

# 广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：广发基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
时间：二〇一九年二月

## 【重要提示】

本基金于2014年11月26日经中国证监会证监许可[2014]1269号文准予募集注册。本基金合同于2015年1月8日生效。  
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募集的注册,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。  
投资者有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人及基金托管人实施过程中产生的基金管理风险,基金管理的特定风险等等。本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型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中证全指信息技术指数的表现,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。

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。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所,本基金的申购、赎回采用组合证券“场外实物申购、赎回”的模式进行,其申购、赎回流程与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的ETF产品有所差异。通常情况下,投资者的申购、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。如投资者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,同时用于申购、赎回的深圳证券交易所股票的交易托管券商公司和上海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。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人提醒投资者基金投资的“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。

投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书所载内容截止日为2019年1月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(财务数据未经审计)。

## 第一部分基金管理人

一、概况

- 1、名称:广发基金管理有限公司
- 2、住所:广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848(集中办公区)
- 3、办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
- 4、法定代表人:孙树明
- 5、设立时间:2003年8月5日
- 6、电话:020-83936666
- 全国统一客服热线:95105828
- 7、联系人:邱春辉
- 8、注册资本:1.2688亿元人民币
- 9、股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科城金融创新投资控股有限公司,分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

## 二、主要人员情况

1、董事会成员  
孙树明先生:董事长,博士,高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记,中证机构间报价系统股份有限公司第四届董事会、中国证监会第六届上市公司并购重组专家咨询委员会第四届理事会议事,深圳证券交易所第二届监事会监事,中国上市公司协会第二届理事会兼职副会长,亚洲金融合作协会理事,中国注册会计师协会道德准则委员会委员,广东金融学会副会长,广东省预防腐败工作专家咨询委员会财政金融组副组长,曾任财政部条法司副处长、处长,中国经济开发信托投资公司总经理办公室副主任、总经理助理,中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长,中国银河证券有限公司监事会主席,中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉先生:副董事长,学士,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理,瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

孙晓晓女士:董事,硕士,现任广发证券执行董、副总经理、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事、广发证券股份有限公司监事。曾任广东广发证券公司投资银行部总经理、广发证券有限责任公司资产管理部副总经理,广发证券股份有限公司投资自营部副总经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理,广发证券股份有限公司财务部总经理,证通股份有限公司监事长。

戈俊先生:董事,硕士,高级会计师,现任烽火通信科技股份有限公司总裁,兼任深圳烽火星空通信发展有限公司董事长、烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

霍奕卿女士:董事,硕士,现任深圳香江控股股份有限公司董事长,南方香江集团董事、总经理,香江集团有限公司总裁,深圳市海富实业股份有限公司董事长,兼任全国政协常委,全国工商联常委,中国女企业家协会副会长,广东省妇联副主席,广东省工商联副主席,广东省女企业家协会会长,香江社会救助基金会主席,深圳市深商控股集团股份有限公司董事,广东南粤银行董事,深圳龙岗同安村横岗集团董事。曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人、董事长。

许冬瑾女士:董事,硕士,副主任药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理,兼任世界中联中药饮片质量专业委员会副会长、国家中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、中国中药协会中药饮片专业委员会专家,全国中药标准化技术委员会副主任委员,全国中药标准化技术委员会中药炮制机械分委员会副主任委员,国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工作专家委员会副主任委员,广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。

罗海平先生:独立董事,博士,现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理,集团机关党委书记,兼任银保监会行业风险评估专家,曾任中国人民保险集团公司副党委书记、总经理,太平保险国际保险市场部经理、总经理,汉口分公司党委书记、总经理,太平保险国际保险市场部经理、湖北分公司党委书记、总经理、助理总经理,副总经理兼董事会秘书,阳光财产保险股份有限公司总经理,阳光保险集团执行委员会委员,中华联合财产保险股份有限公司总裁助理、董事长、党委书记。

董茂云先生:独立董事,博士,现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任,复旦大学兼职教授,浙江合创律师事务所兼职律师。曾任复旦大学教授、法学院副主任,法学院副院长,海尔施生物医药股份有限公司独立董事。

姚海鑫先生:独立董事,博士、教授、博士生导师,现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学商学院博士生导师,兼任中国会计教授理事会、东北地区高校财务与会计教师联合会常务理事,辽宁省生产力学会副理事长,东北制药(集团)股份有限公司独立董事,沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长,新华国际商学院党总支书记,新华国际商学院副院长。

2、监事会成员  
符兵先生:监事会主席,硕士,经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长,广东发展银行广州分行支行副行长,总行资金部处长,广发基金管理有限公司广州分公司总经理,市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡亚军女士:股东监事,硕士,高级涉外秘书,现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科城房地产发展公司办公室主任,广州屈臣氏公司行政主管,广州市科达实业发展有限公司办公室主任、总经理,广州巨帆科技股份有限公司法定代表人、董事长兼秘书。

吴晓辉先生:职工监事,硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分会工会主席。曾任广发证券电脑中心副经理、经理。

张成旺先生:职工监事,学士,现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师,广发证券股份有限公司工程师,广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士:职工监事,硕士,现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理,营销服务部总经理助理,产品营销管理部总经理助理。

3、总经理及其他高级管理人员  
林传辉先生:总经理,学士,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理,瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

朱平先生:副总经理,硕士,经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理,广发证券投资银行部华南业务部副总经理,基金科汇基金经理,易方达基金管理有限公司投资部研究负责人,广发基金管理有限公司助理,中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。

易阳方先生:副总经理,硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发聚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发聚丰混合型证券投资基金基金经理,广发聚兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理,瑞元资本管理有限公司董事。

邱春辉先生:督察长,博士。曾任广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理,金融工程部总经理,产品总监、副总经理,广发沪深300指数证券投资基金基金经理,广发中证500指数证券投资基金基金经理,瑞元资本管理有限公司董事。

魏恒江先生:副总经理,硕士,高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。曾任水利部,广发证券股份有限公司工作,历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士:副总经理,硕士,兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国农业科学院助理研究员,中国证监会培训中心、监察局科员,基金监管部副处长及处长,私募基金监管部处长。

张芊女士:副总经理,硕士。兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监,广发纯债债券型证券投资基金基金经理,广发聚源债券型证券投资基金基金经理,广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集裕债券型证券投资基金基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国人保资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司和长城基金管理中心工作,历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理,广发聚源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发安弘回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发集源债券型证券投资基金基金经理,广发集丰债券型证券投资基金基金经理、广发集源债券型证券投资基金基金经理。

王凡先生:副总经理,博士。曾在财政部、全国社保基金理事会、易方达基金管理有限公司工作。

## 4、基金经理

陆志明先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员,深圳证券信息有限公司总监,广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理,广发中中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2011年6月3日至2016年7月28日),广发中中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2011年6月9日至2016年7月28日),广发深证100指数分级证券投资基金基金经理(自2012年5月7日至2016年7月28日),广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理(自2014年10月30日至2016年7月28日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自2015年7月23日至2016年7月28日),广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年7月9日至2016年10月9日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年8月18日至2018年12月20日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年8月18日至2018年12月20日)。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理,广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年6月3日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年12月1日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年1月8日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年1月29日起任职),广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年3月23日起任职)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年4月15日起任职)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年6月6日起任职),广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日起任职),广发中证原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日起任职),广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年7月1日起任职),广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年7月9日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年6月13日起任职)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2017年6月13日起任职)。

霍华明先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析师、ETF基金助理兼研究员,现任广发中证全指医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年4月20日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年4月20日起任职),广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2017年4月20日起任职)、广发中证基建工程指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年2月1日起任职),广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2018年4月19日起任职),广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2018年4月19日起任职)。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第二部分基金托管人

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  
成立时间:1983年10月31日  
法定代表人:陈四清  
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万肆仟贰佰肆拾壹元整  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]24号  
托管部门信息披露联系人:王冰  
传真:010(66594942)  
客服电话:中心电话: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,且具备海外工作经历,学习能力强,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、OFII、ROFII、ODII、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12月31日,中国银行已托管700只证券投资基金,其中境内基金662只,ODII基金38只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、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,基金托管规模位居全球前列。

## 第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构  
1、网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构  
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司为投资者办理本基金的开户、申购等业务:

(1)广州分公司  
地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔10楼  
直销中心电话:020-89899073  
传真:020-89899069 020-89899070

(2)北京分公司  
地址:北京市西城区金融大街9号恒信11层1101单元(电梯楼层12层1201单元)  
电话:010-69083113  
传真:010-69083078

(3)上海分公司  
地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴东路166号905-10室  
电话:021-68885310  
传真:021-68885200

(4)网上交易  
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。  
本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn  
本公司网址:www.gffunds.com.cn  
客服电话:95106828(免长途费)或020-83936999  
客服传真:020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务热线进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、网上现金发售代理机构  
投资者可以到以下销售机构办理本基金的募集期的认购业务:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、大通证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、方正证券、方正证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国信证券、国金证券、国开证券、国联证券、国联证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华融证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中国银河、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)

3、网下股票发售代理机构  
(1)名称:广发证券股份有限公司  
注册地址:广州市天河区河北路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  
联系人:黄岚  
电话:020-87558888  
传真:020-87557985  
客服电话:95575或致电各地营业网点  
公司网站:www.gf.com.cn

(2)名称:华泰证券股份有限公司  
注册地址:南京市中区区江东中路68号  
办公地址:济南市经七路96号证券大厦  
法定代表人:李非  
联系人:吴昊  
电话:0631-68889155  
传真:0631-68889752  
客服电话:95538  
公司网站:www.htsc.com.cn

投资者可直接通过具有基金销售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。详见本基金《发售公告》。  
本基金募集期结束前获得基金代销售资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。  
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  
住所:办公地址:北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人:周明  
联系人:崔巍  
电话:010-50938888  
传真:010-59378907

三、出具法律意见书的律师事务所  
名称:广东广信君达律师事务所  
住所:广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心(广州东塔)110、209层  
负责人:王晓华  
电话:020-37181333  
传真:020-37181388  
经办律师:刘智、林晓鸥  
联系人:刘智  
四、审计基金资产的会计师事务所  
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
办公地址: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  
法人代表:毛贻宁  
电话:020-28812888  
传真:020-28812618

## 第四部分基金的名称

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金  
第五部分基金的类型  
股票型证券投资基金

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 第六部分基金的投资目标

本基金主要投资于标的指数即中证全指信息技术指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括创业板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,以期获得中国股市的长期投资回报。在构建完成后,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或监管机构的规定执行。

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。

## 第七部分基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金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95%。

一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合,但在标的指数的成份股发生变动、配对、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,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,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

在正常情况下,本基金力争跟踪误差的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于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,如期权、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,包括融资融券等。本基金投资股指期货将按照风险管理的原则,以套期保值为目的,力争提高投资效率,降低交易成本,缩小跟踪误差,而非进行投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

1、投资决策依据  
有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金资产的投资依据。

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决定有关标的指数的应对决策,其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序  
研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程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: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、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本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件召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常工作。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要以完全复制标的指数成份股的方法构建组合,在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(4)交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)绩效评估:绩效评估与风险管理定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此总结检讨投资策略,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的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人将根据标的指数成份股及其权重的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资组合做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

决策委员会负责决定有关标的指数的应对决策,其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序  
研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程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: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、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本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件召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常工作。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要以完全复制标的指数成份股的方法构建组合,在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(4)交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)绩效评估:绩效评估与风险管理定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此总结检讨投资策略,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的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人将根据标的指数成份股及其权重的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资组合做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

## 第九部分标的指数和业绩比较基准

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全指信息技术指数。

中证全指信息技术指数由中证指数有限公司在2011年7月11日发布,选取中证全指指数全部样本中属于信息技术行业的个股组成中证全指信息技术指数样本。中证全指信息技术指数以2004年12月31日为基日,基点为1000点,旨在反映沪深两市A股中信息技术行业类股票的整体表现,为投资人投资信息技术行业提供投资标的。

如果指数编制单位变更或停止中证全指信息技术指数的编制、发布或授权,或中证全指信息技术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中证全指信息技术指数不再继续作为标的指数,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,在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,其中,若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于变更标的指数变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致,报中国证监会备案并及时公告。

## 第十部分风险收益特征

本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型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股票市场相似的风险收益特征。

## 第十一部分基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年2月15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至2018年12月31日,本报告中所列数据未经审计。

## 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	340,381,900.15	98.52
	其中:股票	340,381,900.15	98.52
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,061,003.14	1.47
7	其他资产	48,499.92	0.01
8	合计	345,512,203.21	100.00

注:上表中的股票投资项含可替代款估值增值,而下表中的合计项不含可替代款估值增值。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	194,124,870.71	66.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,560,553.16	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	141,815,662.28	41.32
J	金融业	50,146,220.00	14.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	456,347.20	0.13
S	合计	337,034,000.00	0.11
	合计	340,381,613.15	98.68

### (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通过港股通投资股票。

## 3、报告