

(上接A31版)

76	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:杭州市余杭区五常街道同顺街19号同花顺大厦4层 法定代表人:凌顺平 联系人:吴峰 电话:(0571)-89119118-0953 传真:(0571)-89800423 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
77	众升财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座906室 办公地址:北京市朝阳区望京浦中心A座904-08 法定代表人:李招弟 联系人:李艳 电话:(010)-49497361 传真:(010)-6478916 客服电话:400-876-9888 网址:www.zcfund.com
78	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人:王莉 联系人:刘洋 电话:(010)-45650628 传真:(010)-65849788 客服电话:400-008-0082 网址:icikehe.hexun.com
79	宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1501室 办公地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1501室 法定代表人:梁颖 联系人:魏巍 电话:(010)-42411305 传真:(010)-85824285 客服电话:400-609-0200 网址:www.yixinfund.com
80	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1013室 办公地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚集团(锦昌大厦)13楼 法人:徐黎云 联系人:朱静芳 电话:(0571)-88337888 传真:(0571)-88337888 客服电话:400-068-0088 网址:www.jincheng-fund.com
81	泛华普益基金销售有限公司	注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 法定代表人:李海峰 联系人:张金金 电话:(028)-84252474-801 客服电话:400-8588588 网址:http://www.puyifund.com
82	嘉实财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人:赵学军 联系人:崔茜 电话:(021)-20288900 传真:(021)-20289110 客服电话:400-021-8850 网址:www.harvestwm.com
83	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号 办公地址:北京市朝阳区望京东园四区28号富卓大厦16层 法定代表人:王勇 联系人:文豪 电话:(010)-82383101 传真:(010)-83360372 客服电话:400-166-1188 网址:http://8lj.cnjcm.com
84	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层122室 办公地址:北京市朝阳区三环北路甲19号OHO嘉盛中心303室3001室 法定代表人:侯斌 联系人:王骁 电话:(010)-43509036 传真:(010)-57765199 客服电话:4008806318 网址:www.hmtmfund.com
85	北京铁鑫基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人:赵东辉 联系人:李超 电话:(010)-46200948 传真:(010)-56766771 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjin.com
86	北京创金启源投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区丰润里315号东215A 办公地址:北京市西城区白广门东坊2号经济日报社综合楼A座712室 法定代表人:梁静 联系人:梁静 电话:(010)-66154828-8006 传真:(010)-63838991 客服电话:400-6262-618 网址:www.ciqin.com
87	海银基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路89号402室 办公地址:上海市浦东新区银城中路89号4楼 法定代表人:刘澍 联系人:李超 电话:(021)-40206991 传真:(021)-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.haibinfund.com
88	上海大智慧财富管理有限公司	注册地址:上海浦东东陆路428号1号楼10-11层 办公地址:上海浦东东陆路428号1号楼10-11层 法定代表人:申健 联系人:邵珊珊 电话:(021)-20219536 传真:(021)-20219923 客服电话:(021)-20219931 网址:http://www.wisdom.com.cn
89	上海聚春资产管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层101室 办公地址:上海市浦东新区张江高科618号813室 法定代表人:陈斌 联系人:陈斌 电话:(021)-52972203 传真:(021)-52975270 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.66ichuan.com
90	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 法定代表人:李学春 联系人:李学春 电话:(010)-67000888-6075 传真:(010)-67000888-6075 客服电话:400-808-1016 网址:www.zcfc.com.cn
91	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人:李兴春 联系人:吴昊 电话:(021)-50683533 传真:(021)-60195218 客服电话:400-921-7755 网址:www.lidfund.com
92	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 办公地址:上海市黄浦区中山南路100号外滩国际广场19楼 法定代表人:金磊 联系人:陈云卉 电话:(020)-93225699 传真:(021)-33232837 客服电话:400-821-3699 网址:http://tianyachina.com
93	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址:厦门市湖里区象江湾2号第一广场1501-1504 办公地址:厦门市湖里区象江湾2号第一广场1501-1504 法定代表人:陈洪生 联系人:陈洪生 电话:(0592)-5122757 传真:(0592)-3122701 客服电话:400-918-0088 网址:www.xds.com.cn
94	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 法定代表人:胡晓炼 联系人:李静 电话:(021)-20666662 传真:(021)-22066663 客服电话:4008219331 网址:www.lufund.com
95	北京虹点基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东四环中路11号16层1601室 办公地址:北京市朝阳区二环路北二环路甲2号盈科中心B座南塔21层 法定代表人:胡倩 联系人:胡倩 电话:(010)-59136965 客服电话:400-068-1176 网址:www.hongdianfund.com
96	北京新晟合石基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区北达智谷中关村软件园二期西附楼1-N-2地块新晟合总部科技研发楼5层 办公地址:北京市西城区北达智谷中关村软件园二期西附楼1-N-2地块新晟合总部科技研发楼5层 法定代表人:李阳强 联系人:李阳强 电话:(010)-60619607 客服电话:(010)-62675389 网址:http://www.xsh.com.cn
97	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室 法定代表人:肖毅 联系人:肖毅 电话:(020)-89626099 传真:(020)-89626011 客服电话:(020)-89626066 网址:www.yingm.com

98	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B.02.03.04单元 办公地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B.02.03.04单元 法定代表人:顾朝晖 联系人:王颖 电话:(0755)-83996907-811 传真:(0755)-83996926 客服电话:(0755)-83996907 网址:www.welinkbank.com
99	北京德商瀚华投资咨询有限公司	注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2层202室 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路40号201室 法定代表人:董瑞 联系人:刘美惠 电话:(010)-53570672/1312182670 传真:(010)-53200800 客服电话:400-819-5888 网址:http://www.shidfund.com/
100	上海东石财富基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址:上海市黄浦区延安路191凯石大厦4楼 法定代表人:陈维斌 联系人:袁静 电话:(021)-63333389-320 传真:(021)-63333390 客服电话:4006-433-389 网址:www.dongshifund.com
101	大泰金石基金销售有限公司	注册地址:南京市栖霞区江东北路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方汇大厦13楼 法定代表人:袁志刚 联系人:袁志刚 电话:(021)-63333389-320 传真:(021)-63333390 客服电话:4006-433-389 网址:www.dttfund.com
102	济安财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座10层 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座10层 法定代表人:杨健 联系人:李海峰 电话:(010)-63205616 传真:(010)-65230699 客服电话:400-673-7010 网址:http://www.jianfund.com
103	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	注册地址:北京市西城区宣武门大街11号1108 办公地址:北京市西城区宣武门大街11号1108 法定代表人:王树刚 联系人:王树刚 电话:(010)-56232140 传真:(010)-62008327 客服电话:4006199059 网址:www.jiangu.com
104	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-4层 办公地址:北京市西城区宣武门大街11号1108 法定代表人:王树刚 联系人:王树刚 电话:(010)-56232140 传真:(010)-62008327 客服电话:4006199059 网址:www.hcfn.com
105	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人:王锋 联系人:王锋 电话:(025)-86996699-872226 传真:(025)-86996699 客服电话:4009005777 网址:www.snjfund.com
106	北京广源达信投资管理有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京东园四区28号C座六层609室 办公地址:北京市朝阳区望京东园四区28号C座六层609室 法定代表人:李剑峰 联系人:李剑峰 电话:(010)-61840688 传真:(010)-61840689 客服电话:4006236060 网址:www.guangyuandaxin.com
107	北京康泰基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区阜成门大街1号院6号楼402室 办公地址:北京市西城区阜成门大街1号院6号楼402室 法定代表人:王健 联系人:王健 电话:(010)-61940688 传真:(010)-61840689 客服电话:4006236060 网址:www.kmtfund.com
108	上海云尚投资管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥22号23号楼2层 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥22号23号楼2层 法定代表人:王健 联系人:王健 电话:(021)-20638888 传真:(021)-20638889 客服电话:400-420-1515 网址:www.zhengtuangoufund.com
109	上海基煜基金销售有限公司	注册地址:上海市崇明县长兴镇路昌荣公路1800号2号楼153室(上海基煜投资管理有限公司) 办公地址:上海市崇明县长兴镇路昌荣公路1800号2号楼153室(上海基煜投资管理有限公司) 法定代表人:王翔 联系人:王翔 电话:(021)-2538521 传真:(021)-56056951 客服电话:400-420-5389 网址:www.jiayufund.com
110	北京肯特财富投资管理有限公司	注册地址:北京市大兴区兴亦经济开发区科十一街18号京东集团A座17层 办公地址:北京市大兴区兴亦经济开发区科十一街18号京东集团A座17层 法定代表人:江平 联系人:江平 电话:(010)-89188366 传真:(010)-89188566 客服电话:400-181-8566 网址:www.kentfund.com
111	上海华夏时源投资管理有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼269室 办公地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼269室 法定代表人:毛卓平 联系人:毛卓平 电话:(021)-48969632 传真:(021)-48969632 客服电话:400-817-5066 网址:www.shhxyfund.com
112	本基金其他代销机构网站详见基金管理人发布的相关公告	

3.1.2 场内销售机构  
场内销售机构是指具有基金代销售业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位,具体名单以交易所网站刊载内容为准。

3.2 登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
办公地址:上海市浦东新区太平桥大街17号  
法定代表人:周明  
联系人:崔巍  
电话:010-50938856  
传真:010-59377897

3.3 出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海市通力律师事务所  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人:俞卫锋  
联系人:黎明  
电话:(86 21) 3135 8666  
传真:(86 21) 3135 8600

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:上海市湖南路202号普华永道中11楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系电话:(021) 22323888  
传真:(021) 23223800

联系人:陈燕  
经办注册会计师:薛岚、陈燕

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金  
股票型证券投资基金

本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的投资回报。

§ 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。为了更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市

的股票)、债券、包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债,可转换债券及其他经中国证监会允许投资的证券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:  
本基金80%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其

备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

§ 8 基金的投资策略

8.1 投资策略  
本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数的

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增发、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,并辅之以金融衍生品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不得超过4%。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。

(一)资产配置策略  
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将主要投资于标的指数的成份股

和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下,本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)股票投资策略  
本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据标的指数成份股

的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

1.股票投资组合的构建  
本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力

求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。特殊情况下,本基金可以根据市场环境,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规

定的风险承受范围之内,尽量缩小跟踪误差。

2.股票投资组合的调整  
(1)定期调整  
本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的

调整而进行相应的跟踪调整。

(2)不定期调整  
当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基

金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的股权比例,进行相应调整;

2) 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪

的指数;

3) 特殊情况下,如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金

管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊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

长期停牌;③标的指数成份股流动性严重不足;④成份股上市公司存在重大违规行为,有可能面临重大的处罚或诉讼。

(三)债券投资策略  
在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分

析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债

券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属

配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进

行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作

方式,获取超额的投资收益。

(四)权证投资策略  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合作定

价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策

略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买

入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配

置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(五)股指期货等投资策略  
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目

的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的

研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通

过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑期货

货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情

况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低

投资组合的整体风险的目的。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

11.投资组合报告附注  
11.1.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。

11.2.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。

11.3.其他资产构成

序号 股票名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 109,448.45

2 应收证券清算款 134,730.05

3 应收股利

4 应收利息 3,403.34

5 应收申购款 3,205,861.69

6 其他应收款

7 预付款项

8 其他

- 合计 3,453,444.13

11.4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明  
注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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。

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2017年9月30日(未经审计)。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	271,338,064.00	93.22
	其中:股票	271,338,064.00	93.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	16,269,095.88	5.59
9	其他资产	3,453,444.13	1.19
-	合计	291,057,604.00	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合  
2.1.报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	170,610,983.68	59.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	96,470,192.46	33.70
F	批发性贸易	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,269,343.00	1.14
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	270,360,517.04	94.46

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

C	制造业	702,402.66	0.26
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,336.45	0.01
G	交通运输、仓储和 邮政业	25,571.91	0.01
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	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐 业	44,000.50	0.02
S	综合	-	-
	合计	984,547.55	0.34