

深证民营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：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二零一五年十月
重要提示

本基金经2011年6月20日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准深证民营交易型

开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可[2011]969号文）核准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2011年9月2日正式生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运营管理。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、管理风险、操作风险、本基金特有的风险及其他风险，等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证，投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年9月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1. 名称：鹏华基金管理有限公司
2. 住所：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
3. 设立日期：1998年12月22日
4. 法定代表人：何如
5. 办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6. 电话：（0755）82021233 传真：（0755）82021155
7. 联系人：尹奇志
8. 注册资本：人民币1.5亿元
9. 股权结构：

出让人名称	出资额(万元)	出资比例
鹏华证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市弘德信投资发展有限公司	150	1%
合计	15,000	100%

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳分公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记、深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师，中国兵器工业总公司主任科员，中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党委书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员，中共深圳市委政策研究室副处长，深圳证券结算公司常务副总经理，深圳证券交易所首任行政总监，香港深业（集团）有限公司助理总经理，香港深业控股有限公司副总经理，中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、国信证券股份有限公司副总裁。 现任国信证券股份有限公司副董事长。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务部总经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源部副总经理、资金财务部总经理助理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务部总经理。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商学士，国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理 work，历任CA AIFP SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIFP SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方资产管理总监、Epsilon资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。

Alessandro Varaldo先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰圣意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sfridung股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fidelity资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及营销策划部负责人，Capitalia股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人，Capitalia投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事兼总经理，Unicredit Holding风控管理事业部意大利企业法人风险管理业务负责人，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）首席市场官，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）储蓄、投资和养老金部负责人。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会法理学研究会会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2. 基金管理人监事会成员

俞俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

Andrea Vismann先生，监事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权工作，现任欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海普华永道财务副科长、资金财务部财务副经理、资金财务部资金副经理、资金财务部主任会计师兼经理、资金财务部总经理助理、资金财务部副总经理等，现任国信证券资金财务部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

苏波先生，职工监事，博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司研究所研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、渠道服务部二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理；2008年11月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理。

刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司，曾任登记结算部副总经理、执行总经理。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜（深圳）律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务主管，现任监察稽核部总经理助理。

3. 高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司市场部价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金运作基金基金经理、基金营销基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部，境外投资部，历任副主任科员、主任科员、副处长，鹏华基金管理有限公司总裁助理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总监助理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部，中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，现任鹏华基金管理有限公司督察长、监察稽核部总经理。

4. 本基金基金经理

崔俊杰先生，国籍：中国，金融工程专业管理硕士，7年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计

师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理，2013年3月起兼任鹏华上证50ETF基金及其联接基金基金经理，2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理：

2011年9月基金合同生效至2013年3月由南方先生担任本基金基金经理。

本基金基金运作管理其它基本情况：

2013年3月起担任鹏华深证民营ETF联接基金基金经理；

2013年3月起兼任鹏华上证50ETF基金及其联接基金基金经理；

2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理；

2014年12月起兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理；

2014年12月起兼任鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金经理；

2015年4月起兼任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员情况

邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

初冬女士，鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛收益回报债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。

龚洪涛先生，鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构投资部总经理，社保基金组合投资经理。

黄鑫先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理。

王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理，鹏华中证500指数（LOF）基金、鹏华地产分级基金、鹏华沪深300指数（LOF）基金、鹏华创业板分级、鹏华互联网主题分级基金经理。

陆旻先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华丰收债券基金、鹏华双债利债债券基金、鹏华可转债债券基金基金经理。

陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理，鹏华中国50组合基金基金经理，鹏华消费领先混合基金基金经理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田 青

联系电话：(010)6595 9696
中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码989)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。于2014年末，中国建设银行市值约为2,079

亿美元，居全球上市银行第四位。

于2014年末，本集团资产总额167,441.30亿元，较上年增长8.99%；客户存款和垫款总额94,745.23亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.76亿元，增长6.53%。营业收入6,704.70亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实，全年客户机构有效客户和单位人民币理财账户分别新增11万户和68万户，个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到1,37万个，综合柜员占比达到80%，综合营销团队1,76万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元，承销连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产管理规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。

跨境人民币客户数突破1万个，结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张，消费交易额16,580.81亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长14.18%，金融资产达64.82亿元。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在美国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强中位列第2；在美国《财富》杂志世界600强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、客户好评、零售业务、投资服务、债券承销、信用卡、住房金融和金融科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托托收业务处、OFII托管处、养老金托管处、清收处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵越甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务和个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷管理部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张力群，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部，公司业务部，并在总行集团客户部和建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金个人账户、OFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末，中国建设银行已托管614只证券投资基金。中国建设银行行业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、申购赎回代理机构（简称“一级交易商”）

1）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
办公地址：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：王志刚

联系电话：021-2219275
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553
网址：www.htsc.com.cn

2）海通证券股份有限公司
注册地址：上海广东路689号
办公地址：上海广东路689号
法定代表人：王浩

联系电话：021-2219275
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553
网址：www.htsc.com.cn

3）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16—26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16—26层
法定代表人：何如

联系电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：周杨
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

4）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼12层
法定代表人：兰荣

联系电话：021-38565785
传真：021-38565955
联系人：谢高商
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

5）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
办公地址：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

联系电话：0755-82943666
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn

6）长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路88号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路88号长江证券大厦
法定代表人：杨泽柱

联系电话：027-65799999
传真：027-38481900
联系人：李勇
客户服务电话：95579或4008888999
网址：www.95579.com

7）湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人：林俊波

联系电话：020-88634518
联系人：钟康贵
客户服务电话：400-888-1151
网址：www.xcsc.com

8）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路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
联系电话：020-87558888
传真：020-87563600
客服电话：95575
网址：www.gf.com.cn

9）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
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅

联系电话：021-33388888
联系人：曹晖
客户服务电话：95522或95595
网址：www.swhysc.com

10）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号2316室
法定代表人：李野

联系电话：0531-68889157
联系人：王霖
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

11）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闻路1508号
办公地址：上海市静安区新闻路1508号
法定代表人：薛峰

联系电话：021-22169081
传真：021-68817271
联系人：刘晨
客户服务电话：95525
公司网站：www.ebscn.com

12）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82285551
传真：0755-82568355
联系人：陈剑
客户服务电话：4008001001
网址：www.essence.com.cn

13）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
办公地址：天津市南开区滨水西道8号
法定代表人：王春峰

联系人：王兆凯
电话：022-28451861
传真：022-28451892
网址：www.bhzc.com

14）方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段200号方广场国际大厦11层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层
法定代表人：翟建

联系人：郭晓红
联系电话：010-57398063
客户服务电话：95571
网址：www.founders.com

2、二级市场交易代理商
包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司

3、基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，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
注册地址：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

联系人：崔巍
联系电话：010-59378856
传真：010-59378907
（三）律师事务所
名称：北京市金杜律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层
负责人：王玲
联系电话：0755-22163333
传真：0755-22163390
联系人：宋萍萍
经办律师：靳庆军、宋萍萍

（四）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
执行事务合伙人：李丹
联系电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：陈熹
经办注册会计师：单峰、陈熹

四、基金的投资

（一）投资目标
本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股（投资比例不低于基金资产净值的95%），此外，为了更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非标的指数成份股（包含小市值、创业板及其他经中国证监会核准上市的投资品种），新股（首次发行或增发等）、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

（二）投资范围
本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股（投资比例不低于基金资产净值的95%），此外，为了更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非标的指数成份股（包含小市值、创业板及其他经中国证监会核准上市的投资品种），新股（首次发行或增发等）、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

（三）投资策略
本基金采取完全复制法确定目标组合，主要投资范围与标的指数成份股及其备选成份股。基金管理人将对标的指数成份股的流动性及交易3个月内达到合同约定的投资比例。此外，因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在10个工作日内进行投资组合调整。

（四）业绩比较基准
本基金业绩比较基准为：深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-1.00%。

（五）风险收益特征
本基金为股票型基金，预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险品种。

（六）投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

4. 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债券投资明细

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贵金属投资明细

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权证投资明细

7. 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

8. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

9. 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

10. 投资组合报告附注

（一）基金资产组合情况

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

（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投资明细

（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十名债券投资明细

（五）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

（六）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权证投资明细

（七）报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

（八）报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

（九）报告期末本基金投资的期权投资情况说明

（十）投资组合报告附注

1. 本基金本报告期末未持有股票。

2. 本基金本报告期末未持有债券。

3. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4. 除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入当期基金费用。

5. 本基金本报告期末未持有贵金属。

6. 本基金本报告期末未持有权证。

7. 本基金本报告期末未持有股指期货。

8. 本基金本报告期末未持有国债期货。

9. 本基金本报告期末未持有期权。

10. 本基金本报告期末未持有其他衍生品。

（二）基金资产组合情况

（三）报告期末按行业分类的股票投资组合

（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十名股票投资明细

（五）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

（六）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权证投资明细

（七）报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

（八）报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

（九）报告期末本基金投资的期权投资情况说明

（十）投资组合报告附注

1. 本基金本报告期末未持有股票。

2. 本基金本报告期末未持有债券。

3. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4. 除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入当期基金费用。

5. 本基金本报告期末未持有贵金属。