广播电视大学会计专业，中国籍。曾在浙江兰溪马涧村广、浙江兰溪纺织机械厂、深圳市建筑机械动力公司、深圳市建设集团、深圳市建设投资控股公司工作，2004年深圳市投资控股有限公司成立至今，历任公司计划财务部副经理、经理，财务预算部副部长，长期从事财务管理、投融资、股权管理、股东事务等工作，现任深圳市投资控股有限公司考核分配部、深圳经济特区房地产（集团）股份有限公司董事、考核分配部（集团）股份有限公司董事、深圳市国际招标有限公司董事、深圳市深投物业发展有限公司董事。

苏荣坚先生，监事，中共党员，学士学位，高级经济师，中国籍。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理。

林红珍女士，监事，投资经济管理专业学士学位，后参加厦门大学金融学院研究生进修班，中国籍。曾任厦门对外供应总公司会计、厦门中友贸易联合公司财务部副经理、厦门外供房地产开发公司财务部经理，1994年进入兴业证券，先后担任计划财务部综合组负责人、直属营业部财务部经理、财务会计部计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副经理、稽核审计部副经理、风险管理部副经理兼（主持工作）、兴业证券风险管理部总经理，现任兴业证券股份有限公司财务部总经理、兴证创新资本管理有限公司监事。

苏民先生，职工监事，博士学历，工程师，中国籍。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，华泰证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副经理、市场部服务总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

张德伦先生，职工监事，中共党员，硕士学历，中国籍。历任北京邮电大学副教授，华为技术有限公司处长、汉唐证券人力资源部总监、海王生物人力资源部总监、华信恒悦咨询人力资源部经理、首席顾问，2010年1月加入南方基金管理有限公司，任人力资源部副经理。

徐超先生，职工监事，工商管理硕士，中国籍。曾担任建设银行深圳分行科技部主任兼分公司副经理，2000年10月加入南方基金管理有限公司，历任信息技术部主管、总监助理、副总监、执行总监，现任运作保障部总监。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，中国籍。先后担任金杜律师事务所律师事务证券业务部实习生、浦东发展银行深圳分行资产保全部职员、银华基金管理有限公司监察稽核部法律主管、民生加银基金管理有限公司监察稽核部职员，2008年12月加入南方基金管理有限公司，历任监察稽核部经理、高级经理、总监助理、副总监，现任监察稽核部执行总监。

1.2.3公司高级管理人员
 吴万善先生，董事长，商场上。杨小松先生，总裁，商场上。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，中国籍。历任江苏省投资公司业务经理、江苏国信招商局部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员、南方资产管理有限责任公司董事长兼总经理。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任广东湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券分公司，2000年加入南方基金，历任国投投资经理、专户理财部副经理、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱远东先生，副总裁，中共党员，经济学学士，中国籍。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发总监、总裁助理、首席市场执行经理，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，中国籍。历任南京汽车制造厂经营计划处科长，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理，投资银行总部副经理兼基金部总经理。2005年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委书记。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA工商管理硕士，中国籍。历任中国银行业银行副处秘书，南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理、联合证券（现为华泰联合证券）董事会秘书、合规总监等职务；2011年加入南方基金，任职董事会秘书、纪委书记，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记，南方资产管理有限责任公司董事。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任美国AXA Financial公司投资部高级分析师，2002年加入南方基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经、全国社保及国际业务部执行总经理、全国社保业务总监、固定收益部总监、总经理助理兼固定收益投资总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、南方东英资产管理（中国）（香港）董事。

鲍文星先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士，中国籍。历任财政部中华会计师事务所审计师，南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理，1998年加入南方基金，历任运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总经理助理，现任南方基金管理有限公司督察长、南方资产管理有限责任公司副总裁、纪委书记。

1.2.4基金历任基金经理为：2015年6月至2015年7月，雷俊；2015年7月至今，曹伟、孙伟。

曹俊先生，北京大学工学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任信息技术部系统研发系统员、数量化投资部高级研究员；2014年12月至今，担任南方恒生ETF基金经理，2015年4月至今，任南方中证500工业ETF基金经理，2015年4月至今，担任南方中证500原材料ETF基金经理，2015年4月至今，担任大数据100基金经理，2015年6月至今，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据300、南方500信息、南方重仓优化的基金经理。

孙伟先生，管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格，现任注册会计师（CPA）资格。曾任广东腾讯科技有限公司投行部助理、德佑华永会计师事务所深圳分所审计师。2010年2月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014年12月至2015年6月，担任南方恒生ETF的基金经理助理；2015年5月至今，任南方500工业ETF基金经理；2015年6月至今，任南方500材料ETF基金经理；2015年7月至今，任改革基金、高铁基金、500信息基金经理。

1.2.5投资决策委员会成员
 总裁杨小松先生，副总裁兼固定收益投资总监、南方东英资产管理（中国）（香港）董事李海鹏先生，总裁助理兼权益投资总监曹伟先生，交易管理部副总监王珂女士，投资部总监陈健先生，专户投资管理部总监蒋巍先生，固定收益投资总监雷俊先生，数量化投资部总监刘治平先生。

1.2.6上述人员之间不存在近亲属关系。
2 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：刘士春
 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：中国证监会证监基金字[1998]123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：林森

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中国工商银行全部资产、负债、业务、机构网点及员工。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年被美国《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年荣获“金牌理财师”TOP100颁奖典礼；中诚信实发，获“最佳托管银行”奖。2014年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管业务始于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准设立，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，并先后经安监会核准开展基金托管业务系统。

2.1主要人员情况
 中国农业银行总行设资产托管部现有员工140余人，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，服务团队业务专业水平高、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
 截止至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
 严格遵照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，守法合规、规范运作，严格监查、确保业务的安全运行，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.内部组织结构
 中国农业银行总行设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及内部控制工作进行监督和评价。托管业务部下设托管风险管理处，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责。

3.内部控制措施及措施
 具备系统、完善的风险控制体系，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、检查、抽查制度，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；业务操作区实行门禁管理，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予以以下方式的处理：

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。对某项投资比例接近超标、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。

3 服务机构

3.1.1申购赎回代理证券公司

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路228号 法定代表人：吴万善 联系人：陈琳 联系电话：(0755-8282193) 客服电话：96597 公司网站：http://www.htsec.com.cn 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国际大厦14楼1401室 办公地址：深圳罗湖区红岭中路1012号国际大厦14楼1401室 联系人：何翔 联系电话：(0755-82130833) 联系人：何翔 联系电话：(0755-82133562) 客服电话：96588 网址：www.htsec.com.cn
2	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市红岭中路1012号 法定代表人：何翔 联系电话：(0755-82130833) 联系人：何翔 联系电话：(0755-82133562) 客服电话：96588 网址：www.guosen.com.cn
3	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座16层 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座16层 法定代表人：陈有安 联系人：陈琳 联系电话：(010)-66568820 客服电话：4008-888-888 公司网站：www.chinastock.com.cn
4	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座4-10层 法定代表人：黄钦 联系人：黄钦 联系电话：(0755-82961657) 客服电话：96565、4008881111 公司网站：www.newone.com.cn
5	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闻路1508号 办公地址：上海市静安区新闻路1508号 法定代表人：薛峰 联系人：薛峰 联系电话：(021-22169999) 客服电话：96252、10108888 公司网站：www.ebscn.com
6	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27楼A02单元 办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦27楼A02单元 法定代表人：牛冠益 联系人：陈琳 联系电话：(0755-82529561) 客服电话：4008001001 公司网站：www.aesec.com.cn
7	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19号楼 办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院19号楼 法定代表人：张志刚 联系人：张志刚 联系电话：(010)-63081000 客服电话：(010)-63080978 公司网站：www.cindasc.com
8	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市四川中路33号 办公地址：上海市四川中路33号久事商务大厦 法定代表人：秦敬涛 联系人：秦敬涛 联系电话：(021-63399388) 客服电话：(021-63392518) 传真：(021-63396010, 021-63396200) 网址：www.962518.com
9	渤海证券股份有限公司	注册地址：天津经济技术开发区第二大街40号401室 办公地址：天津市南开区滨水西道30号 法定代表人：王春峰 联系人：王春峰 电话：(022-28461891) 传真：(022-28461892) 客服电话：400-651-5888 网址：www.bhsc.com.cn
10	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街5号 办公地址：苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：吴卫 联系人：吴卫 联系电话：(0512-65681166) 客服电话：(0512-65680201) 公司网站：www.dwzq.com.cn
11	西南证券股份有限公司	注册地址：重庆江北区桥北苑正北第二大道40号宇轩大厦101室 办公地址：重庆市江北区桥北苑正北第二大道40号宇轩大厦101室 法定代表人：余维佳 联系人：张微 电话：(023-67339633) 传真：(023-67339611) 客服电话：(023-6789-096) 网址：www.swsc.com.cn
12	财达证券股份有限公司	注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号中电金谷大厦22-24层 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号中电金谷大厦22-24层 法定代表人：杨建祥 联系电话：(0311-66603432) 客服电话：4006-129988 公司网站：www.c10data.com
13	德邦证券股份有限公司	注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢909号 办公地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢909号 法定代表人：姚文平 联系人：朱松 电话：(021-68701616) 传真：(021-68701616) 客服电话：4008881128 网址：www.tebon.com.cn
14	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华融国际大厦22-24层 办公地址：湖南省长沙芙蓉中路2段华融国际大厦22-24层 法定代表人：邓辉 联系人：邓辉 联系电话：(010)-68467099 客服电话：(010)-68467099 公司网站：www.fundao.com.cn

3.1.2二级市场交易代理证券公司
 包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司
3.2登记机构
 名称：中国证券登记结算有限责任公司
 住所：办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
 法定代表人：周明
 联系人：陈文平
 电话：(021-68419036
 传真：(021-68870311
3.3出具法律意见书的律师事务所
 名称：广东华瀚律师事务所
 注册地址：深圳市福田区岗厦东路上1002号宝安广场A座16楼E11室
 负责人：李兆良
 电话：(0755)82687860
 传真：(0755)82687861
3.4审计机构会计师事务所
 名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
 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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
 法定代表人：李丹
 联系电话：(021)22323888
 传真：(021)22323880
 联系人：陈熹
 经办注册会计师：薛竞、陈熹

4 基金名称
 中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金

5 基金的类型
 股票型证券投资基金

6 基金的投资目标
 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

7 基金的投资策略
 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生品工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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）。在建仓完成后，本基金投资标的指数的成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%，且不低于非现金基金资产的80%。

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。

8 基金的投资策略
8.1投资策略
 本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数的成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生派发股利、增发、分红等行为时，或因基金申购和赎回等因素导致基金跟踪标的指数的效果可能带来跟踪误差时，或因某些特殊事件导致跟踪误差不足时，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进行适当调整和跟踪误差最小化。

基金管理人根据基金合同规定复制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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（未经审计）。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	权益投资	47,176,737.16	77.68
2	其中：股票	47,176,737.16	77.68
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	13,467,173.91	22.17
11	其他资产	89,974.99	0.15
12	合计	60,722,886.06	100.00

注：上表中的股票投资项可替换为公允价值增值，而5.2的合计项中不可含替代性股票投资。

（二）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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,268,960.31	48.35
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、软件和信息技术业	17,320,836.85	28.61
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	合计	586,950.00	0.97
T	合计	47,176,737.16	77.93