

上证非周期行业100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2号)

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2011年2月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】268号文核准募集。本基金的基金合同于2011年4月22日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

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。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接受基金合同的承认和接受，并按照《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。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在申购本基金时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2018年10月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：海富通基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
法定代表人：张文伟
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38690999
联系人：吴晨霞
注册资本：1.5亿元人民币
股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。

（二）主要人员情况
张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理，海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理，华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事办秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑敏女士，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司私人客户部宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业金融部负责人、客户服务部副总经理、企业金融部总经理兼海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres（陶尔丝）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。Alexandre Wernotzky（韦弗山先生），董事，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月任法国兴业银行投资银行全球市场部执行董事、中国业务开发负责人职务；2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼顾问、常务副总经理职务；2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

Marc Baynot（巴约特）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士，布鲁塞尔大学金融学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事总经理、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事，现任Pioneer投资公司（米兰、都柏林、卢森堡）独立董事、Fundeconnect独立董事长和法国巴黎银行B Flexible SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张肇卿先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年4月至今退休。

杨仓兵先生，监事长，管理学学士。历任安徽省农业科学院计划财科科长，安徽三鼎药业有限公司财务干部、经理，海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理，上海海振实业发展有限公司总经理，海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理部总经理。

Bruno Weil（魏德语）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东亚地区负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投资业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司，历任产品及创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

吴万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、助理理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司监事。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶网维先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务部副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树芳先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长、魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师，基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起任海富通上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接、海富通上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、海富通中证100指数（LOF）、海富通中证内地低碳指数的基金经理。

纪绍凯先生，上海财经大学统计学硕士，历任天天证券上海自营分公司衍生品部投资经理、期权交易职位。2017年7月加入海富通基金管理有限公司，任投资经理。2018年7月起任海富通上证周期ETF的基金经理助理。

本基金历任基金经理为刘璇女士，任职时间为2011年4月至2018年8月。

投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固定收益投资总监；杜晓海，量化投资部总监；王金祥，研究部总监；陈秋平，固定收益投资部总监；赵赫，年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况
名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满
注册资本：人民币36,640,625.71万元
联系电话：010-66105790
联系人：郭明

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）
1）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：周杰
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
客户服务电话：95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com
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
办公地址：天津市南开区滨水西道8号
客户服务电话：4006515898
联系人：王星
网址：www.bhsc.com.cn
3）财信证券股份有限公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人：蔡一兵
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
客户服务电话：95317或4008835316
联系人：郭嘉
网址：www.cfzq.com
4）长城证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层
法定代表人：丁益
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
客户服务电话：4006666888
联系人：金夏
网址：www.cgws.com
5）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特8号
法定代表人：尤力贵
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
客户服务电话：95579或4008888999
联系人：奚博怡
网址：www.95579.com
6）东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层
法定代表人：魏庆华
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
客户服务电话：95309
联系人：汤漫川
网址：www.dxzq.net
7）方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路华鑫国际大厦24楼
法定代表人：高利
办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层
客户服务电话：95571
联系人：程博怡
网址：www.foundersc.com
8）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：杨建红
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29F
客户服务电话：95521
联系人：钟伟祺
网址：www.gtja.com.cn
9）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
法定代表人：何如
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层
客户服务电话：95536
联系人：周杨
网址：www.guosen.com.cn
10）国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市梅山路18号
法定代表人：蔡咏红
办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座
客户服务电话：956578或4008888777
联系人：李秦
网址：www.gyzq.com.cn
11）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
法定代表人：李素明
办公地址：云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦7-11楼
客户服务电话：4008718880
联系人：刘晓明
网址：www.hongtastock.com
12）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45层
法定代表人：李梅
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话：95523或4008895523
联系人：陈敏
网址：www.swhysc.com
13）江海证券股份有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：赵洪波
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
客服电话：4006662288
联系人：周俊
网址：www.jhzq.com.cn
14）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：刘世田
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
客户服务电话：95511-8
联系人：周健
网址：stock.pingan.com
15）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经二路86号
法定代表人：李玮
办公地址：山东省济南市市中区经二路86号
客户服务电话：95538
联系人：王晋华
网址：www.zts.com.cn
16）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
法定代表人：杨华辉
办公地址：福建省福州市湖东路268号证券大厦17楼
客户服务电话：95562
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn
17）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至45层
法定代表人：李玮
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
客户服务电话：95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn
18）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2-6层
法定代表人：陈其华
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
客户服务电话：4008888888或95551
联系人：辛国欣
网址：www.chinastock.com.cn
19）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
办公地址：北京市东城区朝内大街188号

客户服务电话：95587或4008888108
联系人：许梦圆
网址：www.cscc108.com
20）华宝证券有限责任公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人：陈林
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
客户服务电话：4008209898
联系人：刘闻川
网址：www.cnhsstock.com
21）中航证券有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层
法定代表人：王晓峰
办公地址：北京市朝阳区望京园四区2号楼中航资本大厦
客户服务电话：95335
联系人：王紫雯
网址：www.avicsec.com
22）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：周易
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
客户服务电话：95597
联系人：马艺卿
网址：www.htsc.com.cn
23）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
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
客户服务电话：95548
联系人：王一通
网址：www.csccitic.com
24）华泰证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
法定代表人：姜志军
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观4-3层
客户服务电话：4008895618
联系人：程博怡
网址：www.e618.com
25）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址：西藏拉萨市北京中路101号
法定代表人：陈宏
办公地址：上海市徐汇区汇平南路98号东方财富大厦
客户服务电话：95357
联系人：付佳
网址：www.xzsc.com.cn
26）大同证券有限责任公司
注册地址：山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
法定代表人：董祥
办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心12层
客户服务电话：4007121212
联系人：薛津
网址：www.dtsbc.com.cn
2、二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区月坛南街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：021-58872625；传真：021-68870311
联系人：刘永卫
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼
负责人：韩凯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：王利民
经办律师：秦悦民、王利民
（四）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）
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
经办注册会计师：薛竞、邵晓燕
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：邵晓燕

四、基金的名称

本基金名称：上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：股票型、交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

七、投资方向和范围

基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用完全复制法跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不得超过2%。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。

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进行适当变通和调整，以实现跟踪标的指数的有效控制。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

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

本基金管理人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制定有关指数重大调整的对决决策，其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、投资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、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机结合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要参考。

（2）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

（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制的方式构建成份股及成分股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理部定期和不定定期进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资目标，组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，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体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

4、构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制的原则确定目标组合，其投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，在特殊情况下，需要选择其他股票进行替代的，本基金按照合理方法来选择替代股票。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司基本面等因素的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：确定目标组合及建仓策略后，基金经理在规定时间内采用适当的方法构建和调整投资组合直至达到跟踪指数要求。

5、日常投资组合管理
（1）标的指数成份股日常跟踪
当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他可能会影响成份股在指数中权重的行为时，基金管理人将分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，及时调整股票投资组合。

（2）标的指数的跟踪与分析
如果出现标的指数成分股临时调整、编制方法调整或其他可能影响组合跟踪效果的情形，基金管理人将分析调整对所跟踪标的指数的影响，并及时制定相应的投资组合调整策略。

（3）申购赎回调整
跟踪本基金申购和赎回信息，分析其其对组合的影响。

（4）投资组合的调整：利用数量化分析等方法，寻找将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合调整及交易策略。

（5）制作并公布申购、赎回清单：以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，根据上市公司公告，考虑T日可能发生的上市公司变动情况，设计T日的申购赎回清单并公布。

6、定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：
（1）本基金股票组合将根据标的指数的编制规则，备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

（2）定期分析基金与标的指数的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

（3）根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行定期支付现金的准备。

7、投资绩效评估

（1）每日对基金的绩效评估进行，分析基金跟踪偏离度；
（2）每月末，风险管理部对本基金的运行情况进行量化评估；
（3）每月末，基金经理根据评估报告分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、以及成分股未成成份股的变化等。

建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不得超过2%。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。

九、基金的投资比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证非周期行业100指数。

如果指数编制单位变更或停止上证非周期行业100指数的编制及发布，或上证非周期行业100指数由其他指数替代、或由指数编制方法等发生重大变更导致上证非周期行业100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投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资组合和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应变更基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金，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。

十一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年11月20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止至2018年9月30日（“报告期末”）。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	28,488,164.68	96.88
2	固定收益投资	28,488,164.68	96.88
3	银行存款	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他资产	969,070.00	3.24
8	合计	28,388,799.36	96.96

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	109,400.00	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,445,777.28	63.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,005,000.00	7.80
E	建筑业	2,517,164.41	9.94
F	批发和零售业	933,439.46	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,107,118.81	4.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	469,200.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、医药和保健业	39,760.00	0.16
O	教育	-	-
P	文艺、体育和娱乐业	79,727.00	0.31
Q	其他	26,406,268.68	107.16

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	000039	深物业A	4,396	3,193,760.00	12.63
2	000026	赛迪信息	19,334	1,227,760.00	5.08
3	000007	华明装备	48,136	1,141,320.00	4.69
4	000044	上海临港	25,251	974,804.00	4.04
5	000001	平安银行	94,890	889,400.00	3.57
6	000009	中信证券	145,776	770,260.00	3.12
7	000008	中国国航	8,300	564,160.00	2.31
8	000016	民生银行	34,007	540,312.00	2.24
9	000738	中航电子	69,669	510,467.00	2.13
10	000009	中信证券	29,499	495,760.00	2.06

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