

大成深证成份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
二〇一九年一月

重要提示
大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2015年3月26日证监许可〔2015〕450号文予以注册。基金合同于2015年06月5日正式生效。

本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基金做出的任何决定,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。

本更新招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自基金合同取得基金份额时,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承认和接受基金合同,并自愿遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关投资运作办法、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关投资运作办法、《流动性风险管理规定》等法律法规及基金合同、基金托管协议、基金销售协议的约定,并自行承担投资风险。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者有风险,投资者申购本基金前应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2018年12月5日(其中人员变动信息以公告日为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2018年9月30日,所列财务数据未经审计。

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:公司股东为华泰信托有限公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例26%)、光大证券股份有限公司(持股比例26%)三家公司。

法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑

(二)主要人员情况

1.公司高级管理人员

刘卓先生,董事长,工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委员会、哈尔滨银行股份有限公司、华泰信托有限公司;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月至今年,任华泰信托有限公司监事会主席。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3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,任职于深圳市律师事务所以;1994年7月至1997年4月,任职于蛇口招商局股份有限公司;1997年5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、资产管理部投资副经理(主持工作)、法律合规部副总经理助理,零售业务总部副总经理;2014年10月,任大成基金管理有限公司公司董事;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,耶鲁大学经济学博士。注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询、金融部资深咨询,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咨询专家顾问委员、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首席助理、风控委员会主席。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年3月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

吴庆斌先生,董事,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券、虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(广)投资有限公司等机构;2012年7月至今,任广联(广)投资有限公司董事长;2012年起任职于华泰信托有限公司;2013年6月至今,任华泰信托有限公司董事长。

孙学林先生,董事,硕士研究生。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董事、总裁助理,兼任天津河间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管理研究所所长。

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,博士研究生导师,国家社会科学重点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专业教学团队负责人,东北财经大学开发金融研究中心助理研究员,主要从事金融产业组织理论、银行竞争行为的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省部级创新项目,并负责撰写项目总结报告,在国内外权威期刊发表多篇学术论文。

金李先生,独立董事,博士。现任美国牛津大学商学院终身教职教授(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),金融联合系主任,院长助理,北京大学金融研究中心主任。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董事。

监事会:
许国平先生,监事会主席,中国人民大学国民经济经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际处处长、东京代表处代表,国务院调研局、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公司建行股权投资管理部主任;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;2016年6月至2015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2014年6月任中国银河投资管理有限公司董事;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,经济学博士。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月任杭州新力电子技术开发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、金融工程部高级程序员、监察稽核部总监助理、信息技术部总监、风险管理部副总监、风险管理部副总监,现任信息技术部副总监。

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广聚投资控股有限公司执行董事、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。曾任职于美国Huntton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁,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主任、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改办副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博塔拉蒙古自治州银行书记及工委主任、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、中国华能投资控股有限公司燃气战略管理部经理。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。

谢晓冈先生,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,世界银行中国执快技术顾问,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。

姚余栋先生,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和非洲部经济学家,原黑龙江省招商局副局长,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,中国人民银行货币政策司副司长,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。曾任职于广发证券南方分公司、平安保险集团分公司。曾任华安财产保险股份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,专业联络部,基金业协会会员部,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。曾参与基金业协会备组的筹备工作。曾先后在中国证券投资基金业协会担任教育与媒体公关部负责人、理财及服务市场部负责人。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

苏秦毅,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、高级产品经理、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基金经理。2014年1月24日至2014年12月17日任大成健康主题股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年11月1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基金经理。2012年6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26日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。

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。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沪深300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起担任大成原混合型基金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
公司量化投资决策委员会由6名成员组成,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;李招,期货投资部总监,量化投资决策委员会委员;苏秦毅,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;冉涛浩,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:010-68128116

联系人:贺倩
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、机构网点和员工。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年被英国《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,并获有无保留意见的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(ISA3402)认证,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年首届“金理财”TOP100颁奖典礼中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳托管银行”奖。2012年荣获第十一届中国财经风云榜“最佳托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“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“优秀托管银行奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金业协会授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

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、风险管理部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控合规部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2.主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余人,服务团队成员专业水平高、业务素质好,服务能力强,高级管理人员均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外银行间的运作。

3.基金托管业务经营情况
截止至2018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419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,确保业务的稳健运行,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和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部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.内部控制制度及措施
具备系统、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;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权执行集中控制,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;业务操作程序专门设置,封闭管理,实施影像监控;业务信息由专人负责披露,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,信息技术系统完整、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
基金管理人通过参数设置将《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进行以下方式的处理:

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.书面提示。对本基金投资比例接近超标、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。

三、相关服务机构
(一)销售机构及联系人
1.直销机构
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:0755-83199588
联系人:赵倩
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线:400-888-8888(免长途话费)

(1)大成基金深圳投资理财中心
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:吴海灵、关志玲、白小雪
电话:0755-22223556/22223171/22223556
传真:0755-83195235/83195242/83195232

2.场外代销机构
1.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:010-60888888
联系人:顾凌
电话:010-60838666
传真:010-84865560
网址:www.csccit.com

2.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

3.东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1629号东海证券大厦
法定代表人:李俊杰
客服电话:95531
联系人:梁旭
电话:021-20333333
传真:021-54988825
网址:www.longone.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:010-66568450
传真:010-66568990
网址:www.chinastock.com.cn

5.中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市市南区秦岭路20号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:杨宝林
客服电话:95534
联系人:吴忠超
电话:0532-85820226
传真:0532-85820265
网址:www.zxwt.com.cn

6.万安证券股份有限公司
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400895623

联系人:曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.syywg.com

7.光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闸路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

8.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
客服电话:95536
联系人:周杨
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
网址:www.guosen.com.cn

9.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
客服电话:4008888108
联系人:唐茜
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.cscl108.com

10.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:宫少林
客服电话:95565
联系人:黄辉卿
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn

11.东方财富证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号新源广场二楼22-29楼
法定代表人:潘鑫军
客服电话:95503
联系人:胡月娟
电话:021-63325888
传真:021-63326173
网址:www.dfzq.com.cn

12.华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯华
客户服务热线:4008888818
联系人:金达明
电话:0755-83025723
传真:0755-83025981
网址:www.hx168.com.cn

13.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:上海市浦东新区世纪大道168号上海银行大厦20楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
联系人:芮筱婷、朱雅璇
联系电话:021-38676666
传真:021-38671061
网址:www.gtja.com

14.申万宏源西南证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐齐平高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐齐平高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
电话:010-88085888
传真:010-88085195
联系人:李巍
客服电话:400-800-0652
网址:www.hysec.com

15.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:蔡露
电话:022-28451991
传真:022-28451892
客服电话:4006515888
网址:www.bwh.com.cn

16.中泰证券股份有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.qizq.com.cn

17.西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:余维佳
客服电话:4008060096
联系人:张煜
电话:023-63786633
网址:www.swsc.com.cn

18.上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:李俊杰
客服电话:021-962518,4008918918
联系人:许曼华
电话:021-53519888
传真:021-63860380
网址:www.962518.com

3.场内代销机构
指具有基金代销业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,并及时公告。

(二)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
联系人:赵亦清
电话:(010)50938782
传真:(010)50938907

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
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
经办律师:靳庆军、冯艾
联系人:冯艾

(四)会计师事务所和经办注册会计师
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号展业银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区西藏路202号企业天地32号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238189
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:张振波、俞伟敏

4.基金的名称
大成深证成份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。

八、基金的投资范围
本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为了更好地实现基金的投资目标,本基金还可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)、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或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。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规及监管机构的规定执行。

九、基金的投资策略
本基金采取完全复制法,跟踪标的指数的成份股及其权重,并根据标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期标的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导致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跟踪标的指数的指数。

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工具。

工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,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。

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%,年跟踪误差率不超过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决策的依据。

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基金重大调整的投资策略,其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理负责决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、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机配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:数量投资部依托公司整体研究平台,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、跟踪误差及其归因分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策: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项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,每日进行基金投资管理的日常工作。

(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,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,采取适当的跟踪技术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跟踪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
本基金业绩比较基准为标的指数。

本基金标的指数为深证成份指数(代码:399001)。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为对标的指数的不宜继续作为跟踪标的,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,在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数,业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金的投资范围和投资策略不产生实质性变更,基金经理人应就变更业绩比较基准、标的指数及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,将基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。

十一、基金的风险收益特征
本基金为股票型指数基金,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。

基金托管人中国农业银行根据基金合同约定,于2018年12月19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。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	234,369,234.01	98.36
2	固定收益	234,369,234.01	98.36
3	固定收益投资	-	-
4	债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	非金融投资	-	-
7	金融投资	-	-
8	衍生品投资	-	-
9	其他资产	-	-
10	合计	234,369,234.01	100.00

(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境内股票投资组合

决定涉诉。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定,于2018年12月19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。

(一) 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	234,669,334.01	88.36
	其中:股票	234,669,334.01	88.36
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	3,903,903.57	1.64
8	其他资产	4,790.56	0.00