上证新兴产业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 期

基金管理人：诺安基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

(一)上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 2011 年 2 月 16 日证监许可【2011】240 号文核准公开募集，本基金的基金合同于 2011 年 4 月 7 日正式生效。

(二)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。

(三)投资有风险，投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》、基金管理人网站公示的《风险说明书》、基金产品风险等级划分方法及说明等，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，须承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。

本基金以一元初始面值募集基金份额，在市场波动等因素的影响下，基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

(四)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新基金业绩表现的保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

(五)基金管理人根据投资者适当管理办法，对投资者进行分类。投资者应当如实提供个人信息及证明材料，并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。投资者应当知晓并确认当个人信息发生重要变化、可能影响投资者分类和适当性匹配的，应及时主动进行更新。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、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(更新)已经基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2019 年 4 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
公司名称：诺安基金管理有限公司
住所：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层
设立日期：2003 年 12 月 9 日
法定代表人：秦维舟
办公地址：同住所
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号
组织形式：有限责任公司
存续期限：持续经营
电话：0755—83026688
传真：0755—83026677
注册资本：1.5 亿元人民币
联系人：王嘉
股权结构：

股东单位	出资额(万元)	出资比例
中国对外经济贸易信托有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
大恒新纪元科技股份有限公司	3000	20%
合　计	15000	100%

(二)证券投资基金管理情况

截至 2019 年 4 月 7 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金。

(三)主要人员情况

1.董事会成员

秦维舟先生，董事长，工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理，香港昌维发展有限公司总经理，香港先锋投资有限公司总经理，中国新纪元有限公司副总裁，诺安基金管理有限公司副董事长。

伊力扎提?艾合买提江先生，副董事长，历任吉通网络通信股份有限公司人力资源部副总经理，中化国际石油公司人力资源部总经理、公司副总经理，中国对外经济贸易信托有限公司副总经理，中国对外经济贸易信托有限公司副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理。

赵忆波先生，董事，硕士。历任南方航空公司规划发展部项目经理，泰信基金管理有限公司研究员，翰伦投资咨询公司(马丁可利基金)投资经理，纽银西部基金管理有限公司基金经理，现任大恒科技副董事长。

赵照先生，董事，博士。历任中国电力信托投资有限公司北京证券营业部交易部经理、中国电力财务有限公司发展策划部主任、国家电网公司金融资产管理部发展策划处处长、国网英大国际控股集团有限公司发展策划部主任、英大基金管理有限公司副总经理、英大资本管理有限公司总经理等。现任中国对外经济贸易信托有限公司党委委员、副总经理。

孙晓刚先生，董事，本科。历任河北瀛源建筑工程有限公司职员、北京诺安企业管理有限公司副总经理、上海摩士达投资有限公司副总经理及投资总监、上海钟表有限公司副总经理。现任上海钟表有限公司董事长。

奥成文先生，董事，硕士。历任中国通用技术(集团)控股有限责任公司资产经营部副经理，中国对外经济贸易信托有限公司投资银行部副总经理，诺安基金管理有限公司督察长，现任诺安基金管理有限公司总经理。

汤小青先生，独立董事，博士。历任国家计委财政金融司处长，中国农业银行市场开发部副主任，中国人民银行河南省分行副行长，中国人民银行合作司副司长，中国银监会合作金融监管部副主任，内蒙古银监局、山西银监局局长，中国银监会监管一部主任，招商银行副行长。

史其禄先生，独立董事，博士。历任中国工商银行外汇业务管理处处长，中国工商银行伦敦代表处首席代表，中国工商银行新加坡分行总经理，中国工商银行个人金融业务部副总经理，机构业务部副总经理，机构金融业务部资深专家。

赵玲华女士，独立董事，硕士。历任中国人民解放军空军总医院新闻干事，全国妇女联合会宣传部负责人，中国人民银行人事司综合处副处长，国家外汇管理局政策法规司副处长，中国外汇管理杂志社社长兼主编，国家外汇管理局国际收支司巡视员。

2.　监事会成员

秦江卫先生，监事，硕士。历任太原双喜轮胎工业股份有限公司全面质量管理处干部。2004 年加入中国对外经济贸易信托有限公司，历任中国对外经济贸易信托有限公司风险法规部总经理、副总法律顾问。现任中国对外经济贸易信托有限公司总法律顾问、首席风控官，兼任风控合规总部总经理。

赵星明先生，监事，金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长，深圳证券交易所理事会秘书长，君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生，监事，本科。历任浙江证券深圳营业部交易主管、国泰君安证券公司部门主管、诺安基金管理有限公司交易中心总监，现任诺安基金管理有限公司首席交易师(总助级)兼交易中心总监。

梅律吾先生，监事，硕士。历任长城证券有限责任公司研究员，鹏华基金管理有限公司研究员，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。

3.　经理层成员

奥成文先生，总经理，经济学硕士，经济师。曾任中国通用技术(集团)控股有限责任公司资产经营部副经理，中国对外经济贸易信托有限公司投资银行部副总经理。2002 年 10 月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作，任公司督察长，现任公司总经理。

杨文先生，副总经理，企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员，中融基金管理公司市场部经理。2003 年 8 月加入诺安基金管理有限公司，历任市场部总监、发展战略部总监，现任公司副总经理。

杨谷先生，副总经理，经济学硕士，CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员，西北证券公司资产管理部研究员。2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，现任公司副总经理、权益投资事业部总经理、投资一部总监、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

陈勇先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理，民生证券公司证券投资总部副总经理。2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部总监、合规与风险控制部总监、督察长，现任公司副总经理、固定收益事业部总经理。

曹园先生，副总经理，本科。曾任职于国泰基金管理有限公司，先后从事于 TA 交易中心交易员、销售部北方区副总经理、北京公司副总经理的工作。2010 年 5 月加入诺安基金管理有限公司，历任华北营销中心总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理、营销事业部总经理。

马宏先生，督察长，硕士。曾任中国新兴(集团)总公司职员、中化财务公司证券部职员、中化国际贸易股份有限公司投资部副总经理、中国对外经济贸易信托有限公司证券部投资总监、资产管理二部副总经理、投资发展部总经理。现任公司督察长。

4.　基金经理

梅律吾先生，中国国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司；2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监，现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月至 2012 年 11 月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 8 月至 2017 年 10 月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 8 月任诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2015 年 6 月至 2019 年 1 月担任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 2 月起担任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017 年 8 月起担任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 8 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。

5.历任基金经理

宋德舜先生，2011 年 4 月至 2017 年 8 月担任本基金基金经理。

6.投资决策委员会成员的姓名及职务

本公司投资决策委员会分股票类基金投资决策委员会和固定收益类基金投资决策委员会，具体如下：

股票类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、权益投资事业部总经理、投资一部总监、基金经理；韩冬燕女士，权益投资事业部副总经理、基金经理；王创练先生，首席策略师(总助级)兼研究部总监、基金经理。

固定收益类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：陈勇先生，副总经理、固定收益事业部总经理；谢志华先生，固定收益事业部副总经理、基金经理、总裁助理；王创练先生，研究部总监兼首席策略师(总助级)、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人情况

(一)基本情况
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 55 号
成立时间：1984 年 1 月 1 日
法定代表人：陈四清
注册资本：人民币 34,932,123.46 万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

(二)主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、申购赎回代理证券公司

1)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：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层
法定代表人：王连志
开放式基金咨询电话：4008-001-001
开放式基金业务传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82558305
客户服务热线：95517
网址：www.essence.com.cn

2)渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址：天津市河西区宾水道 8 号
法定代表人：王春峰
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
客户服务热线：400-651-5988
网址：www.ewww.com.cn

3)长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号
办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号
法定代表人：李新华
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务热线：95579
网址：www.95579.com

4)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
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
法定代表人：魏庆华
联系电话：010-66555202
传真：010-66555246
客户服务电话：95309
网址：www.dxzq.net.cn

5)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
法定代表人：王少华
电话：010-84183333
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

6)广发证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼
办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、10、18-19、36、38-39、41-44 楼
法定代表人：孙树明
联系人：肖中梅
统一客户服务电话：95575
开放式基金业务传真：020-87555305
网址：http://new.gf.com.cn

7)国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路 13 号
办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦
法定代表人：何春梅
联系人：武斌
联系电话：0755-83707413
传真：0755-83700205
客户服务电话：95563、0771-95563
网址：www.ghzq.com.cn

8)国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市金融一街 8 号
办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦
法定代表人：姚志勇
电话： 0510-82831662
传真： 0510-82830162
联系人：袁丽萍
客户服务电话： 95570
网址： www.glsc.com.cn

9)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路 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
客户服务电话：95521、4008888666
网址：www.gtja.com

10)国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路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国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755—82130833
传真：0755—82133302
联系人：周杨
客户服务热线：95536
网址：www.guosen.com.cn

11)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
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
法定代表人：蔡咏
客户服务热线：95578、400-8888-777
网址：www.gyzq.com.cn

12)广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人：胡伏云
电话： 020-88836999
传真： 020-88836654
联系人：林洁茹
客户服务电话:95396
网址： www.gzs.com.cn

13)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 200120
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层
法定代表人：陈林
电话：021-501222222
联系人：楼斯佳
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com

14)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
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
法定代表人：李素明
客户服务电话：400-871-8880
网址：www.hongtazq.com

15)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：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：021-23219000
传真：021-23219100
客户服务电话：95553、4008888001
网址：www.htsec.com

16)中泰证券股份有限责任公司
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
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
开放式基金咨询电话：0531-81283906
开放式基金业务传真：0531-81283900
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn

17)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：北京西城区太桥大街 19 号
法定代表人：李梅
联系人：曹晔
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客服电话：95523
电话委托：021-962505
网址：www.swhysc.com

18)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：北京西城区太桥大街 19 号
法定代表人：李琦
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

19)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
办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层
法定代表人：侯巍
联系人：张治国
联系电话：0351—8686703
传真：0351—8686709
客户服务电话：95573
网址：www.i618.com.cn

20)信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客户服务电话：95321
网址：www.cindasc.com

21)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
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人：廖庆轩
客户服务电话：4008096096、95355
网址：www.swsc.com.cn

22)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
法人代表：叶顺德
电话：010-83561149
传真：010-83561094
联系人：孙恺
客户服务热线：95399
网址：www.xsdzq.cn

23)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
电话：021-38565547
联系人：乔琳雪
客户服务热线：95562
网址：www.xyzq.com.cn

24)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 2-6 层
法定代表人：陈共炎
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
客户服务热线：400-8888-888 、95551
网址：www.chinastock.com.cn

25)中航证券有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层
法定代表人：王晓峰
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
联系人：余雅娜
客户服务热线：95335、400-88-95335
网址：www.avicsec.com

26)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 楼
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 楼
法定代表人：霍达
电话：0755—82943666
传真：0755—82960141
联系人：黄健
客户服务热线：95565
网址：www.newone.com.cn

27)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：刘晨
电话：021-22169999
传真：021-68815009
客户服务电话：95525
网址：www.ebscn.com

28)浙商证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号
办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6/7 楼
法定代表人：吴承根
联系人：吴颖
电话：0571-87901963
传真：0571-87901955
客户服务电话：95345
网址：www.stocke.com

29)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
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：刘毅
电话：86-0755-82026809
传真 ：86-0755-82026590
客户服务电话：95532、4006008008
网址：www.china-invs.cn

30)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：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：陈忠
电话：010-84683893
传真：010-84865560
客户服务电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com

31)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
办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号中信建投证券公司
法定代表人：王常青
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：4008-888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
客户服务电话：95587
网址：www.csc108.com

32)大同证券有限责任公司
注册地址：山西省大同市迎宾街 15 号桐城中央 21 层
办公地址：山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层
法定代表人：董祥
客户服务电话：4007121212
网址：www.dtsbc.com.cn

2、二级市场交易代理证券公司

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、基金管理人可根据有关法律法规，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
住所：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
电话：4008058058
传真：010-50938907

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称：北京颐合中鸿律师事务所(原北京市颐合律师事务所)
住所：北京市东城区建国门内大街 7 号光华长安大厦 2 座 1910 室
法定代表人 / 负责人：付朝晖
电话：010-65178866
传真：010-65180276
经办律师：虞荣方

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场 E2 座 8 层
执行事务合伙人：邹俊
电话：010 85085000
传真：010 85185111
联系人：左艳霞
经办注册会计师：左艳霞、张品

四、基金名称

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

交易型开放式基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、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。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，同时为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具，该部分资产比例不超过基金资产净值的 10%。

八、标的指数与业绩比较基准

1、本基金的标的指数为：上证新兴产业指数

上证新兴产业指数具有与众不同的行业特点，旨在反映新兴科技和新兴产业深度融合的战略性新兴产业股票的发展变化。目前上证新兴产业指数覆盖 10 个新兴行业，包括信息产业、生物医药、生物育种、新能源、电动汽车、高端制造业、国防及航天、现代服务业、新材料、海洋产业。而这些行业并不是一成不变的，随着时代的发展，新兴行业也在逐渐演化。上证新兴产业指数对战略性新兴行业的选择有三条原则：一是产品要有稳定并有发展前景的市场需求；二是要有良好的经济技术效益；三是要带动一批产业的兴起。

2、本基金业绩比较基准：上证新兴产业指数收益率

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更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的媒体上刊登公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

九、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在特殊情况下，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：(1)法律法规的限制；(2)标的指数成份股流动性严重不足；(3)标的指数的成份股票长期停牌；(4)其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 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。

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、决策、组合构建、交易、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：基金经理、研究人员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、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。

(2)投资决策：投资决策委员会依据研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策委员会会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股及其权重的方法构建组合。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，以降低买入成本、控制投资风险。

(4)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。

(5)投资绩效评估：风控经理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、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程序做出调整，并在招募说明书及其更新中公告。

4、投资组合管理

(1)组合建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、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标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。

2)确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析，确定合理的建仓策略。

3)逐步调整：根据完全复制法确定目标组合之后，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金将在《基金合同》生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回导致现金头寸提高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。

(2)组合日常管理

1)根据标的指数构成及权重，结合基金当前持有的证券组合及其比例，制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告；

2)将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较，制定目标组合构成及权重，确定合理的交易策略；

3)实施合理的交易策略，以实现基金最优组合结构。

(3)成份股定期调整及临时调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少成份股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

(4)成份股信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息(如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等)以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并据以确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

(5)申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

(6)替代投资

对个别成份股，若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重大不利的司法诉讼或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，或者选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其他股票来代替，即采用“替代投资策略”应对。采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小化，以利于本基金投资目标的实现。

5、衍生品投资

为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标，是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，以便更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各种衍生工具的比例不超过基金资产净值的 10%。

基金拟投资于新推出的金融衍生产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并报告中国证监会备案后公告。

十、风险收益特征

本基金是股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2019 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

(一)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	17,011,016.04	96.75
	其中：股票	17,011,016.04	96.75
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	570,073.32	3.24
8	其他资产	629.46	0.00
9	合计	17,581,718.82	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	309,890.00	1.78
C	制造业	12,010,129.07	68.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	671,050.00	3.85
E	建筑业	788,279.00	4.52
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	1,761,241.58	10.11
J	金融业	-	-
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	253,314.00	1.45
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	15,793,903.65	90.62

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	1,217,112.39	6.98
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	-	-
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	1,217,112.39	6.98

(三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	600570	恒生电子	5,445	476,764.20	2.74
2	600460	士兰微	28,000	459,480.00	2.64
3	600276	恒瑞医药	6,707	438,771.94	2.52
4	600031	三一重工	33,726	431,018.28	2.47
5	600584	长电科技	27,718	391,100.98	2.24
6	600588	用友网络	11,000	372,900.00	2.14
7	600309	万华化学	8,100	368,793.00	2.12
8	600025	华能水电	89,300	366,130.00	2.10
9	601012	隆基股份	13,980	364,878.00	2.09
10	601989	中国重工	61,600	359,744.00	2.06

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	600485	信威集团	83,421	1,217,112.39	6.98

(四)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。

(五)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。

(六)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。

(七)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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九)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投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

(十一)投资组合报告附注

1、本基金本报告期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的情形，也没有出现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	515.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	629.46

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

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。

5.2、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

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	600485	信威集团	1,217,112.39	6.98	重大事项

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

(一)上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2011.4.7～2011.12.31	-31.90%	1.42%	-36.54%	1.52%	4.64%	-0.10%
2012.1.1～2012.12.31	-3.82%	1.52%	-3.64%	1.54%	-0.18%	-0.02%
2013.1.1～2013.12.31	19.08%	1.50%	19.65%	1.54%	-0.57%	-0.04%
2014.1.1～2014.12.31	32.31%	1.28%	33.83%	1.31%	-1.52%	-0.03%
2015.1.1～2015.12.31	27.13%	2.79%	28.02%	3.07%	-0.89%	-0.28%
2016.1.1～2016.12.31	-16.31%	1.76%	-16.34%	1.85%	0.03%	-0.09%
2017.1.1～2017.12.31	8.74%	0.79%	10.23%	0.87%	-1.49%	-0.08%
2018.1.1～2018.12.31	-23.53%	1.34%	-24.17%	1.50%	0.64%	-0.16%
2019.1.1～2019.3.31	23.33%	1.49%	27.22%	1.66%	-3.89%	-0.17%
2011.4.7～2019.3.31	12.60%	1.64%	11.52%	1.76%	1.08%	-0.12%

注：本基金的业绩比较基准为：上证新兴产业指数收益率。

(下转 D104 版)