

上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
重要提示

上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2010年7月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】985号文核准募集。本基金的基金合同于2010年9月19日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

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。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所投入的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策。

本招募说明书所载内容截止日为2018年9月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：海富通基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
法定代表人：张文伟
成立时间：2003年4月18日
电话：021-88690999
联系人：吴晨莺
注册资本：1.5亿元人民币
股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BB控股公司49%。

（二）主要人员情况
张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券银行总部副总经理、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年6月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资有限公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理，华宝信托投资有限公司总裁助理兼董事办秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长，2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑娟女士，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总经理、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres（陶乐斯）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行执行董事。2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Wemou（韦山）先生，董事，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月任法国兴业投资银行全球市场部任执行董事，中国业务开发负责人职务；2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略总监。

郑闻汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

Marc Baynot（巴约特）先生，独立董事，布鲁塞尔大学工商管理硕士，布鲁塞尔大学金融学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事总经理，Degroot资产管理（布鲁塞尔）独立董事，现任Pioneer投资公司（米兰、都柏林、卢森堡）独立董事，Fundconnect独立董事和法国巴黎银行集团（法国）独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海大众昂立股份有限公司董事长。

张馨先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨仓兵先生，监事长，管理学学士。历任安徽省农业科学院计划财科副科长，安徽三鑫药业有限公司财务部经理，海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理，上海海振实业发展有限公司总经理，海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资产管理总部总经理。

Bruno Weil（魏海诺）先生，监事，法国国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部门负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司，历任产品及创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

蔡万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中实业发展有限公司主管会计、海通证券股份有限公司财务计划经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务计划部经理，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休基金管理投资公司分析师，基金经理助理，法国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

江勇先生，经济学硕士。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，2018年7月起任海富通上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接、海富通上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、海富通中证100指数（LOF）、海富通中证内地低碳指数的基金经理。

纪君凯先生，上海财经大学统计学硕士，历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017年7月加入海富通基金管理有限公司，任投资经理。2018年7月起任海富通上证周期ETF的基金经理助理。

本基金历任基金经理为蒋征先生，任职时间为2010年9月至2012年1月；刘魏女士，任职时间为2010年11月至2018年6月。

投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固收收益投资总监；杜晓辉，多资产策略投资部总监；王金涛，研究部总监；陈洪伟，固定收益投资副总监；赵赫，年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、申购赎回代理机构（简称“一级交易商”）
1）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：周杰
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
客户服务电话：95653或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com
2）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

十六层
法定代表人：何如
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

十六层
客户服务电话：95536
联系人：周杨
网址：www.guosen.com.cn
3）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：周健男
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
客户服务电话：95525
联系人：姚巍
网址：www.ebscn.com

4）财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心20层
法定代表人：蔡一兵
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心

26-28层
客户服务电话：95317或4008835316
联系人：郭晶
网址：www.cfqz.com
5）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
客户服务电话：95538
联系人：许曼华
网址：www.zts.com.cn

6）国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市梅山路18号
法定代表人：蔡咏
办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座
客户服务电话：95578或4008888777
联系人：李秦
网址：www.gyzq.com.cn

7）长城证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦
法定代表人：丁斌
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、

16、17层
客户服务电话：4006668888
联系人：金夏
网址：www.cgws.com
8）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：刘世安
办公地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
客户服务电话：95511-8
联系人：周晓
网址：stock.pingan.com

9）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、
20层
法定代表人：胡伏财
办公地址：广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、
20层
客户服务电话：95636
联系人：林洁茹
网址：www.gzs.com.cn

10）东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层
法定代表人：魏庆华
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
客户服务电话：95509
联系人：汤漫川
网址：www.dxzq.net

11）德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
法定代表人：武晓峰
办公地址：上海市静安区600号城隍庙国际中心26楼
客户服务电话：4008881828
联系人：刘熠
网址：www.tebon.com.cn

12）东方财富证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人：潘鑫军
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
客户服务电话：95503
联系人：胡月娟
网址：www.dfzq.com.cn

13）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7楼
法定代表人：李俊杰
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
客户服务电话：4008918918
联系人：邵珍珍
网址：www.shzq.com

14）江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：赵洪波
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
客服电话：4006662288
联系人：周俊
网址：www.jhzq.com.cn

15）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38-40层
法定代表人：霍达
办公地址：广东省深圳市福田益田路江苏大厦A座38-45层
客户服务电话：95565
联系人：林坚迎
网址：www.newone.com.cn

16）山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯魏
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
客户服务电话：95573
联系人：张治国
网址：www.js18.com.cn

17）红塔证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号
法定代表人：李素明
办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
客户服务电话：4008718880
联系人：刘晓明
网址：www.hongtastock.com

18）广发证券股份有限公司
注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
法定代表人：孙树明
办公地址：广州市天河区河北路183号大都会广场5、7、8、17-19、38-44
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn

19）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
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
联系人：黄岚
网址：www.citic.com.cn

法定代表人：张佑君
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
客户服务电话：95548
联系人：王一一
网址：www.cs.citic.com

20）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址：西藏拉萨市北京中路101号
法定代表人：陈宏
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
客户服务电话：95357
联系人：付佳
网址：www.xzsec.com

2、二级市场交易代理机构
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构
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
法定代表人：周明
电话：021-58872625
传真：021-68970311
联系人：刘永卫

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：通力律师事务所
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：021-3135 8600
联系人：黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：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
法定代表人：李丹
经办注册会计师：薛竟、邵晓松
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：邵晓松

本基金的名称：上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金
基金的类型：股票型、交易型开放式

本基金的投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证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。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、投资方向和范围
（一）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，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，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（二）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。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决策。

（三）组合构建：根据标的指数情况，结合研究报告，基金经理以完全复制制的方式构建成份股及成份股权重的投资组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（四）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（五）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，组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（六）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，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体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

4、构建投资组合
构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标原则、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制的原则确定目标组合，其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%，在特殊情况下，需要选择其他股票进行替代的，本基金按照合理方法来选择替代股票。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司基本面对因素的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：确定目标组合及建仓策略后，基金经理在规定时间内采用适当的方法构建和调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

5、日常投资组合管理
（1）标的指数的跟踪与跟踪
当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他可能会影响成份股在指数中权重的行为时，基金管理人将分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，及时调整股票投资组合。

（2）标的指数的跟踪与分析
如果出现标的指数的成分股临时调整、编制方法调整或其他可能影响组合跟踪效果的情形，基金管理人将分析调整对所跟踪指数的影响，并及时制定相应的投资组合调整策略。

（3）申购赎回的调整
跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）投资组合的调整：利用数量化分析等方法，寻找将实际组合调整到目标组合的最优方法，确定组合调整及交易策略。

（5）制作并公布申购、赎回清单：以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，根据上市公司公告、考虑T日可能发生的上市公司变动情况，设计T日的申购赎回清单并公告。

6、定期投资组合管理
基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：
（1）本基金投资组合将根据标的指数的编制规则，备选股票的前期预测及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

（2）定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化投资组合调整及交易策略。

（3）根据基金合同中基金管理人、基金托管人等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行定期支付现金的准备。

7、投资绩效评估
（1）每日对基金的绩效评估进行，分析基金跟踪偏离度；
（2）每月末，定量研究团队对本基金的运行情况进行量化评估；
（3）每月末，基金经理根据评估报告分析本基金基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、以及成份股未建仓成份股的变化等。

建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对

值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证周期行业50指数。

如果指数编制单位变更或停止上证周期行业50指数的编制及发布，或上证周期行业50指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致上证周期行业50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投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数。

十、基金的风险收益特征
本基金属股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10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止至2018年6月30日（“报告期末”）。
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	30,085,178.79	96.29
其中：股票	30,085,178.79	96.29	
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	1,155,856.03	3.70
7	其他资产	3,803.94	0.01
8	合计	31,244,837.76	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 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	2,193,923.97	7.06
C	制造业	2,364,501.48	7.61
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	699,268.37	2.26
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	23,631,898.19	76.06
K	房地产业	1,196,566.78	3.86
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	—	—
Q	环保、能源、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		30,085,178.79	96.82

2.2 报告期末按债券品种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港股通股票。

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	601318	中国平安	90,442	5,298,092.36	17.06
2	600036	招商银行	90,256	2,386,342.20	7.68
3	601166	兴业银行	103,293	1,487,419.20	4.79
4	600016	民生银行	266,227	1,443,589.00	4.66
5	601328	交通银行	231,045	1,326,198.30	4.27
6	601288	农业银行	334,204	1,149,661.76	3.70
7	600030	中信证券	68,461	1,134,398.77	3.66
8	601398	工商银行	177,064	941,980.48	3.03
9	000000	浦发银行	57,690	933,629.60	3.00
10	601601	中国太保	26,188	834,087.80	2.68

4 报告期末按债券品种和分券的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 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

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金股指期货投资的投资政策
根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价
根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

11 投资组合报告附注
11.1 报告期内本基金投资的浦发银行（600000）于2018年1月19日公告称，因公司部分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等行为严重违反审慎经营规则，收到四川银监局的行政处罚决定书，相关责任领导受到禁止终身从事银行业工作、取消高级管理人员任职资格、警告及罚款等处罚。

报告期内本基金投资的招商银行（600036）因存在内控管理严重违法违规经营、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业业务违规接受第三方金融机构信用担保等违规行为，于2018年5月4日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，罚没合计6573.0247万元。

报告期内本基金投资的兴业银行（601166）因存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等违规行为，于2018年5月4日被中国银行保险监督管理委员会的处以罚款3870万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对上述证券的投资均系被动按照指数成份股进行复制。

其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 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备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

11.4 报告期内的可转债处于转股期时可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。