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

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
二〇二〇年三月
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15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做出的任何决定,并不表明其对本基金的价值或投资者的投资收益做出实质性判断或保证。

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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,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对基金合同的承认和接受,并按照《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》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

投资有风险,投资者申购本基金时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2019年6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2019年3月31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:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、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:吴庆斌

电话:0755-83183388

传真:0755-83190688

联系人:肖例

(二)主要人员情况

1、董事会成员

吴庆斌先生,董事长,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(南宁)投资股份有限公司、广联(南宁)投资股份有限公司董事长;2012年任职于中泰信托有限责任公司,2013年6月至今,任中泰信托有限责任公司董事长。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司董事长。

崔斌先生,副董事长,北京大学经济学硕士。曾在深圳建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职,2017年8月加入光大证券股份有限公司,历任机构业务总监、副董事总经理、机构业务总监兼证券经纪业务部总经理,现任光大证券股份有限公司机构业务总监总经理。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司副董事长。

廖凯军先生,副董事长,中国人民大学经济学硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

李超女士,董事,华中科技大学管理学学士。2007年6月至2008年5月,任职于深圳晟旭咨询有限责任公司;2008年7月至2011年8月,任德勤华永会计师事务所高级审计员;2011年8月至2018年5月,任平安信托有限责任公司稽核监察部稽核团队团队经理;2018年5月至今,任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。

郭向东先生,董事,中国人民大学金融学在职研究生。1996年至1998年在中国新技术创业投资公司负责法律事务;1998年至2000年在中国华融信托投资公司负责法律事务;2000年至2006年任职于中国银河证券有限责任公司法律部;2007年1月加入中国银河投资管理有限公司,任职于合规处置部;2007年7月至2013年2月,历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人、管理任无锡大成资产管理有限公司总经理;2013年2月起任资产管理部总经理并行政负责人。

杨晓帆先生,独立董事,香港浸会大学工商管理学士。2006年至2011年,任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理;2012年至2016年,任ATALCON EDGE CAPITAL LP合伙人和大中华区负责人;2016年至今,任晨曦概投资管理公司ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT)主要创始人。

胡雅湖先生,独立董事,南卡顿大学国际银行与金融法硕士。1991年7月至1994年4月,任全国人大常委会办公厅研究室政经组主任科员;1994年5月至1998年8月,任北京秘书律师事务所合伙人;2000年2月至2001年4月任北京市中凯律师事务所律师;2001年5月至今,历任北京市天择律师事务所副主任、主任,现任北京市天择律师事务所合伙人。

金李先生,独立董事,美国纽约理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长,兼任中国证券业协会理事、证券业协会会员、曾在美国纽约梅大学商学院任教十多年,并兼任纽约梅大学教授讲席教授。

黄炜女士,独立董事,中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策,商议银行理论与政策、艺术品金融,出版多本专著,在经济、金融类学术核心期刊上发表多篇学术论文,具有丰富的教学和科研经验。

2、监事会成员

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、研究局调研员、金融经济编辑部主任;2005年6月至2008年1月任中美证券投资有限责任公司建行股权管理部主任;2006年6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1月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记;2010年6月至2014年3月兼任北京银河产业投资有限责任公司董事长;2007年1月至2015年4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2016年11月任银河基金管理有限公司董事;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。

宛金俊先生,职工监事,上海财经大学管理学硕士。2001年9月至2003年9月任职于株洲电力局;2003年9月至2006年1月攻读硕士学位;2006年4月至2010年5月任华为三康技术有限公司人力资源专员;2010年5月至今任职嘉诚实业集团人力资源部高级经理;2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理;2016年8月加入大成基金管理有限公司,任人力资源部副总监;现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。

陈玲女士,职工监事,吉林大学法学硕士。2006年8月至2008年3月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师;2008年3月加入大成基金管理有限公司,历任监察稽核部律师、总监助理;现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。

3、高级管理人员情况

吴庆斌先生,董事长。简历同上。

廖凯军先生,总经理。简历同上。

肖例先生,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,深圳市广东能源股份有限公司副总经理兼广聚投资股份公司执行董事、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,2015年1月起任公司副总经理。

温敦敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士,曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师,中银国际投行业务部副总裁,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。

胥云新先生,副总经理兼首席信息官,中央党校经济管理本科。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县委宣传部副部长、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纪委副书记及少工委主任、江苏省核能发展股份有限公司办公室主任、江苏省核能发展股份有限公司投资业发展部主任兼总经理、江苏省核能发展股份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,历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、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、公司副总经理,2015年8月起任公司副总经理,2019年5月起兼任首席信息官。

熊余海先生,副总经理,美国纽约大学经济学博士。曾任职于摩根史坦利亚洲证券有限公司、美国花旗银行纽约分行、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世界银行经济学家、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、中国人民银行营业管理司副司长、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。

赵冰女士,副总经理,清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券投资管理基金、专业联络部、基金公司会员部,曾任中国证券投资基金业协会会员部、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,曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒介公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司,2017年8月起任公司副总经理。

4、基金经理

苏美毅,经济学硕士。证券从业年限15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,曾任任规划发展高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理、现任数量与指数投资部副总监。2012年8月28日至2014年1月23日任大成中证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日任嘉实主题A股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。2013年2月12日至2014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日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月1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26日起任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起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日起任大成景颐混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

5、公司投资执策委员会

公司最低投资执策委员会由7名成员组成,设投票投资执策委员会主席1名,其他委员6名,名单如下:

温敦敏,公司副总经理,量化投资执策委员会主席;黎新平,基金经理,数量与指数投资部总监,量化投资执策委员会委员;李钜,期货投资部总监,量化投资执策委员会委员;沈杰,基金经理,数量与指数投资部副总监,量化投资执策委员会委员;冉凌浩,基金经理,量化投资执策委员会委员;张宇,高级经理,量化投资执策委员会委员;张宇吉,基金经理,量化投资执策委员会委员。

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:32,479,411万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

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拥有全国最大的机构网络和客户资源,在资产、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、业务服务范围最广、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,中国农业银行通过自己的努力和国家支持,在海外建立了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家服务于城乡、面向国民、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“伟你成长”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并率先实现在国内和国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《金球托管人》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,并获得无保留意见的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(ISAE3402)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、内部控制的有效性的认可,中国农业银行官方加强配方建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金牌理财”TOP10强实盘类中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续获得《证券时报》“金牌理财优秀奖”和中证报证券类评选中的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国证券报授予的分析基金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5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、风险合规部、产品研发与信息技术部、登记一部、登记二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安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现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队员技专业水平高、业务素质好、服务能力强、高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2019年6月31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440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、严格监管、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,独立于被监督部门和被监督职权。

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,授权工作实行集中控制,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;业务操作区与广场设置、封闭管理、实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务记录完整、可以自动化操作,防止人为事故的发生,业务系统实现备份、恢复。

(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

基金托管人通过参数设置将《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、书面警示。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

一、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:吴庆斌

电话:0755-83183388

传真:0755-83190688

联系人:赵蔚

公司网址:www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线:400-888-5558(免长途固话费)

大成基金深证成份投资基金网上交易

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、天志玲、白小雪

电话:0755-22223656/22223177/22223555

传真:0755-83196235/83196242/83196232

邮编:518040

二、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:010-84588888

联系人:臧凌

电话:010-60836696

传真:010-84865560

网址:www.cs.ecitic.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:李笑鸣

电话:021-23219000

传真:021-63602722

网址:www.haitongzq.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:上海市东方路1928号东海证券大厦

法定代表人:朱科敏

客服电话:95531

联系人:梁用

电话:021-20333333

传真:021-50498825

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:谭敏

联系电话:010-66568450

传真:010-66568290

网址:www.chinastock.com.cn

5、中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29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:95548

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

网址:www.zxwt.com.cn

6、申万宏源证券有限公司

通讯地址:上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人:李梅

客服电话:95523或4008895523

联系人:曹晔

电话:021-54033888

传真:021-54038944

网址:www.swyg.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:刘秋明

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二十六层

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:权唐

电话:010-85130577

传真:010-65182261

网址:www.csc108.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:黄婵君

电话:0755-82960167

传真:0755-82943636

网址:www.newone.com.cn

11、东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼22-29楼

法定代表人:潘鹰军

客服电话:95503

联系人:胡月茹

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:杨炯洋

客户服务热线:4008888818

联系人:金达勇

电话:0755-83025723

传真:0755-83025991

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:芮敏祺、朱鹏举

联系电话:021-38676666

传真:021-38670161

网址:www.gtja.com

14、申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(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:010-88085858

传真:010-88085195

联系人:李巍

客服电话:400-800-0562

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:蔡霞

电话:022-28451991

传真:022-28451892

客服电话:4006515988

网址:www.ewww.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.zhongtaisec.com

17、西南证券股份有限公司

地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

法定代表人:余维佳

客服电话:4008096096

联系人:张莹

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:许莹伦

电话:021-53519888

传真:021-63608830

网址:www.962518.com

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。

三、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,具体名单请见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

(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)59378832

传真:(010)59378907

(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:沈娜、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:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:陈婉丽

经办注册会计师:张振波、陈婉丽

四、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

五、基金的类型

股票型指数基金

六、基金的运作方式

交易型开放式

七、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投资比例依照法律法规或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,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整权益的股份发生配股、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金融产品,如权证以及其他与标的指数成份股和成份股、备选成份股相关性较为紧密的金融工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,为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。

在正常情况下,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,并编制成份股调整名单、指数公司发布的其他信息、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,将相关投资管理目的落实。

(3)组合构建:根据标的指数情况、成份研究支持,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。

4、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。

本基金标的指数为深证成份指数(代码:399001)。

如果标的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致本基金管理人认为标的指数不可继续作为跟踪标的,或证券市场其他代表性更强、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人合法权益的原则,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投资组合预期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,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则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。

(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。

基金托管人中国银行根据基金合同规定,于2019年6月18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,本报告中所列财务数据未经审计。

(1)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	市值	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	264,435,385.25	98.59
	其中:股票	264,435,385.25	98.59
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	3,649,434.14	1.36
8	其他资产	134,089.98	0.05
9	合计	268,218,909.37	100.00

(2)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

(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

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	8,292,504.60	3.13
B	采矿业	1,869,681.09	0.70
C	制造业	165,738,150.57	61.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,861,602.51	1.07
E	建筑业	2,096,816.98	0.78
F	批发和零售业	6,043,168.37	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	2,524,484.95	0.94
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,088,058.02	10.12
J	金融业	18,229,371.31	6.81
K	房地产业	14,227,937.55	5.31
L	租赁和商务服务业	3,732,838.78	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,080,397.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,888,519.28	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	3,821,422.56	1.43
R	文化、体育和娱乐业	3,904,348.29	1.46
S	综合	497,613.60	0.19
	合计	264,006,006.46	98.56

(2)报告期末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	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	107,825.85	0.04
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	154,308.00	0.06
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	32,902.94	0.01
J	金融业	134,343.00	0.06
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	429,379.79	0.16

(3)报告期末行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

(三)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明细

(四)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	000651	格力电器	184,500	8,710,245.00	3.25
2	000333	美的集团	177,750	8,661,757.50	3.23
3	000858	五粮液	70,700	6,716,500.00	2.51
4	300498	温氏股份	146,404	5,944,002.40	2.22
5	000002	万科A	163,500	5,022,720.00	1.88
6	002415	海康威视	135,225	4,742,340.75	1.77
7	000001	平安银行	323,500	4,147,270.00	1.55
8	000725	京东方A	1,000,100	3,900,390.00	1.46
9	300059	东方财富	150,967	2,925,740.46	1.09
10	002304	洋河股份	21,562	2,812,116.04	1.05

(5)报告期末投资股票明细

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	002867	周大生	4,400	154,308.00	0.06
2	002868	青岛海行	17,700	134,343.00	0.05
3	300762	上海瀚讯	1,233	82,476.37	0.03
4	300766	每日互动	1,193	32,902.94	0.01
5	002862	亚世光电	514	25,350.48	0.01

(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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019547	16国债05	1,000,000	100,000,000.00	37.67
2	019548	16国债06	1,000,000	100,000,000.00	37.67
3	019521	16国债03	500,000	50,000,000.00	18.83
4	019537	17国债01	500,000	50,000,000.00	18.83
5	019541	17国债05	500,000	50,000,000.00	18.83

(7)报告期末投资股指期货明细

(8)报告期末投资股指期货的投资组合情况

(9)报告期末本基金投资的国债期货明细

(10)报告期末本基金投资的国债期货的投资组合情况

(11)投资组合报告其他重要信息

(12)报告期末指数投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,309.07
2	应收证券清算款	131,048.18
3	应收股利	–
4	应收利息	735.73
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	134,089.98

4、报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1)报告期末指数股票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、由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)自基金合同生效日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及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
2015.6.5-2015.12.31	-13.75%	2.90%	-27.63%	3.06%	13.88%