中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2019 年第 1 号)

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
截止日: 2019 年 02 月 06 日

重要提示

本基金经中国证监会 2012 年 12 月 21 日证监许可 [2012]1727 号文核准募集。本基金基金合同于 2013 年 2 月 6 日生效。

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,并不表明其对本基金的价值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。

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,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是跟踪中证 500 指数的交易型开放式基金,投资本基金可能遇到的风险还包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金被动跟踪标的指数"中证 500 指数",因此,本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。同时,本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

投资者申购的基金份额当日可卖出, 当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T 日申购的基金份额当日可卖出,T 日申购当日未卖出的基金份额,T+1 日不得卖出和赎回,T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。其中,上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易, 如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所 A 股账户;如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、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,也不向投资者保证最低收益。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、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 2 月 6 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日(未经审计)。

§1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

名称:南方基金管理股份有限公司
住所及办公地址: 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼
成立时间:1998 年 3 月 6 日
法定代表人:张海波
注册资本:3 亿元人民币
电话:(0755)82763888
传真:(0755)82763889
联系人:常克川

1998 年, 南方基金管理有限公司经中国证监会证监基字 [1998]4 号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年, 经中国证监会证监基金字 [2000]78 号文批准进行了增资扩股,注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年,经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股,注册资本达 1.5 亿元人民币。2014 年公司进行增资扩股,注册资本金达 3 亿元人民币。

2018 年 1 月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司,注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

1.2 主要人员情况

1.2.1 董事会成员

张海波先生,董事长,工商管理硕士,中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员,江苏省人民政府办公厅调研员,华泰证券总裁助理、投资银行部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务管理总部总经理,华泰证券副总裁兼华泰紫金投资有限责任公司董事长、华泰金融控股(香港)有限公司董事长、华泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司党委书记、董事长。

王连芬女士,董事,金融专业硕士,中国籍。曾任职赛格集团销售,深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任,大鹏证券经纪业务部副总经理、深圳福虹路营业部总经理、南方总部总经理、总裁助理,第一证券总裁助理,华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办主任、总裁助理。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生,董事,管理学博士,中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司干部,华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生,董事,工学学士,中国籍。曾任职陆军第 124 师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事,陆军第 42 集团军政治部组织处副营职干事,驻香港部队政治部组织处正营职干事,驻澳门部队政治部正营职干事,陆军第 163 师政治部宣传科副科长(正营职),深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、办公厅副主任、党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记,深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生,董事,工商管理硕士,中国籍。曾任职深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘,深圳市投资控股有限公司办公室(信访办)高级主管、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长,深圳市城市建设开发(集团)公司董事。

李自成先生,董事,近现代史专业硕士,中国籍。曾任职厦门大学哲学系团总支副书记,厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计财部经理、公司总经理助理,厦门国际信托投资有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生,董事,临床医学博士,中国籍。曾任职安徽泗县人民医院临床医生,瑞金医院主治医师,兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生,董事,经济学硕士,中国注册会计师,中国籍。曾任职德勤国际会计师行会计专业翻译,光大银行证券部职员,美国 NASDAQ 实习职员,证监会处长、副主任,南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理股份有限公司总裁、党委副书记,南方东英资产管理有限公司董事。

姚景源先生,独立董事,经济学硕士,中国籍。曾任职国家经委副处长,商业部政策研究室副处长、国际合作司处长、副司长,中国国际贸易促进会商业行业分会副会长、常务副会长,国内贸易部商业发展中心主任,中国商业联合会副会长、秘书长,安徽省政府副秘书长,安徽省阜阳市政府市长,安徽省统计局局长、党组书记,国家统计局总经济师兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员,中国经济 50 人论坛成员,中国统计学会副会长。

李心丹先生,独立董事,金融学博士,国务院特殊津贴专家,中国籍。曾任职东南大学经济管理学院教授,南京大学工程管理学院院长。现任南京大学 - 牛津大学金融创新研究院院长、金融工程研究中心主任,南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师,中国金融学年会常务理事,江苏省资本市场研究会会长,江苏省科技创新协会副会长。

周锦涛先生,独立董事,工商管理博士,法学硕士,香港证券及投资学会杰出资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察,香港证券及期货专员办事处证券主任,香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生,独立董事,经济学硕士,工商管理硕士,中国注册会计师,中国籍。曾任职北京市财政局干部,深圳蛇口中华会计师事务所经理,京都会计师事务所副主任。现任致同会计师事务所(特殊普通合伙)管理合伙人,中国证监会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。

周蕊女士,独立董事,法学硕士,中国籍。曾任职北京市万商天勤(深圳)律师事务所律师,北京市中伦(深圳)律师事务所律师,北京市信利(深圳)律师事务所律师、合伙人。现任金杜律师事务所合伙人,全联并购公会广东分会会长,广东省律师协会女律师工作委员会副主任,深圳市中小企业改制专家服务团专家,深圳市女企业家协会理事。

1.2.2 监事会成员

吴晓东先生,监事会主席,法律博士,中国籍。曾任职中国证监会副处长、处长,华泰证券合规总监,华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长,南方股权投资基金管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司监事。

舒本娥女士,监事,大学本科学历,中国籍。曾任职熊猫电子集团公司财务处处长,华泰证券计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理。现任华泰证券股份有限公司财务总监,华泰联合证券有限责任公司监事会主席,华泰长城期货有限公司副董事长,华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士,监事,大学本科学历,高级会计师,中国籍。曾任职浙江兰溪马涧米厂主管会计,浙江兰溪纺织机械厂主管会计,深圳市建筑机械动力公司会计,深圳市建设集团计划财务部助理会计师,深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理,深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长、考核分配部部长。现任深圳市投资控股有限公司财务部部长、深圳经济特区房地产(集团)股份有限公司董事、深圳市建安(集团)股份有限公司董事。

王克力先生,监事,船舶工程专业学士,中国籍。曾任职厦门造船厂技术员,厦门汽车工业公司总经理助理,厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任,厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士,监事,工商管理硕士,中国籍。曾任职厦门对外供应总公司会计,厦门中友贸易联合公司财务部副经理,厦门外供房地产开发公司财务部经理,兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理(主持工作)、风险管理部总经理。现任兴业证券财务部、资金运营管理部总经理,兴证期货管理有限公司董事,兴业创新资本管理有限公司监事。

林斯彬先生,职工监事,民商法专业硕士,中国籍。曾任职金杜律师事务所证券业务部实习律师,上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员,银华基金监察稽核部法务主管,民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理股份有限公司监察稽核部执行董事。

徐刚,职工监事,硕士学历,中国籍。1995 年 7 月专科毕业于山东理工大学机电专业,2010 年 6 月研究生毕业于兰州大学工商管理专业。1995 年 11 月参加工作,就职于深圳期货投资公司,任职职员、项目经理,2003 年 6 月加入公司,先后任职上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司高级经理、副总经理,目前任职上海分公司董事。

董星华,职工监事,硕士学历,中国籍。1991 年 7 月专本科毕业于华中理工大学机械工程专业,2002 年 6 月研究生毕业于中国人民大学政治经济学专业。其 1991 年 11 月参加工作,先后就职于中国人保武汉分公司、中国人寿再保险公司、中国再保险公司、深圳证券通信公司,任职科员、主任科员、经理,2011 年 2 月加入公司,先后任职综合管理部经理、办公室高级经理,现任办公室高级副总裁。

1.2.3 公司高级管理人员

张海波先生,董事长,简历同上。

杨小松先生,总裁,简历同上。

俞文宏先生,副总裁,工商管理硕士,经济师,中国籍。曾任职江苏省投资公司业务经理,江苏国际招商公司部门经理,江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理,江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理,南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生,副总裁,经济学学士,高级经济师,中国籍。曾任职财政部地方预算司及办公厅秘书,中国经济开发信托投资公司综合管理部总经理,南方基金管理有限公司北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

常克川先生,副总裁,EMBA 工商管理硕士,中国籍。曾任职中国农业银行副处级秘书,南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理,华泰联合证券董事会秘书、合规总监等职务,南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生,副总裁,工商管理硕士,中国籍。曾任职美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师,南方基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总裁助理兼固定收益投资总监,南方东英资产管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官(固定收益)。

史博先生,副总裁,经济学硕士,特许金融分析师(CFA),中国籍。曾任职博时基金管理有限公司研究员、市场部总助,中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理,泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理,南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官(权益)。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官(权益)。

鲍文革先生,督察长,经济学硕士,中国籍。曾任职财政部中华会计师事务所审计师,南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理,南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长,南方资本管理有限公司董事。

1.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为:2013 年 2 月至 2013 年 4 月, 潘海宁;2013 年 4 月至今,罗文杰。

罗文杰女士,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理;2013 年 4 月起担任数量化投资部基金经理;现任指数投资部总经理。2013 年 5 月至 2015 年 6 月,任南方策略基金经理;2017 年 11 月至 2019 年 1 月,任南方策略、南方量化混合基金经理;2013 年 4 月至今,任南方 500、南方 500ETF 基金经理;2013 年 5 月至今,任南方 300、南方开元沪深 300ETF 基金经理;2014 年 10 月至今,任 500 医药基金经理;2015 年 2 月至今,任南方恒生 ETF 基金经理;2016 年 12 月至今,任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理;2017 年 7 月至今,任恒生联接基金经理;2017 年 8 月至今,任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理;2018 年 2 月至今,任 H 股 ETF、南方 H 股 ETF 联接基金经理;2018 年 4 月至今, 任 MSCI 基金基金经理;2018 年 6 月至今, 任 MSCI 联接基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官(固定收益)李海鹏先生,副总裁兼首席投资官(权益)史博先生,权益研究部总经理茅炜先生,交易管理部总经理王珂女士,权益投资部总经理张原先生,指数投资部总经理罗文杰女士,现金投资部总经理夏晨曦先生,固定收益投资部总经理李璇女士,固定收益专户投资部总经理乔羽夫先生,固定收益研究部总经理陶铄先生,权益专户投资部总经理刘树坤先生。

1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

§2 基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(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:32,479,411.7 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承继原中国农业银行全部资产、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、业务辐射范围最广,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,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、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"伴你成长"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开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》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、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届"'金牌理财'TOP10 颁奖盛典"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 年连续荣获上海清算所授予的"托管银行优秀奖"和中央国债登记结算有限责任公司授予的"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 年荣获中国基金报授予的公募基金 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、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全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部现有员工近 240 名, 其中具有高级职称的专家 30 余名,服务团队成员专业水平高、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 2018 年 12 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 422 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、严格监察,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,独立行使监督稽核职权。

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;业务操作区专门设置,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;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(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。

§3 相关服务机构

3.1 销售机构

3.1.1 申购赎回代理证券公司

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址:南京市江东中路 228 号 法定代表人:周易 联系人:庞晓芸 联系电话:0755-82492193 客服电话:95597 网址:www.htsc.com.cn
2	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:上海市浦东新区长柳路 36 号 法定代表人:杨华辉 联系人:乔琳雪 联系电话:021-38565547 客服电话:95562 网址:www.xyzq.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 电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 客服电话:95536 网址:www.guosen.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 2-6 层 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:陈共炎 联系人:辛国政 联系电话:010-83574507 客服电话:4008-888-888 或 95551 网址:www.chinastock.com.cn
5	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 法定代表人:杨德红 联系人:芮敏祺 电话:021-38676666 客服电话:4008888666 网址:www.gtja.com
6	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 办公地址:山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人:李玮 联系人:许曼华 电话:021-20315290 传真:021-20315137 客服电话:95538 网址:www.zts.com.cn
7	海通证券股份有限公司	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 电话:021-23219000 传真:021-23219100 联系人:李笑鸣 客服电话:95553 网址:www.htsec.com
8	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 办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号 法定代表人:王常青 联系人:刘畅 联系电话:010-65608231 客服电话:4008888108 网址:www.csc108.com
9	广发证券股份有限公司	注册地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼 法定代表人:孙树明 联系人:黄岚 客服电话:95575 或致电各地营业网点 网址:广发证券网 http://www.gf.com.cn
10	长城证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 办公地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人:丁益 联系人:金夏 联系电话:0755-83516289 客服电话:0755-33680000 4006666888 网址:www.cgws.com
11	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路 111 号 办公地址:深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼 法定代表人:霍达 联系人:黄婵君 联系电话:0755-82960167 客服电话:95565、4008888111 网址:www.newone.com.cn
12	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 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:张佑君 联系人:王一通 电话:010-60838888 传真:010-60833739 客服电话:95558 网址:www.cs.ecitic.com
13	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 40 层 法定代表人:李梅 联系人:李玉婷 电话:021-33389888 传真:021-33388224 客服电话:95523 或 4008895523 网址: www.swhysc.com
14	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 办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人:周健男 联系人:龚俊涛 联系电话:021-22169999 客服电话:95525 网址:www.ebscn.com
15	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 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 办公地址:深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人:高涛 联系人:万玉琳 联系电话:0755-82026907 传真 0755-82026539 客服电话:400-600-8008、95532 网址:www.china-invs.cn
16	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:李琦 电话:0991-5801913 传真:0991-5801466 联系人:王怀春 客服电话:400-800-0562 网址:www.hysec.com
17	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 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 法定代表人:孙永祥 联系人:李欣 联系电话:021-38784580-8918 客服电话:95351 网址:www.xcsc.com
18	安信证券股份有限公司	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:深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层 法定代表人:王连志 联系人:陈剑虹 联系电话:0755-82825551 客服电话:4008001001 网址:www.essence.com.cn
19	中信证券(山东)有限责任公司	注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层 办公地址:山东省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:焦刚 联系电话:0531-89606166 客服电话:95548 网址:sd.citics.com
20	信达证券股份有限公司	注册(办公)地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人:张志刚 联系人:尹旭航 联系电话:010-63081000 传真:010-63080978 客服电话:95321 网址:www.cindasc.com
21	东方证券股份有限公司	注册地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层 办公地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层 法定代表人:潘鑫军 联系人:胡月茹 联系电话:021-63325888 客服电话:95503 网址:www.dfzq.com.cn
22	华融证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街 8 号 办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层 法定代表人:祝献忠 基金业务联系人:孙燕波 联系电话:010-85556048 传真:010-85556088 客服电话:95390 网址:www.hrsec.com.cn
23	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 办公地址: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 联系人:谢国梅 联系电话:010-52723273 客服电话:95584 网址:www.hx168.com.cn
24	东北证券股份有限公司	注册地址:长春市生态大街 6666 号 办公地址:长春市生态大街 6666 号 法定代表人:李福春 联系人:安岩岩 联系电话:0431-85096517 客服电话:95360 网址:www.nesc.cn
25	江海证券有限公司	注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址:黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号 法定代表人:孙名扬 联系人:姜志伟 电话:0451-87765732 传真:0451-82337279 客服电话:400-666-2288 网址:www.jhzq.com.cn
26	国联证券股份有限公司	注册地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层 办公地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层 法定代表人:姚志勇 联系人:祁昊 联系电话:0510-82831662 客服电话:95570 网址:www.glsc.com.cn
27	东莞证券股份有限公司	注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 联系人:李荣 联系电话:0769-22115712 传真:0769-22115712 客服电话:95328 网址:www.dgzq.com.cn
28	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 办公地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 法定代表人:何之江 联系人:王阳 联系电话:021-38637436 客服电话:95511-8 网址:stock.pingan.com
29	国都证券股份有限公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 办公地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 联系人:黄静 电话:010-84183333 传真:010-84183311-3389 客服电话:400-818-8118 网址:www.guodu.com
30	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区星阳街 5 号 办公地址:苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人:范力 联系人:陆晓 电话:0512-62938521 传真:0512-65588021 客服电话:95330 网址:www.dwzq.com.cn
31	华安证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 法定代表人:章宏韬 联系人:范超 联系电话:0551-65161821 客服电话:95318 网址:www.hazq.com
32	华宝证券有限责任公司	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 电话:021-20657517 传真:021-68408217-7517 客服电话:4008209898 网址:www.cnhbstock.com
33	第一创业证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 办公地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼 法定代表人:刘学民 联系人:毛诗莉 联系电话:0755-23838750 客服电话:95358 网址:www.firstcapital.com.cn
34	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号 法定代表人:廖庆轩 联系人:周青 联系电话:023-63786633 客服电话:4008096096 网址:www.swsc.com.cn
35	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 办公地址:上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼 法定代表人:武晓春 联系人:刘熠 电话:021-68761616 传真:021-68767032 客服电话:4008888128 网址:www.tebon.com.cn
36	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼 法定代表人:徐丽峰 联系人:占文驰 联系电话:0791-86283372 客服电话:4008222111 网址:www.gszq.com
37	中国国际金融股份有限公司	注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 办公地址:北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 联系人:杨涵宇 联系电话:010-65051166 客服电话:400-910-1166 网址:www.cicc.com.cn
38	大同证券有限责任公司	注册地址:大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址:山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人:董祥 联系人:薛津 电话:0351-4130322 传真:0351-4192803 客服电话:4007121212 网址:http://www.dtsbc.com.cn
39	方正证券股份有限公司	注册地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22—24 层 办公地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22—24 层 法定代表人:高利 联系人:丁敏 联系电话:010-59355997 客服电话:95571 网址:www.foundersc.com
40	财通证券股份有限公司	注册地址:杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 办公地址:杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 法定代表人:沈继宁 联系人:夏吉慧 联系电话:0571-87925129 客服电话:95336,40086-96336 网址:www.ctsec.com
41	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 楼 办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 法定代表人:赵俊 联系人:王一彦 客服电话:95531;400-888-8588 网址:www.longone.com.cn
42	新时代证券股份有限公司	注册地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人:叶顺德 联系人:田芳芳 联系电话:010-83561146 客服电话:95399 网址:www.xsdzq.cn
43	万联证券股份有限公司	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 联系电话:020-38286026 客服电话:400-8888-133 网址:www.wlzq.cn
44	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 26 楼 办公地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 法定代表人:蔡一兵 联系人:郭静 联系电话:0731-84403347 客服电话: 95317 网址:www.cfzq.com
45	恒泰证券股份有限公司	注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 法定代表人:庞介民 联系人:熊丽 客服电话:4001966188 网址:www.cnht.com.cn
46	华龙证券股份有限公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼 办公地址:兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼 法定代表人:陈牧原 联系人:范坤 电话:0931-4890208 传真:0931-4890628 客服电话:95368 网址:www.hlzq.com
47	华鑫证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元 办公地址:上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号 法定代表人:俞洋 联系人:杨莉娟 电话:021-54967552 传真:021-54967032 客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918 网址:www.cfsc.com.cn
48	中国民族证券有限责任公司	注册地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 法定代表人:赵大建 联系人:齐冬妮 电话:010-59355807 传真:010-56437030 客服电话:4008895618 网址:www.e5618.com
49	宏信证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 法定代表人:吴玉明 联系人:张鋆 电话:010-64083702 传真:028-86199382 客服电话:4008366366 网址:www.hxzq.cn
50	天风证券股份有限公司	注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼 法定代表人: 余磊 联系人:岑妹妹 电话:027-87617017 传真:027-87618863 客服电话:4008005000 或 95391 网址:www.tfzq.com
51	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.1.2 二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司

3.2 登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所、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:陈文祥
电话:021-68419095
传真:021-68870311

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称:广东华瀚律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路 1002 号宝安广场 A 座 16 楼 G.H 室
负责人:李兆良
电话:(0755)82687860
传真:(0755)82687861
经办律师:杨忠、戴瑞冬

3.4 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 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:曹阳
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:薛竞、曹阳

§4 基金名称

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

§5 基金的类型

股票型证券投资基金

§6 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最小化。

§7 基金的投资范围

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非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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)。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 95%,权证、股指期货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。

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。

§8 基金的投资策略

8.1 投资策略

1、投资策略

本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重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。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力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,达到有效跟踪标的指数的目的。

2、投资管理体制和程序

(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

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制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、绩效评估、组合维护等流程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。

研究支持:指数化投资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。

投资决策:投资决策委员会依据指数化投资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。

组合构建:根据标的指数,基金经理构建组合。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。

交易执行:中央交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

投资绩效评估:指数化投资团队定期或不定期对基金进行投资绩效评估,以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。

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体制和程序做出调整,并在《招募说明书》中列示。

8.2 投资组合管理

1、构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、适当替代和逐步购入。

本基金采取复制法确定目标组合,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 95%。如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 个交易日内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析, 如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。

2、日常投资组合管理

(1)可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析:基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停 / 复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪, 分析其对指数跟踪的影响。

(2)投资组合的调整:利用数量化分析模型,优选组合调整方案,并利用自动化指数交易系统调整投资组合,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

(3)制作并公布申购、赎回清单:以 T 日标的指数权重为基础,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。

3、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)定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析,制定改进方案并实施;

(2)根据标的指数的编制规则及调整公告,制定组合调整方案并实施;

(3)根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行支付现金的准备。

4、投资绩效评估

(1)定期对基金的绩效评估进行,主要是对跟踪偏离度进行评估;

(2)指数化投资团队对本基金的运行情况进行量化评估;

(3)基金经理根据量化评估报告,重点分析本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、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下, 力争控制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。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的, 基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本,以及税务及其他监管限制,决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更,本基金管理人需在方法变更前 2 个工作日内在指定媒体公告,并阐明变更复制方法的原因。

§9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。

如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权,或中证 500 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导致本基金管理人认为中证 500 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,在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。其中,若变更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标的指数召开基金份额持有人大会, 并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和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。

§10 基金的风险收益特征

本基金属股票基金, 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。

§11 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。

基金托管人根据本基金合同规定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。

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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 12 月 31 日(未经审计)。

1.1 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	31,929,530,734.12	95.18
	其中:股票	31,929,530,734.12	95.18
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	100,000,000.00	0.30
	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	1,266,128,416.81	3.77
8	其他资产	249,363,750.82	0.74
9	合计	33,545,022,901.75	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数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	332,105,553.50	0.99
B	采矿业	1,010,839,705.67	3.02
C	制造业	18,041,213,063.56	53.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,032,736,623.92	3.09
E	建筑业	588,030,873.19	1.76
F	批发和零售业	1,681,101,560.49	5.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,137,987,233.31	3.40
H	住宿和餐饮业	121,506,822.48	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,881,618,938.88	8.61
J	金融业	1,074,843,442.46	3.21
K	房地产业	1,809,444,098.25	5.41
L	租赁和商务服务业	511,920,158.33	1.53
M	科学研究和技术服务业	53,116,411.60	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	222,001,883.88	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	27,338,646.00	0.08
Q	卫生和社会工作	207,100,138.50	0.62
R	文化、体育和娱乐业	893,618,078.58	2.67
S	综合	302,367,655.11	0.90
	合计	31,928,890,887.71	95.40

1.2.2 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	采矿业	523,739.11	0.00
C	制造业	66,039.50	0.00
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	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	50,145.80	0.00
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	639,924.41	0.00

1.2.3 报告期末按行业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投资股票。

1.3 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

1.3.1 报告期末指数投资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	600201	生物股份	12,416,613	206,115,775.80	0.62
2	000656	金科股份	28,311,769	175,249,850.11	0.52
3	600872	中炬高新	5,915,112	174,259,199.52	0.52
4	600256	广汇能源	42,893,772	161,280,582.72	0.48
5	300146	汤臣倍健	9,363,128	159,079,544.72	0.48
6	300347	泰格医药	3,665,579	156,703,502.25	0.47
7	300253	卫宁健康	11,995,370	149,462,310.20	0.45
8	002410	广 联 达	7,170,011	149,207,928.91	0.45
9	600426	华鲁恒升	12,042,421	145,352,021.47	0.43
10	600642	申能股份	29,027,667	141,655,014.96	0.42

1.3.2 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

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	000693	*ST 华泽	988,187	523,739.11	0.00
2	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
3	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00
–	–	–	–	–	–

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

1.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1901	IC1901	257	212,333,400.00	-10,129,000.00	–
IC1903	IC1903	812	664,053,600.00	-64,362,622.75	–
IC1906	IC1906	849	684,735,480.00	-40,302,720.00	–
公允价值变动总额合计(元)					-114,794,342.75
股指期货投资本期收益(元)					-116,152,200.58
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-50,662,599.42

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力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,达到有效跟踪标的指数的目的。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

无。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

1.10.3 本期国债期货投资评价

无。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

1.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库, 本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	244,226,214.29
2	应收证券清算款	4,346,139.51
3	应收股利	–
4	应收利息	791,397.02
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	249,363,750.82

1.11.4 报告期末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债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000693	*ST 华泽	523,739.11	0.00	暂停上市
2	601860	紫金银行	50,145.80	0.00	新股未上市

§12 基金业绩

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资产,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。

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)
2013.2.6-2013.12.31	7.17%	1.40%	8.03%	1.45%	-0.86%	-0.05%
2014.1.1-2014.12.31	39.20%	1.23%	39.01%	1.24%	0.19%	-0.01%
2015.1.1-2015.12.31	47.56%	2.83%	43.12%	2.82%	4.44%	0.01%
2016.1.1-2016.12.31	-16.52%	1.90%	-17.78%	1.90%	1.26%	0.00%
2017.1.1-2017.12.31	0.50%	0.93%	-0.20%	0.93%	0.70%	0.00%
2018.1.1-2018.12.31	-32.27%	1.51%	-33.32%	1.51%	1.05%	0.00%
自基金成立起至今	25.09%	1.75%	17.60%	1.75%	7.49%	0.00%

§13 基金的费用概览

13.1 与基金运作有关的费用

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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费;

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、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

10、基金上市费及年费;

11、基金的开户费用、账户维护费用

12、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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E× 0.1%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。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

在通常情况下,指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.03%的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算,逐日累计。计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数

H 为每日应付的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元, 计费期间不足一季度的,以一季度计算。许可使用基点费的支付方式为每季度支付一次。自基金合同生效日起,于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述"一、基金费用的种类中第 4-12 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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2 与基金销售有关的费用

1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日公告,计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

4、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

5、投资者在申购或赎回基金份额时, 申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

§14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求, 结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分,对"重要提示"进行了更新。

2、在"基金管理人"部分,对"基金管理人概况"进行了更新,对"主要人员情况"进行了更新。

3、在"基金托管人"部分,对"基金托管人"进行了更新。

4、在"相关服务机构"部分,对"销售机构"进行了更新,对"审计基金财产的会计师事务所"进行了更新。

5、在"基金的投资"部分,对"基金投资组合报告"进行了更新,对"基金业绩"进行了更新。

6、在"基金份额持有人服务"部分,对"基金份额持有人服务"进行了更新。

7、在"其他应披露事项"部分,对"其他应披露事项"进行了更新。

8、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理股份有限公司
2019 年 3 月 15 日