

易方达上证中盘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：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
二〇一七年五月

重要提示
本基金根据2009年12月31日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可【2009】1498号）和2010年2月11日《关于易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2010]79号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2010年3月29日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明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。

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资产，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，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意思、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，基金投资对象与投资策略引发的特定风险，等等。基金管理人提醒投资者投资基金的“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。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读本招募说明书，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2017年3月29日，有关财务数据截止日为2016年12月31日，净值表现截止日为2016年12月31日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1.基金管理人：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期：2001年4月17日
法定代表人：刘晓艳

联系电话：400 881 8088
联系人：贺晋

注册资本：12,000万元人民币
批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理；经中国证监会批准的其他业务。

2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
合 计	100%

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员
詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险（集团）股份有限公司研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任，境外投资部主任、投资部副主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司总裁、易方达资产管理（香港）有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投行部常务副总经理、投资理财部副经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司经理助理、副总经理，广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理，广发控股（香港）有限公司董事。

杨力先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理；佛山顺德百年科技有限公司行政总监；美的空调深圳营销中心区域经理；佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理；长虹空调广州营销中心营销总监；广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁；盈峰资本管理有限公司总经理；开源证券股份有限公司副董事长。现任盈峰投资控股集团有限公司董事、执行董事兼首席投资官；盈峰资本管理有限公司董事长；广东民投投资股份有限公司董事。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问科科员；工商银行广东省分行法律部负责人、营业部计划信贷部信贷员、办公室行政室科长、信贷管理部业务主办、资产负债管理部副经理兼法律室副主任、资产负债管理部副经理兼法律室主任、资产负债管理部副经理、招商银行总行法律事务部专员；工商银行珠海分行资产负债部副经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、副行长；工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理；工商银行韶关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

刘朝先生，经济学硕士，董事。曾任湖南证券发行部经理助理；湘财证券投资银行总部总经理助理；财富证券投资银行总部副总经理；五矿二十三冶建设集团副总经理、党委书记；深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事；新晟期货有限公司副董事长；广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长。现任东江环保股份有限公司董事长。

朱征夫先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所律师金融地产业部主任；广东大陆律师事务所合伙人；广东省国土厅广东地方法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

何榕女士，工商管理行政硕士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州大学戴维斯分校市场部经理；美国加州大学讲师；美国加州大学助教；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谢韵松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场部拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记；中国证监会广州证管办处长；广州市广永国有资产经营有限公司董事长；广州股权交易中心有限公司董事长；广州立根小额贷款股份有限公司董事长；广州银行副董事长；广州中盈（三明）基金管理有限公司董事长；广州汽车集团股份有限公司独立董事。现任广州金融控股集团有限公司董事长；万联证券有限责任公司董事长；广州金控资产管理有限责任公司董事长；广州永期投资有限公司董事长；广州金控花都金融投资有限公司董事长；广州农村商业银行股份有限公司董事。

廖晖先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张佑造先生，工商管理硕士（MBA），常务副总裁。曾任南方证券交易部中心业务发展部经理；广东证券发行上市部副经理；深圳证券交易部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场部拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理，市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳大众投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场部拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理，市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳大众投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士（MBA），首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、另类投资决策委员会委员。

关秀霞女士，财务硕士，工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析员；Daniel Dennis 高级审计师；美国道富银行波士顿及亚洲总部大中华地区高级副经理、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计部高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），首席养老金业务官。曾任招商银行总行人力资源高级经理、企业年金中心副主任，浦东发展银行总行人力资源部高级经理，长江养老保险公司首席市场经理，易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

2.基金经理

张胜记先生，管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金交易助理、行业研究员、指数与量化投资部总经理助理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深300指数证券投资基金）基金经理（自2011年1月1日至2013年11月13日），现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2010年3月29日起任职）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2010年3月31日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金基金经理（自2012年8月9日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2012年8月21日起任职）、易方达50指数证券投资基金基金基金经理（自2012年9月28日起任职）、易方达标普全球高端消费品指数增强证券投资基金基金基金经理（自2014年9月13日起任职）、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年11月2日起任职）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月3日起任职）、易方达标普500指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月6日起任职）、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月16日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月16日起任职）、易方达原油证券投资基金（QDII）基金经理（自2016年12月19日起任职），兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

3.指数与量化投资决策委员会成员

本公司指数与量化投资决策委员会成员包括：林飞先生、张胜记先生、王建辉先生。

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理、易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副经理、易方达沪深300指数证券投资基金基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金基金经理、易方达沪深300医药交易型开放式指数证券投资基金基金基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资管理总部总经理、指数与量化投资部总经理、量化基金组合部总经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人人员（RO）、证券交易负责人人员（RO）、ROPII / OFII 产品投资决策委员会成员。

张胜记先生，同上。

王建辉先生，经济学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金联接基金基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金基金基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副经理、投资经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街56号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：易会满
注册资本：人民币36,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

三、相关服务机构

（一）基金销售服务机构

1.申购、赎回代办证券公司（以下排序不分先后）
（1）广发证券

注册地址：广州天河区河北北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316）楼
办公地址：广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42、43楼

法定代表人：孙树明
客户服务热线：95575
网址：www.gf.com.cn

（2）安信证券

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1楼9层
法定代表人：王连志
联系人：陈剑虹
客户服务热线：0755-82825551
客户服务热线：4008001001
传真：0755-82563855
网址：www.essence.com.cn

（3）渤海证券

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：天津市南开区荣业三道道号
法定代表人：王春峰
联系人：蔡冀
客户服务热线：022-28451991
客户服务热线：400-651-5888
传真：022-28451892
网址：www.bhsc.com.cn

（4）光大证券

注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨、李芳芳
客户服务热线：021-22169999
客户服务热线：95625、400-8888-788
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com

（5）国海证券

注册地址：广西桂林南厢路13号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：何春梅
联系人：牛志宇
客户服务热线：0755-83700350
客户服务热线：95653
传真：0755-83704850
网址：www.guozq.com.cn

（6）国信证券

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
办公地址：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
联系人：周杨
客户服务热线：0755-82130833
客户服务热线：95536
传真：0755-82133952
网址：www.guosen.com.cn

（7）海通证券

注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
联系人：周杨
客户服务热线：0755-82130833
客户服务热线：95536
传真：0755-82133952
网址：www.htsec.com

（8）华宝证券

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
客户服务热线：021-20615589
客户服务热线：400-820-9898

传真：021-20615593
网址：www.cnhbstock.com

(9) 申万宏源西部证券
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
联系人：王怀春
联系电话：0991-2307106
客户服务热线：400-800-0562
传真：010-88085196
网址：www.hysec.com

(10) 申万宏源证券
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
联系人：李玉婷
客户服务热线：021-33388229
客户服务热线：95523、4008895623
传真：021-33388224
网址：www.swhyc.com

(11) 万联证券
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层
法定代表人：张建军
联系人：甘蕾
客户服务热线：020-38260206
客户服务热线：400-8838-133
传真：020-38265588
网址：www.wlzq.com.cn

(12) 中泰证券
注册地址：济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：许曼华
客户服务热线：021-20315290
客户服务热线：95538
传真：0531-68889095
网址：www.zts.com.cn

(13) 中信证券
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
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑军
联系人：郑慧
客户服务热线：010-60838888
传真：010-60833929
客户服务热线：95548
网址：www.cs.ecitic.com

(14) 中信证券（山东）
注册地址：青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
联系人：赵海娟
客户服务热线：0532-85023924
客户服务热线：95548
传真：0532-85022005
网址：www.citicsec.com

二、二级市场交易代办证券公司
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二

级市场交易。

3.场外份额销售机构
直销机构：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：刘晓艳
电话：020-85102506
传真：4008818099
联系人：温海萍
网址：www.efunds.com.cn

直销机构网站信息：
（1）易方达基金管理有限公司广州直销中心
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼
电话：020-85102506
传真：400-881 8099
联系人：温海萍

（2）易方达基金管理有限公司北京直销中心
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座1703室
电话：010-63213377
传真：400 881 8099
联系人：刘雷

（3）易方达基金管理有限公司上海直销中心
办公地址：上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室
电话：021-50476668
传真：400 881 8099
联系人：于楠

（二）登记结算机构
1.场外的份额登记结算机构
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：郑荣爽
客户服务热线：（021）58872935
传真：（021）68870311

2.场外的份额登记结算机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：刘晓艳
成立时间：2001年4月17日
客户服务热线：400 881 8088（免长途话费）
传真：（020）38799249
联系人：余贤高

（三）律师事务所和经律师
名称：通力律师事务所
住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩朝
联系电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明

（四）会计师事务所和经注册会计师
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
电话：（021）23338888
传真：（021）23338800
经办注册会计师：陈玲、周伟
联系人：周伟

四、基金名称
本基金名称：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型
本基金类型：交易型开放式指数基金

六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向
本基金以标的指数的成份股、备选股作为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资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%。

八、基金的投资策略
本基金采取完全复制法进行投资，即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股流动性由于自由流通股发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数的指数为上证中盘指数。

十、基金的风险收益特征
本基金属股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告（未经审计）
本基金基金管理人董事会和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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2016年10月1日至2016年12月31日。

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	249,403,960.70	96.94
	其中：股票	249,403,960.70	96.94
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
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	7,849,923.45	3.06
7	其他资产	11,384,312.62	0.00
8	合计	256,258,138.87	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而2的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	847,032.00	0.33
B	采矿业	10,501,969.73	4.11
C	制造业	90,069,963.13	35.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,640,077.00	8.07
E	建筑业	12,276,726.18	4.80
F	批发和零售业	13,392,321.62	5.23
G	交通运输、仓储和邮政业	15,818,548.16	6.19
H	住宿和餐饮业	489,030.06	0.19
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,880,338.63	5.82
J	金融业	31,100,536.61	12.17
K	房地产业	31,384,312.62	12.27
L	科学研究和技术服务业	2,428,055.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、管理和其他服务业	-	-
P	休闲、文体	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	824,586.79	0.32
S	综合	2,946,496.40	1.15
合计		249,403,960.70	97.17

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

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	600000	长江电力	680,577	8,616,104.82	3.37
2	600276	恒瑞医药	146,247	6,688,738.50	2.59
3	600105	华夏银行	551,000	5,978,350.00	2.34
4	600109	南京银行	374,906	4,064,286.40	1.59
5	600765	国电电力	1,215,800	3,884,086.00	1.51
6	601880	紫金矿业	1,140,800	3,810,272.00	1.49
7	601939	建设银行	682,519	3,767,303.36	1.47
8	601059	太平洋	702,891	3,619,889.65	1.42
9	600055	海螺水泥	206,300	3,436,848.00	1.37
10	600191	宝钢股份	559,954	3,231,857.90	1.26