

# 深证成长40交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第1期）

基金管理人：大成基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
二〇一八年八月  
重要提示  
深证成长40交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2010年10月27日证监许可【2010】1478号文核准募集，本基金的基金合同于2010年12月21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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明中国证监会对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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本基金更新的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
本更新招募说明书已经基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2018年6月21日（其中人员变动信息以公告日为准），有关基金投资组合及财务数据截止日为2018年3月31日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

（一）基金管理人概况  
名称：大成基金管理有限公司  
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层  
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层  
设立日期：1999年4月12日  
注册资本：贰亿元人民币  
股权结构：公司股东为中信信托有限责任公司（持股比例50%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例25%）、光大证券股份有限公司（持股比例25%）三家公司。

法定代表人：刘卓  
电话：0755-83183388  
传真：0755-83199688  
联系人：肖剑

（二）主要人员情况  
1、公司高级管理人员  
董事会：

刘卓先生，董事长，工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市、哈尔滨银行股份有限公司、中信信托有限责任公司；2007年6月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008年8月，任哈尔滨银行股份有限公司董事兼党委书记；2012年4月，任哈尔滨银行股份有限公司副董事长；2012年11月至今，任中信信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司副董事长。

新天鹏先生，副董事长，国际法硕士。1991年7月至1993年2月，任职于共青团河南省委；1993年3月至12月，任职于深圳国际经济与法律咨询公司；1994年1月36月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994年7月至1997年4月，任职于深圳招商港务股份有限公司；1997年5月至2015年1月，先后任光大证券股份有限公司南方总部研究部研究员、南方总部机构管理部总经理、光大证券股份有限公司业务管理部总经理助理、资产管理部总经理助理（主持工作）、法律合规部副总经理、零售交易业务管理部总经理；2014年10月，任大成基金管理有限公司副董事长；2015年8月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。

罗晓鹭先生，董事，总经理，厦门大学经济学博士。具注册会计师、分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格，国家“千人计划”专家，曾任毕马威（KPMG）法律诉讼部资深顾问、金融部资深顾问，以及SLOG证券诉讼和法律咨询合伙人；2009年至2012年，任中国证监会上市公司并购重组专家咨询委员会、机构部副处负责人；2013年2月至2014年10月，任中信并购基金管理有限公司董事总经理、投委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年8月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士（EMBA），上海市黄浦区政协委员。1987年8月至1993年4月，任厦门大学财经系教师；1993年4月至1996年8月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996年8月至1999年2月，任人民日报社证券发展部企业管理处处长；1999年2月至2018年2月任职于中信信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现为中信信托有限责任公司董事。

孙学林先生，董事，硕士研究生。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司党委书记、总裁助理，兼任投资二部总经理兼资产管理负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起，兼任中国银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士，独立董事，经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师，中国人民大学艺术品金融研究所所长。

叶林先生，独立董事，法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任，博士生导师，国家社会科学基金项目基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士，独立董事，金融学博士，现任东北财经大学讲师，教研室主任，东北财经大学金融学院金融数学专业负责人，东北财经大学开发金融研究中心助理研究员，主要从事金融数学、风险管理、银行证券业务方面的研究。参与两项国家自然科学基金、二项国家社会科学、三项省部级社会科学、一般项目、多项省部级创新团队项目，并负责撰写项目总结报告，在国内外核心期刊发表多篇学术论文。

金李先生，独立董事，博士，现任英国牛津大学商学院终身教授暨教授（博士生导师）和北京大学光华管理学院讲席教授（博士生导师），金融系联合系主任、院长助理，北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年，并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会：

许国新先生，监事会主席，中国人民大学国际经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长、东京代表处代表、研究局调研员，金融稳定局体处处长；2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限公司资产管理部主管；2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委书记；2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记；2010年6月至2014年3月兼任北京银利吉星创业投资有限公司董事长；2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事；2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记；2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（于2017年11月）及法定代表人；2018年3月加入大成基金管理有限公司，任监事会主席。

蒋卫强先生，职工监事，经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州雄志和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新和电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司，历任信息技术部系统开发人员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监、风险管理部副总监，现任信息技术部总监。

吴旌女士，职工监事，文学学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所，2010年6月加入大成基金管理有限公司，历任计划财务部财务主管、总监助理，现任计划财务部副总监。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司，2015年1月起任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任驻美国Huntton & Williams国际律师事务所纽约执业律师。中银国际投行董事副总裁，香港三山投资公司董事总经理，标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

周立新先生，副总经理，大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及工委副主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国银河投资管理有限公司燃气战略管理部项目总监。2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务部总监助理、市场部副经理，上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理。2015年8月起任公司副总经理。

谭晓风先生，副总经理，哈佛大学公共行政管理硕士。曾任财政部世界银行司科长，世界银行中国扶贫技术顾问，财政部办公厅处长、全国社保基金理事办办公厅处长、海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

姚东栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于国际商业经济咨询公司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问、国际货币基金组织国际资本市场和非洲部经济学家、原黑龙江省招商局副局长、黑龙江商务厅副厅长、中国人民银行货币政策二司副巡视员、中国人民银行货币政策司副司长，中国人民银行上海研究所所长。2016年5月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

陈海翔先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券南方分公司、平安保险集团公司。曾任华安财产保险有限公司高级投资经理、国瑞瑞银基金管理有限公司固定收益部总监、招商证券资产管理有限公司副经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金业协会，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会媒体公关部负责人、理财及服务管理部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

2、基金经理  
（1）现任基金经理  
张钟玉：会计学硕士。证券从业年限8年。2010年7月加入大成基金管理有限公司，历任研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015年1月14日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深300指数证券投资基金基金经理助理。2015年2月28日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年5月24日任大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年5月24日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

（2）历任基金经理

姓名 担任时间 离任时间  
张钟玉 2015年7月22日 2018年6月21日  
温智敏 2015年6月21日 2018年6月21日

3、公司投资决策委员会（量化投资）  
公司量化投资决策委员会由多名成员组成，设量化投资决策委员会主席1名，其他委员5名。名单如下：

黎新平，基金经理，数量与指数投资部总监，量化投资决策委员会主席；李绍，期货投资部总监，量化投资决策委员会委员；苏秉毅，基金经理，数量与指数投资部副总监，量化投资决策委员会委员；冉凌浩，基金

经理，量化投资决策委员会委员；夏高，基金经理，量化投资决策委员会委员；张钟玉，基金经理，量化投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

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：周慕冰

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：张博

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《世界》世界600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，立足城市和乡村两大市场，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年荣获《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。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3004）认证，表明了独立第三方对中国农业银行托管业务运作流程的风险管理、内部控制制度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》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣授上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年6月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品运作与估值技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监督部、客户管理部，拥有先进的安全防险设施和基金托管业务系统。

主要人员情况  
中国农业银行托管业务部现有员工240名，其中具有高级职业资格者30余人，服务团队成員专业水平高，业务素质好，服务能力强，高级管理人员均持有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。

基金托管业务经营情况  
截至2018年3月31日，中国农业银行托管的公开募集证券投资基金共414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，严格监查，确保业务的健康运行，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，保护基金资产持有人的合法权益。

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及内部控制工作进行监督和评价。托管业务部门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、内部控制措施及措施  
具体系统、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；业务印鉴授权程序严格；审核、稽核、检查制度，授权工作实行集中控制；业务印鉴授权程序严格、规范，账户资料严格管理，制约机制科学合理；业务操作区与会计区分离，封闭管理，实施影像监控；业务信息由系统直接生成和录入，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及《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定及基金管理人提供的相关基金品种输入监控系统，每日对监控系统反馈数据进行稽核和估值，并通过对基金资金账户、基金管理人投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当出现异常交易行为时，基金托管人应当及时与不同情况以下方式进行提示：

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、书面提示：对本基金仓位比例接近红线、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、书面提示：对投资比例超限、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告中国证监会。

三、相关服务机构  
（一）场外代销机构  
1、广州证券股份有限公司  
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼  
法定代表人：丁一雷  
客服电话：95396  
联系人：林洁茹  
电话：020-87322668  
传真：020-87325036  
网址：www.gzsc.com.cn

2、渤海证券股份有限公司  
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  
法定代表人：王春峰  
联系人：蔡煜  
电话：022-28451991  
传真：022-28451892  
客服电话：4006515988  
网址：www.bv.com.cn

3、华泰证券股份有限公司  
办公地址：山东省济南市经十路20618号  
法定代表人：李伟  
客服电话：96538  
联系人：吴昊  
电话：0631-81293938  
传真：0631-81293900  
网址：www.htzq.com.cn

4、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36号国际大厦C座  
法定代表人：陈共炎  
客服电话：4008-888-888  
联系人：宋明  
联系电话：010-66568450  
传真：010-66568690  
网址：www.chinastock.com.cn

5、中航证券有限公司  
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼  
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼  
法人代表：王宜四  
客户服务热线：4008866657  
联系人：戴静  
电话：0791-86768681  
传真：0791-86770178  
网址：www.avicsec.com

6、海通证券股份有限公司  
注册地址：上海市广东路689号  
法定代表人：周杰  
客服电话：95553、400-888-8001  
联系人：李美琦  
电话：021-23219000  
传真：021-63602722  
网址：www.htsec.com

7、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38-45层  
法定代表人：肖遂宁  
客服电话：95565  
联系人：黄莉君  
电话：0755-82960167  
传真：0755-82943636  
网址：www.newone.com.cn

8、光大证券股份有限公司  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：薛峰  
客服电话：400-888-8788、95525  
联系人：刘晨  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
网址：www.ebscn.com

9、申万宏源证券有限公司  
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号40层  
法定代表人：李梅  
客服电话：95523或400895623  
联系人：曹晖  
电话：021-54033888  
传真：021-54038844  
网址：www.swsc.com.cn

10、红塔证券股份有限公司  
注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼  
办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼  
法人：苏海洲  
联系人：杨国萍  
电话：0871-3577398  
传真：0871-35779827  
客服电话：0871-3577942  
公司网址：www.hongtastock.com

11、平安证券股份有限公司  
办公地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼  
法定代表人：曹玉峰  
客服电话：95511转8  
传真：0755-82400862  
网址：www.pingan.com

基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）场内代销机构  
投资者可直接通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

（三）登记结算机构  
名称：中国证券登记结算有限责任公司  
地址：北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人：金颖  
联系人：刘玉生  
电话：010-66213861  
传真：010-59378807

北京市中伦律师事务所  
地址：北京市中伦律师事务所  
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层  
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层  
负责人：王玲  
电话：0755-22163333  
传真：0755-22163390  
联系人：靳庆军、冯义  
（五）会计师事务所和经注册会计师  
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼  
执行事务合伙人：李丹  
电话：021-23238819  
联系人：俞伟敏  
经办会计师：张振波、俞伟敏

四、基金名称  
深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的投资目标  
基金类型：股票型指数基金

基金运作方式：契约型开放式  
紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相近的投资回报。

六、基金的投资范围  
本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股以跟踪标的指数，投资于标的指数的成份股或备选成份股的投资组合不低于基金资产净值的90%，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于新股、债券、货币、权证及中国境内允许基金进行投资的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略  
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，并根据标的指数的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指数造成带来影响，或因某些成份股的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调整和调整，从而使使得投资组合紧密跟踪标的指数。

1、决策依据  
有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制  
本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的责任决策，其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责制定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

3、投资程序  
研究支持：投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事件时召开投资决策会议，决策相关事宜。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资组合的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数的成份股，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数的成份股及其权重的方法构建组合，在追求实现基金投资目标的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监督的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理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，跟踪误差的来源及投资组合策略成功与否，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、成份股股价行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流情况以及组合投资绩效评估的结果等，采取适当的手段对投资组合进行监控和管理，跟踪跟踪标的指数。

基金托管人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化实际需要对上述投资管理程序做出调整，并在更新的招募说明书中公告。

十、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为标的指数的。

十一、基金的风险收益特征  
本基金属股票基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

十二、基金的投资组合报告  
基金托管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。

基金管理人承诺本报告根据基金合同规定，于2018年7月23日复核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2018年3月31日，本报告中列所财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	权益投资	146,425,581.92	98.02
其中：股票	146,425,581.92	98.02	
2	固定收益投资	—	0.00
其中：债券	—	0.00	
资产支持证券	—	0.00	
3	贵金属投资	—	0.00
4	金融衍生品投资	—	0.00
5	买入返售金融资产	—	0.00
其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00	
6	银行存款和结算备付金合计	1,746,127.18	1.18
7	其他资产	5,587.88	0.00
8	合计	148,176,266.98	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	行业名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、业	3,061,872.00	2.06
B	能源、金属、非金属	97,236,775.08	65.73
C	医药、生物、医药、生物	—	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	0.00
E	建筑业	917,980.00	0.62
F	批发和零售业	428,507.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,296,250.00	0.87
H	住宿和餐饮业	—	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,376,036.66	21.21
J	金融业	—	0.00
K	房地产业	10,924,532.80	7.28
L	租赁和商务服务业	—	0.00
M	科学研究和技术服务业	—	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	0.00
O	教育、文体、娱乐和休闲业	—	0.00
P	卫生和社会工作	1,079,771.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	—	0.00
S	综合	146,303,722.51	98.89

2.2报告期末非指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、业	—	0.00
B	能源、金属、非金属	60,956.93	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	0.00
K	房地产业	—	0.00
L	租赁和商务服务业	—	0.00
M	科学研究和技术服务业	—	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	0.00
O	教育、文体、娱乐和休闲业	—	0.00
P	卫生和社会工作	—	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	0.00
S	综合	—	0.00

注：本基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的资产组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束后，本基金的资产组合比例符合基金合同的约定。

十四、费用概况  
（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、基金合同生效后与基金有关的会计师事务所和律师费；  
4、基金的投资管理费；  
5、基金的投资管理费；  
6、基金的投资管理费；  
7、基金的投资管理费；  
8、基金的投资管理费；  
9、基金的投资管理费；  
10、基金的投资管理费；  
11、基金的投资管理费；  
12、基金的投资管理费；  
13、基金的投资管理费；  
14、基金的投资管理费；  
15、基金的投资管理费；  
16、基金的投资管理费；  
17、基金的投资管理费；  
18、基金的投资管理费；  
19、基金的投资管理费；  
20、基金的投资管理费；  
21、基金的投资管理费；  
22、基金的投资管理费；  
23、基金的投资管理费；  
24、基金的投资管理费；  
25、基金的投资管理费；  
26、基金的投资管理费；  
27、基金的投资管理费；  
28、基金的投资管理费；  
29、基金的投资管理费；  
30、基金的投资管理费；  
31、基金的投资管理费；  
32、基金的投资管理费；  
33、基金的投资管理费；  
34、基金的投资管理费；  
35、基金的投资管理费；  
36、基金的投资管理费；  
37、基金的投资管理费；  
38、基金的投资管理费；  
39、基金的投资管理费；  
40、基金的投资管理费；  
41、基金的投资管理费；  
42、基金的投资管理费；  
43、基金的投资管理费；  
44、基金的投资管理费；  
45、基金的投资管理费；  
46、基金的投资管理费；  
47、基金的投资管理费；  
48、基金的投资管理费；  
49、基金的投资管理费；  
50、基金的投资管理费；  
51、基金的投资管理费；  
52、基金的投资管理费；  
53、基金的投资管理费；  
54、基金的投资管理费；  
55、基金的投资管理费；  
56、基金的投资管理费；  
57、基金的投资管理费；  
58、基金的投资管理费；  
59、基金的投资管理费；  
60、基金的投资管理费；  
61、基金的投资管理费；  
62、基金的投资管理费；  
63、基金的投资管理费；  
64、基金的投资管理费；  
65、基金的投资管理费；  
66、基金的投资管理费；  
67、基金的投资管理费；  
68、基金的投资管理费；  
69、基金的投资管理费；  
70、基金的投资管理费；  
71、基金的投资管理费；  
72、基金的投资管理费；  
73、基金的投资管理费；  
74、基金的投资管理费；  
75、基金的投资管理费；  
76、基金的投资管理费；  
77、基金的投资管理费；  
78、基金的投资管理费；  
79、基金的投资管理费；  
80、基金的投资管理费；  
81、基金的投资管理费；  
82、基金的投资管理费；  
83、基金的投资管理费；  
84、基金的投资管理费；  
85、基金的投资管理费；  
86、基金的投资管理费；  
87、基金的投资管理费；  
88、基金的投资管理费；  
89、基金的投资管理费；