

(上接B009版)

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.stock.com.cn/sszcq/index/index.jsp
(64)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路荣超大厦4036号16-20
办公地址:深圳市福田区金田路荣超大厦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:965118
网址:stock.pingan.com/index.shtml
(65)华安证券有限责任公司
注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
电话:(0651)5161666
传真:(0651)5161600
客户服务电话:96618
网址:www.haazq.com
(66)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市场南路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:张雅维
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
客户服务电话:(0771)5539032
网址:www.gzhzq.com.cn
(67)东方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层
办公地址:湖南长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27层
法定代表人:蔡一兵
电话:(0731)4403343
传真:(0731)4403439
客户服务电话:0731-84403360
网址:www.cfzq.com
(68)东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
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:张运明
电话:(0769)22119351
传真:(0769)22119423
客户服务电话:0769-9611130
网址:www.dgzq.com.cn
(69)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)65685670
传真:(0371)65685665
客户服务电话:(0371)967218
网址:www.ccnew.com
(70)国都证券有限责任公司
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:常松
电话:(010)84183389
传真:(010)64482060
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
(71)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)150589660-8636
传真:(021)150589660-8611
客户服务电话:4008888588
网址:www.longone.com.cn
(72)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:许刚
电话:(021)68604866
传真:(021)58883564
客户服务电话:4006208888
网址:www.bocichina.com
(73)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
电话:(0471)4913998
传真:(0471)4930707
客户服务电话:(0471)4961259
网址:www.cnhst.com.cn
(74)国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小春
电话:(0791)6289771
传真:(0791)6289396
客户服务电话:4008222111
网址:www.gsstock.com
(75)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人:冯戎
联系电话:(010)88085858
客户服务热线:(010)88085195
客户服务电话:0991-400-800-0562
客户服务网站:www.hysec.com
(76)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路96号
办公地址:山东省济南市经七路96号
法定代表人:李玮
传真:(0631)6869752
客户服务电话:965965638
网址:www.qizq.com.cn
(77)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:姜昧军
电话:(0755)83199511
传真:(0755)83199545
客户服务电话:0755-83199509
公司网站:www.csco.com.cn
(78)第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26号
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26号
26号
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26号
26号
法定代表人:刘学民
电话:(0755)26832583
传真:(0755)26831718
客户服务电话:4008881888
网址:www.firstcapital.com.cn
(79)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
法定代表人:王哲四
电话:(0791)6788763
传真:(0791)6789414
客户服务电话:4008869567
网址:www.avicsec.com
(80)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市曹杨路510号南半幢6楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”20楼
法定代表人:姚文平
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008881828
网址:www.tebon.com.cn
(81)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东大街222号陕西信托大厦16-17层
办公地址:西安市东大街222号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:(029)18760172
客户服务电话:4008881828
网址:www.tebon.com.cn
(82)华信证券有限责任公司
注册地址:上海市静安区南京西路1601号静安国际大厦A座41层
办公地址:上海市静安区南京西路1601号静安国际大厦A座41层
法定代表人:王哲四
电话:(0791)6788763
传真:(0791)6789414
客户服务电话:4008869567
网址:www.avicsec.com
(83)华安证券有限责任公司
注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
电话:(0651)5161666
传真:(0651)5161600
客户服务电话:96618
网址:stock.pingan.com/index.shtml
(84)中国国际金融有限公司
注册地址:中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座26层、26层、27层及28层
28层
法定代表人:金立群
电话:(010)65061166
传真:(010)65061166
客户服务电话:(010)65061166
网址:www.ciccc.com.cn
(85)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜轩
电话:(010)156226788
传真:(010)156226799
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssec.com.cn
(86)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
21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客服电话:400-600-8008
网址:www.china-invs.cn
(87)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:黄扬录
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82940611
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(88)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路165号附1号
办公地址:云南省昆明市北京路165号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人:倪雨林
电话:(0871)3577930
传真:(0871)3578827
客户服务电话:(0871)63577930
网址:www.hongtata.com
(89)日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
电话:(0471)6292587
传真:(0471)6292477
客户服务电话:www.rxxq.com.cn
(90)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
(91)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
(92)华鑫证券有限责任公司
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:陈兵
电话:(021)50122107
传真:(021)50122078
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com
(93)厦门证券有限公司
注册地址:福建省厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址:厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人:傅晓辉
电话:(0592)15161642
传真:(0592)15161140
客户服务电话:(0592)15163588
网址:www.xmzq.com.cn
(94)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:宫龙云
电话:(021)32229888
传真:(021)62878701
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.aijzq.com/common/index.jsp
(95)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:吴锡
电话:(0755)83007041 / 83007166
电话:(0755)83007034
客户服务电话:0755-26862993
网址:www.ydsc.com.cn
(96)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:祝敏忠
电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客户服务电话:58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(97)财达证券有限责任公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路36号
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路36号庄家金融大厦2层
法定代表人:崔建强
电话:(0311)86028442
传真:(0311)66002244
客户服务电话:4006128888
网址:www.s10000.com
(98)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:武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
电话:(027)87618889
传真:(027)87618963
客户服务电话:(028)186712334
网址:www.tfzq.com
(99)中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马功勋
电话:(024)23266917
传真:(024)23265606
客户服务电话:4006180315
网址:www.ztstock.com.cn
(100)大通证券股份有限公司
注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连国际大厦38、39层
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连国际大厦38、39层
法定代表人:李红光
电话:(0411)39673301
传真:(0411)39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.estock.com.cn
(101)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:(010)66446008
传真:(010)66045500
客户服务电话:(010)66045678
网址:www.txsc.com / jijin.txsc.com
(102)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
法定代表人:杨敏敏
电话:(021)38784818
传真:(021)68775878
联系人:倪昶
客户服务电话:021-38784818
公司网站:www.cf-clsa.com
(103)财通证券股份有限公司
注册地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈晓明
客服电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com
(104)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号903-906室
法定代表人:杨文义
电话:400-700-9605
传真:(021)68593916
网址:www.ehowbuy.com
(105)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号3幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人:其实
电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn
(106)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市仓前街道海曙路2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
法定代表人:陈柏青
电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
(107)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
法定代表人:张跃伟
电话:(021)58788678
传真:(021)58787698
客户服务电话:400-089-1289
网址:www.e-rich.com.cn
(108)东亚银行(中国)有限公司
注册地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
法定代表人:李国宝
电话:(021)38663666
传真:(021)38663666
电话:008620301111
网址:www.hkba.com.cn
(109)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区嘉下路浦商广场7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号8楼
法定代表人:汪静波
电话:(021)38600676
传真:(021)38600777
电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(110)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:易峰
电话:0671-88920879
传真:0671-88900443
电话:0671-88920897 4008-773-772
网址:www.5ifund.com
(111) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路22号11层1101室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号11层1101室
法定代表人:王振杰
电话:(46-10)63202008-8902
网址:www.myfund.com
(112) 中期资产管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层
法定代表人:路瑶
电话:010-59639718,59639728
传真:010-65807110
电话:96162,4008888160
网址:www.citicfund.com
(113) 万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区西四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区西四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人:李海峰
电话:010-59393073
传真:010-59393024
电话:4008000699
网址:www.wy-fund.com
(114) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单
元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单
元
法定代表人:孙名扬
电话:4006-788-987
传真:0755-82087098
网址:www.zlfund.cn www.jmmw.com
(115) 联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:张永海
电话:(021)20835787
传真:(021)20835679
(117) 中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人:王兵
客服电话:96162
公司网站:www.cifco.net
(二)基金注册与过户登记人
名称:华安基金管理有限公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道8号,上海国金中心二期31、32层
法定代表人:朱学华
电话:(021)38696999
传真:(021)33627962
联系人:赵良
客户服务电话:40088-50099
(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
经办律师:韩炯、秦源
(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6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:傅琛琛
经办会计师:汪捷、傅琛琛

基金名称:华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
基金类型:契约型开放式
本基金类型:契约型开放式

一、基金的投资目标
运用增强型指数化投资策略,通过控制投资组合相对MSCI中国A股指数有限的偏离,力求基金收益适度超越基准基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。

九、基金的投资范围
本基金资产主要投资于标的指数成份股。具体的投资范围为:
1、投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%,本基金投资MSCI中国A股指数成份股的投资比例在50个交易日内不持续低于组合中股票市值的90%。
2、参与股票一级市场的市值配售以及MSCI中国A股指数成份股的增发和配股。
3、在成份股之外的股票投资,仅限于未上市且申购新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资组合中替代成份股的其他个股。
4、在目前法律法规许可下,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。
5、经中国证监会批准允许本基金投资的其他金融工具。

十、基金的投资决策
(一)投资流程
1、投资原则及选择标准
(1)投资组合的基本原则
1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

二、股票投资组合构建
(1)股票指数化投资组合构建:
本基金采用指数化投资方式,通过复制法来实现对MSCI中国A股指数的跟踪,具体过程如下:
①以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重为基础拟定标准权重的指数化投资组合方案;
②根据拟定的标准权重,对标准权重的指数化投资组合进行调整,形成跟踪增强型投资组合方案。
(2)跟踪误差控制
①跟踪误差控制:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

三、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

四、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

五、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

六、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

七、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

八、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

九、基金的投资风险控制
(一)投资原则及选择标准
(1)资产配置原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少避险风险工具的情况下,可以采取开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产配置比例。
(2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基准,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期跟踪组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行微调,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购,股票增发等。
(3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,023,934,477.62	94.13
	其中:股票	4,023,934,477.62	94.13
2	固定收益投资	61,611,741.31	1.44
	其中:债券	61,611,741.31	1.44
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	167,839,133.12	3.93
7	其他资产	21,598,342.69	0.51
8	合计	4,274,983,694.74	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	1,387,978.90	0.03
B	采矿业	38,983,596.69	0.74
D	电力、热力、燃气及生产供应业	195,295,915.35	3.81
E	建筑业	16,020,600.20	0.38
F	批发和零售业	2,717,743.35	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,820,168.42	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,057,412.75	0.26
J	金融业	2,331,729.65	0.05
K	房地产业	23,143,833.15	0.54
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	6,630,241.05	0.16
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	262,189,219.81	6.17

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	42,638,246.15	1.00
B	采矿业	132,744,955.99	3.12
C	制造业	1,553,359,907.02	36.55
D	电力、热力、燃气及生产供应业	141,295,720.71	3.33
E	建筑业	178,913,286.85	4.21
F	批发和零售业	268,104,829.38	6.31
G	交通运输、仓储和邮政业	121,436,839.19	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,266,437.79	3.70
J	金融业	912,275,656.76	21.47
K	房地产业	73,266,077.04	1.72
L	租赁和商务服务业	81,960,430.60	1.93
M	科学研究和技术服务业	65,928,593.07	1.55
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	11,976,356.98	0.28
S	综合	20,535,920.58	0.48
	合计	3,761,745,258.11	88.52

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	600030	中信证券	9,816,088	130,749,226.36	3.08
2	601169	北京银行	13,755,479	110,549,579.37	2.60
3	600511	国药股份	3,961,689	106,707,518.55	2.51
4	601318	中国平安	2,536,889	104,871,916.26	2.47
5	601328	交通银行	19,304,057	82,814,404.53	1.95
6	002385	大北农	5,607,820	77,331,837.80	1.82
7	600875	东方电气	4,514,072	65,454,044.00	1.54
8	600837	华鲁恒升	5,954,649	61,451,977.68	1.45
9	600079	人福医药	2,011,055	55,545,339.10	1.31
10	601038	华鲁恒升	3,574,680	55,479,729.20	1.31

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	140317	14国债17	600,000	60,054,000.00	1.41
2	128002	东华转债	5,497	794,514.39	0.02
3	110024	隧道转债	4,420	580,611.20	0.01
4	128005	齐翔转债	1,553	182,615.72	0.00

3.2 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
3.1 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股票投资明细
3.2 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
3.1 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股票投资明细
3.2 报告期末按