

景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金2018年第2号更新招募说明书摘要

重要提示

（一）景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法规募集,并经中国证监会2013年11月25日证监许可【2013】1561号文准予募集注册,本基金的基金合同于2013年12月26日正式生效。

（二）基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

（三）基金的过往业绩并不预示其未来表现。

（四）基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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,并接受《基金法》、基金合同及其他有关规定的约束、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。

（五）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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

（六）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,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF）,将在深圳证券交易所上市。由于本基金的投资标的为证券横跨深圳及上海两个证券交易所,本基金的申购、赎回流程将采用组合证券“场外实物申购、赎回”的模式办理,其申购、赎回流程与仅在深圳或上海交易所上市的中证500ETF产品有所差异。通常情况下,投资人的申购、赎回申请在T+1日确认,申购所得ETF份额及赎回所得组合证券在T+2日可用。如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回,则应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户,且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有,同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。

（七）投资人在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购和/或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作及技术风险、合规风险、本基金的特有风险和其他风险等。本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动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股票市场相似的风险收益特征。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。

（八）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2018年6月26日,有关财务数据和净值信息截止日为2018年3月31日。本更新招募说明书中财务数据未经审计。

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

一、基金管理人
（一）基金管理人概况
名称:景顺长城基金管理有限公司
住所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层
设立日期:2003年6月12日
法定代表人:杨光裕
注册资本:1.3亿元人民币
批准设立文号:证监基金字[2003]176号
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层
电 话:0755-82370388
客户服务热线:400 8888 606
传 真:0755-22381339
联系人:杨阳
股东名称及出资比例:

序号	股东名称	出资比例
1	长城证券股份有限公司	49%
2	景顺资产管理有限公司	49%
3	开诚(集团)有限责任公司	1%
4	大亚实业集团有限公司	1%
	合计	100%

（二）主要人员情况
1.基金管理人董事会成员
杨光裕先生,董事长,工商管理硕士。曾担任江西财经大学教师,江西省审计厅办公室主任,海南汇通国际信托投资公司总会计师,长城证券股份有限公司副总裁,长城基金管理有限公司董事长,兼任长城基金资产管理有限公司董事长。2016年7月加入本公司,任公司董事长。

罗德城先生,董事,工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师,花旗银行投资管理部副总裁,Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员,并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间,担任香港联交所委员会成员,并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

黄海洲先生,董事,工商管理硕士。1992年9月起,历任招商银行股份有限公司深圳蛇口支行会计、工程管理部主任、人力资源部部长,浙江新投投资公司副总经理。2006年5月起担任长城证券副总经理,现任长城证券副总经理、党委委员。

康乐先生,董事,总经理,经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理,景顺投资管理有限公司市场部副经理、北京代表处首席代表,中国国际金融有限公司销售交易部副经理。2011年7月加入本公司,现任公司董事兼副总经理。

伍同明先生,独立董事,文学学士(1972年毕业)。香港会计师公会会员(HKICPA)、英国特许公认会计师(ACCA)、香港执业会计师(CPA)、加拿大公认管理会计师(CMA)。拥有超过二十年以上之会计、审核、管治税务的专业经验及知识,1972-1977受训于国际知名会计师“毕马威会计师事务所”[KPMG]。现为“伍同明会计师事务所”所有者。

靳庆军先生,独立董事,法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专律师,在香港马士打律师事务所、英国律师行Clyde & Co.从事律师工作,1993年发起设立信达信律师事务所,担任执行合伙人。现任杜律师事务所合伙人。

李晓西先生,独立董事。曾任国务院发展宏观经济研究所司长,现任北京师范大学教学委员会副主任,教授、博士生导师;中国社会科学院研究生院教授、博士生导师;教育部社会科学委员会经济学部召集人。

2.基金管理人监事会成员
李翔先生,监事,高级管理人员工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人力资源部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

郭慧娜女士,监事,管理理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师,历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、首席代表、风控部副经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区行政官。

邵媛媛女士,监事,管理学硕士。曾任职于深圳市天健(信德)会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生,监事,工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

3.高级管理人员
杨光裕先生,董事长,简历同上。
康乐先生,总经理,简历同上。
周伟达先生,副总经理,工商管理硕士。曾担任联博香港有限公司分析师、中国研究总监兼上海代表处首席代表、亚洲(除日本外)增长策略投资负责人、高级副总裁,友邦保险有限公司海外分公司资产管理中心副总裁。2014年4月加入本公司,任公司副总经理。

毛从蓉女士,副总经理,经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部,担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司,现任公司副总经理。

黎海威先生,副总经理,经济学硕士。曾担任美国穆迪KVM公司研究员,美国巴克莱集团(原巴克莱国际投资管理有限公司)基金经理、主动股票管理部副总监,香港海通国际资产管理有限公司(海通国际投资管理有限公司)量化总监。2012年8月加入本公司,现任公司副总经理。

赵代中先生,副总经理,理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏银川川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事會境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副经理。2016年3月加入本公司,现任公司副总经理。

吴建军先生,副总经理,经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理,长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司,现任公司副总经理。

刘焕喜先生,副总经理,投资与金融硕士。曾担任武汉大学教师工作处副处长,武汉大学成人教育学院讲师,《证券时报》编辑记者,长城证券研发中心研究员,总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司,现任公司副总经理。

杨卿阳先生,督察长,法学硕士。曾担任黑龙江大庆市红岗区人民法院代理审判员,南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监

注册(办公)地址:深圳市益田路江苏大厦38-45层
法定代表人:吕长林
联系人:黄晔君
电话:0755-82943666
传真:0755-83734343
客户服务电话:400-8888-111,95656
网址:www.newone.com.cn
(8)兴证证券股份有限公司
注册(办公)地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
联系人:林武能
电话:0691-38281978
传真:0691-38507538
客户服务电话:95652
网址:www.xyzq.com.cn
(9)光大证券股份有限公司
注册(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:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务电话:95525,4008888788,10108998
网址:www.ebscn.com
(10)海通证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
联系人:李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客服电话:95553
网址:www.htsec.com
(11)国信证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周杨
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(12)华泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
(13)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
法定代表人:王东明
联系人:顾凌
电话:010-60838888
传真:010-60833739
客服电话:95548
网址:www.cs.citic.com
(14)长江证券股份有限公司
注册(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:奚博宇
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com
(15)东方财富证券股份有限公司
法定代表人:潘鑫军
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层
联系人:胡月茹
电话:021-63325888
传真:021-63326729
客户服务热线:95503
公司网站:http://www.dfzq.com.cn
(16)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层(268061)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层(268061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:95548
网址:www.citicsd.com
2、二级市场交易代理商
包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3.基金管理人可根据有关法律法规,变更、增减销售本基金的销售机构,并及时公告。
（一）登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址: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12号
法定代表人:周明
联系人:崔巍
联系电话:010-59378856
（二）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:021-31358601
经办律师:黎明、孙睿
（三）审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦楼
办公地址:上海市静安区南京西路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:许康玮、朱宏宇

四、基金的基本情况
景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
七、基金的投资方向
本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%。

此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生品工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、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)、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,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)。
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。

八、基金的投资策略
本基金以中证500指数为标的指数,采用完全复制法,即以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。因特殊情况(包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它法律原因导致本基金管理人对该标的指数的跟踪构成严重制约等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以期在规定的风险承受范围之内,尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差率不超过2%。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据股指期货管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

九、业绩比较基准
本基金的标的指数及业绩比较基准为:中证500 指数。
如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,或由于指数编制方法等重大变更导致上述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时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,通过适当的程序变更本基金的标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。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),无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数,报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动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股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告(未经审计)
景顺长城基金管理人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。

基金托管人中国银行根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证报告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	303,969,041.52	97.46
2	其中:股票	303,969,041.52	97.46
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	金融衍生品投资	-	-
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	7,902,281.92	2.53
11	其他资产	8,050.01	0.00
12	合计	311,899,373.45	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	4,734,776.38	1.52
B	采矿业	9,736,562.85	3.13
C	制造业	179,954,418.89	57.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,442,586.64	3.03
E	建筑业	6,420,242.70	2.06
F	批发和零售业	16,126,338.76	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	9,242,679.33	2.97
H	住宿和餐饮业	406,504.00	0.13
I	信息技术、软件和信息技术服务业	28,522,044.38	9.16
J	金融业	5,302,003.68	1.70
K	房地产业	18,414,124.04	5.91
L	租赁和商务服务业	5,717,240.04	1.84
M	科学研究和技术服务业	552,984.20	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,551,199.06	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	347,076.00	0.11
Q	卫生和社会工作	630,000.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	4,224,519.78	1.36
S	综合	1,384,066.00	0.44
合计		303,720,406.23	97.51

2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	4,734,776.38	1.52
B	采矿业	9,736,562.85	3.13
C	制造业	179,954,418.89	57.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,442,586.64	3.03
E	建筑业	6,420,242.70	2.06
F	批发和零售业	16,126,338.76	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	9,242,679.33	2.97
H	住宿和餐饮业	406,504.00	0.13
I	信息技术、软件和信息技术服务业	28,522,044.38	9.16
J	金融业	5,302,003.68	1.70
K	房地产业	18,414,124.04	5.91
L	租赁和商务服务业	5,717,240.04	1.84
M	科学研究和技术服务业	552,984.20	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,551,199.06	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	347,076.00	0.11
Q	卫生和社会工作	630,000.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	4,224,519.78	1.36
S	综合	1,384,066.00	0.44
合计		303,720,406.23	97.51

2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

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组合明细

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	600516	方大炭素	82,800	2,194,200.00	0.70
2	002422	科伦药业	64,200	2,041,650.00	0.66
3	600176	中国巨石	130,274	2,024,457.96	0.65
4	002405	四维新新	76,279	1,967,988.20	0.63
5	000661	长春高新	10,015	1,838,563.70	0.59
6	603019	新泉股份	33,600	1,838,266.00	0.59
7	603031	生物股份	66,881	1,830,589.42	0.59
8	600525	中国国贸	98,039	1,747,054.98	0.56
9	000798	北新建材	66,538	1,675,426.94	0.54
10	002271	东方雨虹	39,332	1,614,971.92	0.52

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组合

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	300564	天邑股份	3,092	57,598.22	0.02
2	600529	湖南盐业	5,836	44,547.22	0.01
3	002530	四川智慧	2,467	36,660.62	0.01
4	300634	新泉股份	2,058	34,203.96	0.01
5	603897	长顺科技	1,595	28,167.70	0.01

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投资。

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。

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五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

10.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

11.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

12.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

13.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

14.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

15.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

16.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

17.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

18.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

19.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

20.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

21.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

22.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

23.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

24.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支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,384.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,666.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	8,050.01

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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分无。

十二、基金的投资
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代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2018年3月31日。

1.净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率-业绩比较基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③	
2013年12月26日至2013年12月31日	-0.39%	0.17%	0.54%	1.36%	-0.93%	-1.19%
2014年	39.79%	1.18%	39.01%	1.24%	0.96%	-0.06%
2015年	42.24%	2.81%	43.12%	2.62%	-0.88%	-0.01%
2016年	-17.82%	1.80%	-17.78%	1.90%	-0.04%	-0.04%
2017年	2.25%	0.91%	-0.20%	0.93%	2.45%	-0.02%
2018年1月1日至2018年3月31日	-1.91%	1.47%	-2.18			