

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金  
更新的招募说明书摘要

(2019 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一九年五月

## 重要提示

上证180交易型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2006年2月22日证监基金字[2006]30号文批准募集。本基金基金合同自2006年4月13日正式生效。

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。

投资有风险，投资人申购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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，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。

本招募说明书摘要中涉及与托管人相关的基金信息已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年4月13日，有关财务数据截止日为2019年3月31日，净值表现截止日为2018年12月31日。

## 目 录

|                        |    |
|------------------------|----|
| 一、基金管理人 .....          | 4  |
| 二、基金托管人 .....          | 8  |
| 三、相关服务机构 .....         | 10 |
| 四、基金的名称 .....          | 27 |
| 五、基金的类型 .....          | 27 |
| 六、基金的投资目标 .....        | 27 |
| 七、基金的投资方向 .....        | 28 |
| 八、基金的投资策略 .....        | 28 |
| 九、基金的业绩比较基准 .....      | 29 |
| 十、基金的风险收益特征 .....      | 29 |
| 十一、基金投资组合报告 .....      | 29 |
| 十三、费用概览 .....          | 36 |
| 十四、对招募说明书更新部分的说明 ..... | 37 |

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998年6月4日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
- 6、注册资本：1.5亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：（021）38969999
- 11、客户服务电话：40088-50099
- 12、联系人：王艳
- 13、网址：www.huaan.com.cn

### （二）注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5亿元人民币
- 2、股权结构

| 持股单位           | 持股占总股本比例 |
|----------------|----------|
| 国泰君安证券股份有限公司   | 20%      |
| 上海上国投资产管理有限公司  | 20%      |
| 上海锦江国际投资管理有限公司 | 20%      |
| 上海工业投资（集团）有限公司 | 20%      |
| 国泰君安投资管理股份有限公司 | 20%      |

### （三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

#### （1）董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited 董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、权益投资部总经理、战略投资部总经理等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理

组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

#### 独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

#### （2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

#### （3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，20 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，17 年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士，硕士研究生学历，18 年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生，硕士研究生学历，24 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，15 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，19 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

## 2、本基金基金经理

现任基金经理：

许之彦先生，理学博士，15 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018

年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

历任基金经理：

刘光华先生，2006 年 4 月 13 日至 2007 年 3 月 14 日担任本基金基金经理。

卢赤斌先生，2006 年 4 月 13 日至 2009 年 10 月 20 日担任本基金基金经理。

刘 璎女士，2007 年 3 月 14 日至 2010 年 6 月 26 日担任本基金基金经理。

牛 勇先生，2010 年 6 月 18 日至 2012 年 12 月 22 日担任本基金基金经理。

章海默女士，2012 年 12 月 22 日至 2015 年 9 月 11 日担任本基金基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童威先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

谢振东先生，基金投资部副总监

崔莹先生，基金投资部助理总监

上述人员之间不存在亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至 2019 年 3 月 31 日，公司目前共有员工 361 人（不含香港公司），其中 57%具有硕士及以上学历，92%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

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：田国立

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)6759 5096

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。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行

国际部、营业部并担任副行长，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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、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 2018 年二季度末，中国建设银行已托管 857 只证券投资基金。中国建设银行专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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、申购赎回代办证券公司（简称：一级交易商）：

##### （1）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 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

电话：(021) 38676798

传真：(021) 38676798

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

(2) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：021-96250500

网址：www.swhysc.com

(3) 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

电话：(021) 23219000

传真：(021) 63410627

客服电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

(4) 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

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82944669

客服电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(5) 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：杨泽柱

电话：4008888999

传真：(027) 85481900

客服电话：95579

网址：www.cjcs.com.cn

(6) 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

电话：(021) 22169999

传真：(021) 62151789

客户服务电话：95525

网站：www.ebscn.com

(7) 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、39-44 楼

法定代表人：孙树明

电话：(020) 87550265

传真：(020) 87553600

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(8) 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 2-6 层

法定代表人：陈有安

电话：(010) 66568047

传真：(010) 66568536

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（9）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

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

电话：（021）53519888

传真：（021）53519888

客服电话：4008918918

网址：www.shzq.com

（10）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

电话：（0755）23835383

传真：（010）60836029

客服电话：0755-23835888

网址：www.cs.ecitic.com

（11）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

（12）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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：(010) 65183888

传真：(010) 65182261

客服电话：95587

公司网站：www.csc108.com

(13) 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 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26 层、27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

电话：(010) 65051166

传真：(010) 65051156

客户服务电话：(010)65051166

网址：www.cicc.com.cn

(14) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

法定代表人：谢永林

电话：4008866338

传真：(0755) 82400862

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(15) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

电话：(0371) 65585670

传真：(0371) 65585665

客户服务电话：95377

网址：www.ccnew.com

(16) 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 21 层-23 层、25 层—29 层、32、36、39、40 层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326010

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(17) 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 层

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：4008888588

网址：www.longone.com.cn

(18) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：吴万善

电话：(025) 83290551

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(19) 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) 82130833-2181

传真：(0755) 82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(20) 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：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

电话：(0771) 5539262

传真：(0771) 5539033

客户服务电话：全国 400-8888-100；广西 0771-5539032

网址：www.ghzq.com.cn

(21) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市曹杨路 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：姚文平

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客户服务中心电话：4008888128

网址：www.tebon.com.cn

(22) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

(23) 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：李季

联系电话：(010) 88085858



传真号码：(010) 88085195

客户服务电话：0991-400-800-0562

网址：www.swhysc.com

(24) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419974

传真：(021) 68419867

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(25) 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 18-21 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 18-21 层

法定代表人：胡长生（代）

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

网址：www.cjis.cn

客服电话：4006-008-008

网址：http://www.china-invs.cn

(26) 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

法定代表人：蔡咏

电话：(0551) 62207323

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

(27) 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：常喆

电话：(010) 84183389

传真：(010) 64482090

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(28) 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：况雨林

电话：(0871) 3577930

传真：(0871) 3578827

客户服务电话：(0871) 63577930

网址：www.hongtazq.com

(29) 湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地点：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：林俊波

电话：(021) 68634518

传真：(021) 68865680

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

(30) 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：天津市南开区滨水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：(022) 28451861

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

(31) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷中大道 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：王宜四

电话：(0791) 6768763

传真：(0791) 6789414

客户服务电话：4008866567

网址：www.avicsec.com

(32) 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

电话：(0755) 82825551

传真：(0755) 82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

(33) 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 16/17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

法定代表人：邵崇(代行)

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83516199

客户服务电话：400-6666-888

公司网站：www.cgws.com

(34) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：陈宏

电话：(021) 36533016

传真：(021) 36533017

客服热线：4009112233

网址: [www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

(35) 中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人: 黄扬录

电话: (0755) 82943755

传真: (0755) 82940511

客户服务电话: 4001022011

网址: [www.zszq.com.cn](http://www.zszq.com.cn)

(36) 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: 邱三发

电话: (020) 88836999

传真: (020) 88836654

客户服务电话: (020) 83963933

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(37) 万联证券有限责任公司

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 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人: 张建军

电话: (020) 37865070

传真: (020) 37865030

客户服务电话: 400-8888-133

网址: [www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(38) 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

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人: 张运勇

电话: (0769) 22119351

传真：(0769) 22119423

客户服务电话：0769-95328

网址：www.dgzq.com.cn

(39) 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 号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(40) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州市工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：(0512) 62601555

传真：(0512) 62938812

客户服务电话：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

(41) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号东北证券大厦

法定代表人：李福春

电话：(0431) 85096806

传真：(0431) 85096816

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

(42) 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：余维佳

电话：(023) 63786433

传真：(023) 63786477

客户服务电话：40080-96096

网址：www.swsc.com.cn

(43) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：(028) 86690125

传真：(028) 86690126

客户服务电话：4006-600109

网址：www.gjzq.com.cn

(44) 方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

电话：(0731) 85832367

传真：(0731) 85832366

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

(45) 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

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

电话：(0351) 8686966

传真：(0351) 8686667

客户服务电话：95573

网址：www.sxzq.net

(46) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

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) 50122107

传真：(021) 50122078

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(47) 北京高华证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号北京英蓝国际中心 18 层 1801-1806 室、1826-1832 室

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号北京英蓝国际中心 18 层 1801-1806 室、1826-1832 室

法定代表人：章星

电话：(010) 66273000

传真：(010) 66273001

客户服务电话：4006508356

网址：http://www.ghsl.cn

(48) 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

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客服电话：0571-96336

网址：www.ctsec.com

(49) 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：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

电话：(010) 58568007

传真：(010) 58568062

客户服务电话：(010) 58568118

网址: [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

(50) 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

电话: (010) 66555171

传真: (010) 66555397

客户服务电话: 010-66555835

网址: [www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

(51) 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: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

电话: (0451) 82336863

传真: (0451) 82287211

客户服务电话: 40066-62288

网址: [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(52) 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

电话: (0571) 87901053

传真: (0571) 87901913

客户服务电话: 967777

网址: [www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

(53) 中银国际证券有限责任公司

注册地址: 中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址: 中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39、40、41 层

法定代表人: 钱卫

电话: (021) 68604866



传真：(021) 58883554

客户服务电话：4006208888

网址：www.bocichina.com

(54) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区三环西路 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 号西海国际中心 1 号楼 15 层

法定代表人：刘汝军

电话：(010) 83561149

传真：(010) 83561094

客户服务电话：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

(55) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

电话：(025) 83367888-4201

传真：(025) 83320066

联系人：胥春阳

客服电话：400-828-5888

网址：www.njzq.com.cn

(56) 中泰证券股份有限公司

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

法定代表人：李玮

传真：(0531) 68889752

客户服务电话：95538

网址：http://www.zts.com.cn/

(57) 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 40 层-43 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40 层-43 层

法定代表人：赵大建

客服电话：400-889-5618

网址：<http://www.e5618.com>

(58) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

客服电话：400-196-6188 网址：<http://www.cnht.com.cn>

(59) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城区东大街 232 号陕西信托大厦 16 层

办公地址：陕西省西安市新城区东大街 232 号陕西信托大厦 16 层

法定代表人：刘建武

客服电话：95522

网址：<http://www.westsecu.com>

2、二级市场交易代办证券公司

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。

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发售本基金，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

地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系电话：(010) 59378835

传真：(010) 59378839

联系人：朱立元

## (三) 律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：秦悦民

经办律师：秦悦民、王利民

#### (四) 会计师事务所和经办注册会计师

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 5 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：魏佳亮

经办会计师：单峰、魏佳亮

## 四、基金的名称

本基金名称：上证 180 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。

## 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最小化。

## 七、基金的投资方向

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，投资于指数成份股、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、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在十个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

## 八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况）导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

### 1、决策依据

- （1）法律法规和基金合同的有关规定；
- （2）标的指数编制、调整等相关规定，以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略。

### 2、决策程序

研究开发、投资决策、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）研究开发：金融工程小组通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析，进行基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，定期撰写研究报告，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产品开发小组所开发的指数模拟策略，以及金融工程小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，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标的指数成分股

权重方法构建组合。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：集中交易部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：金融工程小组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，并在基金更新的招募说明书及其更新中公告。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，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，基金管理人将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

本基金的业绩比较基准为标的指数。若本基金标的指数发生变更，则本基金业绩比较基准随之发生变化。

## 十、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。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

## 十一、基金投资组合报告

### 1、重要提示

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。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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至 2019 年 3 月 31 日。

## 2、投资组合报告

### 2.1 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              | 19,420,344,605.92 | 99.48        |
|    | 其中：股票             | 19,420,344,605.92 | 99.48        |
| 2  | 固定收益投资            | 33,842,000.00     | 0.17         |
|    | 其中：债券             | 33,842,000.00     | 0.17         |
|    | 资产支持证券            | —                 | —            |
| 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      | 68,169,515.19     | 0.35         |
| 7  | 其他各项资产            | 101,440.14        | —            |
| 8  | 合计                | 19,522,457,561.25 | 100.00       |

### 2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.2.1 积极投资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 | —       | —            |
| B  | 采矿业      | —       | —            |

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| C | 制造业              | 25,897,464.00 | 0.13 |
| 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               | 25,897,464.00 | 0.13 |

## 2.2.2 指数投资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         | 16,145,478.00    | 0.08         |
| B  | 采矿业              | 799,093,615.14   | 4.10         |
| C  | 制造业              | 5,912,536,167.05 | 30.32        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 630,804,630.75   | 3.23         |
| E  | 建筑业              | 835,472,452.14   | 4.28         |
| F  | 批发和零售业           | 197,586,176.84   | 1.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 621,890,750.61   | 3.19         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 533,407,057.06   | 2.74         |
| J  | 金融业              | 8,846,154,313.88 | 45.36        |

|   |               |                   |       |
|---|---------------|-------------------|-------|
| K | 房地产业          | 759,204,878.34    | 3.89  |
| L | 租赁和商务服务业      | 168,951,743.04    | 0.87  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 22,873,316.00     | 0.12  |
| 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     | 50,326,563.07     | 0.26  |
| S | 综合            | -                 | -     |
|   | 合计            | 19,394,447,141.92 | 99.45 |

## 2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

### 2.3.1 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  | 601318 | 中国平安 | 25,249,578 | 1,946,742,463.80 | 9.98         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 1,170,917  | 999,951,408.83   | 5.13         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 24,050,900 | 815,806,528.00   | 4.18         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 29,052,832 | 527,889,957.44   | 2.71         |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 18,345,164 | 454,593,163.92   | 2.33         |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 14,167,723 | 412,422,416.53   | 2.11         |
| 7  | 600276 | 恒瑞医药 | 6,179,952  | 404,292,459.84   | 2.07         |
| 8  | 601328 | 交通银行 | 64,040,949 | 399,615,521.76   | 2.05         |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 57,860,101 | 366,833,040.34   | 1.88         |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 89,316,816 | 333,151,723.68   | 1.71         |

### 2.3.2 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  | 600485 | 信威集团 | 4,123,800 | 25,897,464.00 | 0.13         |

## 2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|



|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 1  | 国家债券      | -             | -    |
| 2  | 央行票据      | -             | -    |
| 3  | 金融债券      | -             | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -    |
| 4  | 企业债券      | -             | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -    |
| 6  | 中期票据      | -             | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 33,842,000.00 | 0.17 |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 33,842,000.00 | 0.17 |

## 2.5 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 110053 | 苏银转债 | 280,280 | 28,028,000.00 | 0.14         |
| 2  | 110054 | 通威转债 | 58,140  | 5,814,000.00  | 0.03         |

## 2.6 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。

## 2.7 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。

## 2.8 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。

## 2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

### 2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 2.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

## 2.11 投资组合报告附注

2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2.11.2 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。

### 2.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 84,439.19  |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 16,211.05  |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | 789.90     |
| 9  | 合计      | 101,440.14 |

### 2.11.4 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处于转股期的可转换债券。

### 2.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

#### 2.11.5.1 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不存在流通受限的情况。

2.11.5.2 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<br>公允价值(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限情况<br>说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 600485 | 信威集团 | 25,897,464.00      | 0.13             | 重大资产重组       |

## 十二、基金的业绩

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财产，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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2018 年 12 月 31 日）

| 阶段                                        | 净值<br>增长率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|-------------------------------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 自 2006-4-13<br>（合同生效<br>日）至<br>2006-12-31 | 81.63%     | 1.48%             | 87.32%             | 1.53%                     | -5.69% | -0.05% |
| 2007-1-1 至<br>2007-12-31                  | 146.39%    | 2.25%             | 151.55%            | 2.28%                     | -5.16% | -0.03% |
| 2008-1-1 至<br>2008-12-31                  | -64.55%    | 2.96%             | -66.34%            | 3.07%                     | 1.79%  | -0.11% |
| 2009-1-1 至<br>2009-12-31                  | 87.82%     | 2.03%             | 91.77%             | 2.06%                     | -3.95% | -0.03% |
| 2010-1-1 至<br>2010-12-31                  | -15.45%    | 1.55%             | -16.04%            | 1.56%                     | 0.59%  | -0.01% |
| 2011-1-1 至<br>2011-12-31                  | -22.58%    | 1.30%             | -23.14%            | 1.30%                     | 0.56%  | 0.00%  |
| 2012-1-1 至<br>2012-12-31                  | 12.40%     | 1.25%             | 10.80%             | 1.25%                     | 1.60%  | 0.00%  |
| 2013-1-1 至<br>2013-12-31                  | -7.24%     | 1.43%             | -9.19%             | 1.44%                     | 1.95%  | -0.01% |
| 2014-1-1 至<br>2014-12-31                  | 62.72%     | 1.26%             | 59.60%             | 1.26%                     | 3.12%  | 0.00%  |
| 2015-1-1 至<br>2015-12-31                  | 1.42%      | 2.48%             | -0.61%             | 2.49%                     | 2.03%  | -0.01% |
| 2016-1-1 至<br>2016-12-31                  | -7.87%     | 1.36%             | -9.64%             | 1.36%                     | 1.77%  | 0.00%  |

|                          |         |       |         |       |       |        |
|--------------------------|---------|-------|---------|-------|-------|--------|
| 2017-1-1 至<br>2017-12-31 | 21.58%  | 0.60% | 19.69%  | 0.60% | 1.89% | 0.00%  |
| 2018-1-1 至<br>2018-12-31 | -19.87% | 1.28% | -21.26% | 1.29% | 1.39% | -0.01% |

基金的过往业绩并不预示其未来。

## 十三、费用概览

### （一）基金运作费用

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

4、证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金分红手续费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相关合同的规定，按费用实际支出金额支付，

列入当期基金费用。

## （二）基金销售费用

申购、赎回佣金：

投资人在申购或赎回基金份额时，需按照招募说明书第十节第（六）款的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

申购/赎回佣金=申购/赎回份额×申购、赎回佣金比率

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资人申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

## （三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。基金标的指数使用费由基金管理人承担。

## （四）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

# 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》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：

| 章节       | 主要更新内容                 |
|----------|------------------------|
| 三、基金管理人  | 更新了基金管理人的有关信息。         |
| 四、基金托管人  | 更新了基金托管人的相关信息。         |
| 五、相关服务机构 | 更新了会计师事务所的信息。          |
| 十一、基金的投资 | 更新了本基金最近一期投资组合报告等相关信息。 |

|             |                                                   |
|-------------|---------------------------------------------------|
| 十二、基金的业绩    | 更新了基金合同生效以来的投资业绩。                                 |
| 二十四、其他应披露事项 | 披露了自 2018 年 10 月 13 日至 2019 年 4 月 13 日期间本基金的公告信息。 |

华安基金管理有限公司

二〇一九年五月二十八日