建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

2019年第2号

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
二〇一九年七月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2018年6月15日证监许可【2018】993号文注册募集。本基金合同已于2018年12月13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投资价值、市场前景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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,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,投资人在投资本基金前,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:因整体政治、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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,汇率风险,本基金的特定风险等。本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金,跟踪恒生中国企业指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资香港联合交易所上市的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

基金合同生效后,本基金的申购赎回采用全现金替代模式,即基金管理人代买代卖的运作模式,申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额和/或其他对价。未来在上海证券交易所和登记机构允许的情况下,本基金将采用港股通股票申购赎回模式,申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。

投资人当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回。在目前的结算规则下,即T日申购的基金份额,T日交收成功后,T+1日可卖出和赎回。投资人当日买入的基金份额,当日可以赎回。投资人认购本基金时需具有上海证券账户,即投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券交易所人民币普通股票账户(简称:股票账户)或上海证券交易所证券投资基金账户。上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要参与基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户。

投资有风险,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》等信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成新基金业绩表现的保证。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,由投资人自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为2019年6月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
设立日期:2005年9月19日
法定代表人:孙志晨
联系人:郭雅莉
电话:010-66228888
注册资本:人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,65%;美国信安金融服务公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利,不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员履职情况。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

孙志晨先生,董事长,1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。2005年9月出任建信基金管理公司总裁,2018年4月起任建信基金管理公司董事长。

张军红先生,董事,现任建信基金管理公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行总行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员,总行零售业务部主任科员,总行个人银行业务部个人存款处副处理、高级副经理,总行行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理,总行投资托管服务部总经理助理、副总经理,总行投资托管业务部副总经理,总行资产托管业务部副总经理。2017年3月出任建信基金管理公司监事会主席,2018年4月起任建信基金管理公司总裁。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行总行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理,北京分行安华支行副行长,北京分行西四支行副行长,北京分行朝阳支行行长,北京分行个人银行部总经理,总行个人存款与投资部总经理助理、副总经理。

张维义先生,董事,现任信安亚洲区总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事,信安北亚地区副总裁、总裁,信安亚洲区总裁。

郑树明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道商级审计经理,新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监,信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。

华淑蕊女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监,锦辉控股集团公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理,财富管理总监兼理财中心总经理,吉林省信托有限责任公司副总经理,光大证券财富管理中心总经理(MD),中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1989年毕业于中国人民银行研究生部,历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员,正大国际财务有限公司总经理助理、资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理、董事总经理。

史亚萍女士,独立董事,现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融硕士;1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理有限公司、中金资本、嘉浩控股有限公司等多家金融机构担任管理职务。

邱靖之先生,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

2、监事会成员

马美萍女士,监事会主席,高级经济师,1984年毕业于中央财政金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984年加入中国建设银行,历任中国建设银行总行筹资储蓄部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理(技术二级),总行个人金融部副总经理,总行个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金管理公司监事会主席。

方蓉敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和英国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与战略研究部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士,2009年获中央财经大学会计专业硕士。曾供职于北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞华恒信会计师事务所,2004年加入中国华电集团,历任中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理,中国华电集团资本控股计划财务部经理、财务部经理,企业融资部经理、机构与风险管理部经理、机构与战略研究部经理。

安晔先生,职工监事,现任建信基金管理公司信息技术总监。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系,获得学士学位。1995年8月加入中国建设银行,历任中国建设银行北京分行信息技术部干部,信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长;2005年8月加入建信基金管理公司,历任基金运营部总经理助理、副总经理,信息技术部执行总经理、总经理,信息技术总监兼金融科技部总经理,信息技术总监。

严冰女士,职工监事,现任建信基金管理公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司,历任人力资源部专员、主管、总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理公司审计部总经理。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位,英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月加入建信基金管理公司,历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资深稽核员、内控合规部副总经理、内控合规部副总经理兼内控合规部审计部(二级部)总经理、审计部总经理。

3、高级管理人员

张军红先生,总裁(简历请参见董事会成员)。

曲寅军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理,行长办公室高级副经理;2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和百麻战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日至2019年3月13日任我公司副总裁,2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理,2017年11月30日至2018年11月1日兼任建信资本管理公司董事长。2019年3月从我公司离任。

张威威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券基金销售业务,任高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴晓明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

马勇先生,副总裁,硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究设计院工作。1998年7月加入中国建设银行总行,历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书,高端客户部总经理助理,财富管理与私人银行部总经理助理、副总经理,建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司,2018年11月13日起任副总裁;2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

4、督察长

吴晓明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。

5、基金经理

薛玲女士,金融工程及指数投资部总经理助理,博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作,任高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作,历任研究员、投资经理;2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部,历任基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门总经理助理,2016年7月4日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2017年5月27日至2018年4月25日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2017年12月20日起任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年3月5日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理;2018年10月25日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

李博涵先生,海外投资部副总经理,硕士,加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司,2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行,任全球资本市场投资助理;2006年8月起加入加拿大帝国商业银行,任全球资本市场投资顾问;2008年8月加入我公司海外投资部,历任高级研究员兼基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门副总经理;2012年8月5日起任建信全球资源混合型证券投资基金的基金经理;2017年11月13日起任建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金的基金经理;2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

龚佳佳先生,硕士。2012年7月至2014年10月在诺安基金管理有限公司数量投资部担任研究员、基金经理助理;2014年10月至2015年3月在工银瑞信基金管理有限公司指数投资部担任量化研究员;2015年3月至2018年5月在华夏基金管理有限公司数量投资部担任研究员、投资经理;2018年5月至今在建信基金管理公司金融工程及指数投资部担任基金经理助理。2019年2月22日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2019年3月7日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

张军红先生,总裁。

赵乐娜先生,总裁特别助理。

梁洪钧先生,金融工程及指数投资部总经理。

梁泉先生,资产配置与量化投资部总经理。

叶乐天先生,金融工程及指数投资部总经理助理。

张戈先生,资产配置及量化投资部总经理助理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")
注册地址:福州市湖东路154号
办公地址:上海市银城路167号
法定代表人:高建平
成立日期:1988年8月22日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号
批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行总行银复[1988]347号
组织形式:股份有限公司
注册资本:207.74亿元人民币
存续期间:持续经营

(二)发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持"真诚服务,相伴成长"的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2018年12月31日,兴业银行资产总额达6.71万亿元,实现营业收入1582.87亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润606.20亿元。

(三)托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(四)基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2019年6月30日,兴业银行共托管证券投资基金267只,托管基金的基金资产净值合计10468.1亿元,基金份额合计10311.43亿份。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

(一)网下现金认购

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台。

(1)直销柜台

名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人:孙志晨
联系人:郭雅莉
电话:010-66228800

2、申购赎回代理券商

(1)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
法定代表人:赵俊
客服热线:4008888588
网址:www.longone.com.cn

(2)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远国际中心37层(华远华中心4、5号楼3701-3717)
法定代表人:施华
客服热线:95571
网址:https://www.foundersc.com/

(3)国泰君安证券股份有限公司
地址:上海市延平路135号
法定代表人:杨德红
客服电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

(4)江海证券有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人:赵洪波
客服热线:400-666-2288
网址:https://www.jhzq.com.cn/

(5)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

(6)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(7)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18-21层及第04层
法定代表人:高涛
客服热线:95532
网址:http://www.china-invs.cn/

基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构,并另行公告。

二、基金份额登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所: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17号
法定代表人:周明
电话:010-59378856
传真:010-59378907

三、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:021-31358600
联系人:黎明
经办律师:黎明、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:沈兆杰
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:许康玮、沈兆杰

四、基金的名称

信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型基金

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的最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为: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%,且不低于非现金基金资产的80%。

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

本基金主要采用指数复制策略及替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。本基金主要采用指数复制策略,即按照成份股在标的指数中的基准权重来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化进行相应调整。对于出现转殊情况(比如流动性不足,成份股不在港股通标的范围内、因法律法规原因个别成份股被限制投资等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可通过投资非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代,或者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。本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和欧盗性,构建本基金固定收益类证券和货币市场工具的投资组合。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。

由于本基金申购赎回采取现金替代的方式,考虑到申购赎回资金流动冲击以及资金划转等操作问题,本基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及证券交收要求。现金头寸的增加将导致跟踪误差的扩大,因此基金管理人将通过投资以标的指数为基础资产的衍生产品以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

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0.35%,年跟踪误差不超过4%。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为经估值汇率调整的恒生中国企业指数收益率。

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),则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和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金,跟踪恒生中国企业指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资香港联合交易所上市的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

十一、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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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2019年3月31日止,本报告中财务资料未经审计。

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	5,083,755.91	71.00
	其中:股票	5,083,755.91	71.00
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	2,075,392.49	28.99
8	其他资产	1,027.29	0.01
9	合计	7,160,175.69	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

无。

(2)报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

(3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
材料	72,989.35	1.05
必需消费品	59,115.96	0.85
医疗保健	72,534.73	1.05
工业	210,844.78	3.04
公用事业	147,256.81	2.12
电信服务	965,133.84	13.93
金融	2,599,437.38	37.51
房地产	163,237.44	2.36
能源	599,029.06	8.64
非必需消费品	194,276.57	2.80
合计	5,083,755.91	73.36

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

(1)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	00939	建设银行	91,000	525,336.33	7.58
2	00941	中国移动	7,000	480,362.40	6.93
3	01398	工商银行	89,000	438,974.03	6.33
4	02318	中国平安	5,500	414,698.58	5.98
5	00700	腾讯控股	1,100	340,628.41	4.92
6	03988	中国银行	96,000.00	293,158.31	4.23
7	00883	中国海洋石油	21,000.00	264,799.77	3.82
8	00386	中国石油化工股份	30,000.00	159,291.60	2.30
9	03968	招商银行	4,500.00	147,261.10	2.13
10	02628	中国人寿	8,000.00	144,794.96	2.09

(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明细

无。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

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明细

无。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

无。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

无。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

(3)本期国债期货投资评价

无。

10、投资组合报告附注

(1)本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,027.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,027.29

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年3月31日。

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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效之日-2018年12月31日	0.15%	0.01%	-3.61%	0.84%	3.76%	-0.83%
2019年1月1日-2019年3月31日	2.57%	0.69%	10.03%	1.15%	-7.46%	-0.46%
基金合同生效之日-2019年3月31日	2.72%	0.63%	6.06%	1.11%	-3.34%	-0.48%

十三、基金的费用概况

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金的指数许可使用费(包括相关的税费以及与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等);
4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金证券、期货的开户、交易、清算、结算登记等实际发生的其他相关费用;
8、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用;
9、基金上市费及年费;
10、基金收益分配中发生的费用;
11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用;
12、基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息及费用)(简称"税收"),及基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顺问费等;
13、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用;
14、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的标的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。指数许可使用费计算方法如下:

H=E×0.04%÷365
H为每日应计提的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费每日计提,逐日累计至每个季季末,按季支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后,基金托管人于次季度首日起5日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

若一个季度累计计提指数使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限,则基金于季度末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法或费率。

上述"(一)基金费用的种类"中第4-14项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)与基金销售有关的费用

1、申购费

(1)申购费率

对于1类基金份额,本基金对通过直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划等集团资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户,经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

特定投资群体可通过本公司直销中心申购本基金1类份额。基金管理人可根据情况变更或增减特定投资群体申购本基金1类份额的销售机构,并按规定予以公告。

通过基金管理人的直销中心申购本基金1类份额的特定投资群体申购费率见下表:

申购金额M(元)(含申购费)	1类份额申购费率
M<100万	0.06%
100万≤M<500万	0.03%
M≥500万	1,000元/笔

其他投资者申购本基金1类份额的申购费率见下表:

申购金额M(元)(含申购费)	1类份额申购费率
M<100万	0.6%
100万≤M<500万	0.3%
M≥500万	1,000元/笔

本基金E类基金份额不收取申购费用。

(2)申购费收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下,如果投资者多次申购,申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

本基金1类基金份额的申购费用由申购基金份额的投资人承担,不列入基金资产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3)申购份额的计算

1)若投资人选择1类基金份额,则申购份额的计算公式如下:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

(注:对于500万(含)以上适用固定金额申购费的申购,净申购金额=申购金额-固定申购费金额)

申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日1类基金份额净值

2)若投资人选择E类基金份额,则申购份额的计算公式如下:

申购份额=申购金额/T日E类基金份额净值

申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

2、赎回费

(1)赎回费率

1)本基金1类份额赎回费率见下表:

持有时间(天)	1类份额赎回费率
0-6	1.5%
7-29	0.75%
30-89	0.5%
90-179	0.5%
180-364	0.05%
365及以上	0%

2)本基金E类基金份额赎回费率见下表:

持有时间(天)	E类份额赎回费率
0-6	1.5%
7-29	0.5%
30及以上	0%

(2)赎回费的收取和用途

投资者可将其持有的全部或部分1类基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于30天(不含)的1类基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产;对持有期在30天以上(含)且少于90天(不含)的1类基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产;对持有期在90天以上(含)且少于180天(不含)的1类基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产;对持续持有期180天以上(含)的1类基金份额持有人所收取赎回费用总额的25%计入基金财产;其余用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

投资者可将其持有的全部或部分E类基金份额赎回。赎回