

中证500沪市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2期

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
二〇一八年十月

重要提示
中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2012年6月25日证监许可【2012】1851号文核准募集，本基金基金合同于2012年8月24日生效。

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。
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，投资者申购基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

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本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截至日为2018年8月24日（其中“人员变动内容”的更新以公告日期为准），有关基金投资组合及财务数据截止日为2018年6月30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：公司股东为华泰信托有限责任公司（持股比例60%）、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委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司；2007年6月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008年9月，任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书；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，任中泰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董事长。
靳天鹏先生，副董事长，国际法学硕士。1991年7月至1993年2月，任职于共青团河南省委；1993年9月至12月，任职于深圳市国际经济与法律咨询有限公司；1994年1月至6月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994年7月至1997年4月，任职于蛇口招商港务股份有限公司；1997年9月至2015年1月，先后任光大证券有限责任公司南方总部研究员，南方总部机构管理部副总经理，光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理，资产管理部投资部副总经理（主持工作），法律合规部副总经理，零售业务部总经理助理；2014年10月，任大成基金管理有限公司董事；2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。
罗毅先生，董事，总经理，耶鲁大学金融学博士。注册金融分析师(CFA)，金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律税务部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及SLCC证券诉讼和咨询公司合伙人；2009年至2012年，任中国证券监督管理委员会规划处专家顾问小组成员、机构部创新处负责人；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，执委会委员。2014年11月26日起任大成基金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，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999年2月至2018年2月，任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现为中泰信托有限责任公司董事。

孙学林先生，董事，硕士研究生。注册注册会计师、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委员、总裁助理，兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起，兼任镇江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，国家社会科学重点基地中国民商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国家级教学团队成员，东北财经大学开发金融研究中心助理研究员，主要从事金融产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育人文社会科学一般项目、多项省部级创新团队项目，并负责撰写项目总结报告，在国内财经类期刊发表多篇学术论文。
李金先生，独立董事，博士。现任英国牛津大学商学院终身教授、正教授（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：
许国平先生，监事会主席，中国人民大学国民经济学博士。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，研究员调研员，金融稳定局体改处处长；2006年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任；2006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、党委委员；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；2016年6月至2014年3月兼任北京银河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（至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月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务高级程序员。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、风险管理部总监，现任信息技术部总监。
吴晖女士，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，历任计划财务部高级会计师、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。

其他高级管理人员：
肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳南山区委（政府）办公室主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广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。曾任职于英国Huntton & Williams国际律师事务所纽约分所、中银国际投行行业部副总裁，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。曾任新疆精河县县委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、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、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2006年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务部中心总监助理，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。
谢晓风先生，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，世界银行中国执笔技术顾问，财政部办公厅处长，全国社保基金理事会办公厅处长、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。
姚春栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委员会、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部和非洲部经济学家，原黑龙江省政府招商局局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副巡视员，中国人民银行货币金银部副司长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9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。

陈翔凯先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司，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，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监，招商证券资产管理有限公司副总经理。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。曾任职于中国证券业协会资格管理部，督察联络部。基金公司会员部，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。先后历任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构负责人。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
苏秉毅，经济学硕士。证券从业年限14年。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成深沪300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起担任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
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6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任；李昭，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；申涛清，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；张传兵，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）基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖百肆拾叁仟捌佰柒拾玖万玖仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：刘卓
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：(010) 66594942
中国银行客服电话：95566
（二）基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具备海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QDII、ROP、ODI、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。
（三）证券投资基金托管情况
截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、混合型、货币型、指数量、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（四）托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的重要组成部分，秉承“中国银行风险管理控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则，中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、内控体系建设及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全面、全程的风险管控。
2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双重标准的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。
（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，并及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）场外代销机构
1. 财富证券有限责任公司
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表：蔡一兵
客户服务热线：0731-84403333、400-888-36316
网址：www.cfzq.com
2. 东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
电话：021-20333333
传真：021-50498825
联系人：王一彦
客服电话：95531、400-888-588
网址：www.longone.com.cn
3. 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
4. 广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
客服电话：95575
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555005
网址：www.gf.com.cn
5. 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
客服电话：95521
联系人：芮筱婷、朱薇敏
联系电话：021-38676666
传真：021-38670161
网址：www.gtja.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：王浩
客服电话：95553、400-888-8001
电话：021-38882522
传真：021-63602822
网址：www.htsec.com
7. 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：芮雨林
联系人：高国泽
联系电话：0871-3577398
传真：0871-3578827
客服电话：0871-3577942
公司网址：www.hongtastock.com
8. 申万宏源证券有限公司
通讯地址：上海市徐汇区长乐路969号40层
法定代表人：李梅
客服电话：95523或4008896523
联系人：曹辉
电话：021-54033888
传真：021-54038404
网址：www.swhyc.com
9. 西南证券股份有限公司
办公地址：重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：余维坤
客服电话：400899096
联系人：张煜

联系电话：023-63796633
网址：www.swsc.com.cn
10. 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C座
法定代表人：宋卫刚
客服电话：4008-888-888
联系人：宋明
联系电话：010-66586450
传真：010-66568990
网址：www.chinastock.com.cn
11. 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：李积林
客服电话：95565
联系人：黄婵娟
电话：0755-82960167
传真：0755-82943636
网址：www.newone.com.cn
12. 中国中投证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：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：高涛
客服电话：400 600 8008
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
网址：www.china-invanc.com
13. 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
法定代表人：张佑君
客服电话：010-84588888
联系人：顾凌
电话：010-60838696
传真：010-84865660
网址：www.cs.ecitic.com
14. 华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人：周易
客服电话：4008-888-168、95597
联系人：庞晓芸
电话：0755-82491293
传真：0755-82492962
网址：www.htsc.com.cn

（二）场内代销机构
场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销售资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的，可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务，为各类客户提供个性化托管增值服务的境内领先的中型中资托管银行。
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（三）网下现金发售直销机构
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
法定代表人：刘卓
电话：0755-83183388
传真：0755-83199688
联系人：姚校
公司网址：www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途话费）
（四）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：周明
电话：010-50938782
传真：(010) 50938907
（五）律师事务所和经办律师
名称：北京市中银律师事务所
注册地址：北京市朝阳区东三环中路财富中心写字楼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
经办律师：靳庆军、冯义
联系人：冯义
（六）会计师事务所和经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所
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
执行事务合伙人：吴港平
电话：(010) 58153000、(0755) 25028288
传真：(010) 85188298、(0755) 25026188
签章注册会计师：吕华、高鹤
联系人：吕华

4. 基金名称
中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金
5. 基金的类型
股票型指数基金
6. 基金的运作方式
交易型开放式
7. 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的最小化。
8. 基金的投资范围
本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股。
为更好地实现本基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和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，基金管理人将在履行适当程序后，将其纳入投资范围。
本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的相关规定执行。
9. 基金的投资策略
本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，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。
本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生品金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生品工具。本基金股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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 and 跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

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投资决策依据。
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对标决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理依据委员会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，定期召开或临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，每日进行基金投资决策的日常决策。
（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数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，成份股将采取适当的方法，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，同时履行一线风险监控的职责。
（5）投资绩效评估：风险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，组合跟踪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、成份股公司行为、流动性状况、基金申购赎回带来的现金流量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调整，密切跟踪标的指数。
基金管理人将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。本基金标的指数为中证500沪市指数（代码：000802）。
如果指数编制单位变更或停止中证500沪市指数的编制及发布，或中证500沪市指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致中证500沪市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，在履行适当的程序后，变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。
标的指数更换后，业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据需要替换或删减基金名称中与原标的指数相关的符号或字样。

十一、基金的风险收益特征
本基金为股票基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型股票基金，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股票市场相似的风险收益特征。
十二、基金的投资组合报告
基金管理人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股份有限公司，于2018年9月5日复核了本报告中与财务指标、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6月30日，本报告中列明财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33,834,323.04	98.30
2	其中：股票	33,834,323.04	98.30
3	固定收益投资	-	0.00
4	其中：债券	-	0.00
5	资产支持证券	-	0.00
6	贵金属投资	-	0.00
7	衍生品投资	-	0.00
8	其他资产	584,622.13	1.70
9	其他负债	361.34	0.00
9	合计	34,419,005.17	100.00

2. 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	20,688.00	0.07
B	采矿业	1,381,501.22	4.63
C	制造业	19,234,075.67	56.14
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	1,238,579.46	3.82
E	建筑业	324,748.08	0.96
F	批发和零售业	2,528,555.43	7.38
G	交通运输、仓储和邮政业	2,465,594.28	7.20
H	住宿和餐饮业	391,300.00	1.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,199,864.50	3.50
J	金融业	2,271,184.00	2.12
K	房地产业	2,366,084.61	6.91
L	租赁和商务服务业	332,576.27	0.97
M	科学研究和技术服务业	123,449.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	238,739.02	0.70
O	医药、生物和其他服务业	-	0.00
P	教育	52,353.00	0.15
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	625,599.98	1.83
S	综合	362,372.10	1.06
	合计	33,764,885.94	98.56

（2）报告期末非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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	-	0.00
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	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	医药、生物和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	69,438.00	0.20
S	综合	-	0.00
	合计	69,438.00	0.20

（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
（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组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600319	中国平安	9,560	436,760.00	1.27
2	600621	华域汽车	35,794	419,120.76	1.22
3	600426	华鲁恒升	22,773	418,127.07	1.22
4	600030	中信股份	24,466	418,130.00	1.22
5	600389	安子母	6,200	397,130.00	1.13
6	600288	包装数码	10,339	389,574.40	1.10
7	600256	广汇能源	84,540	347,980.00	1.01
8	600984	长春科技	19,562	337,980.00	0.99
9	601233	明微电子	19,000	329,213.00	0.96
10	600972	中国国旅	11,695	327,460.00	0.96

（2）报告期末非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	600883	博通转债	16,300	69,438.00	0.20

（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五名债券投资组合
本基本报告期末未持有债券。
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组合
本基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组合
本基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十名资产支持证券投资明细
本基本报告期末未持有资产支持证券。
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衍生品投资明细
本基本报告期末未持有衍生品。
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十名贵金属投资组合
本基本报告期末未持有贵金属。
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投资组合
本基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十名资产支持证券投资明细
本基本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资组合
本基本报告期末未持有贵金属。
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衍生品投资组合
本基本报告期末未持有衍生品。
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十名资产支持证券投资明细
本基本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资组合
本基本报告期末未持有贵金属。
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投资组合
本基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十名资产支持证券投资明细
本基本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资组合
本基本报告期末未持有贵金属。
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投资组合
本基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十名资产支持证券投资明细
本基本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资组合
本基本报告期末未持有贵金属。
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投资组合
本基本报告期末未持有权证。
25. 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
本基本报告期末未持有资产支持证券。
26. 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组合
本基本报告期末未持有贵金属。
27. 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组合
本基本报告期末未持有权证。
28. 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
本基本报告期末未持有资产支持证券。
29. 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组合
本基本报告期末未持有贵金属。
30. 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组合
本基本报告期末未持有权证。
31. 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