

(上接B081版)

(103) 华福证券有限责任公司
办公地址 福州市五四路167号新天地大厦7-8层
注册地址 福州市鼓楼区福康街五四路167号7-8层
法定代表人 孙金铸 联系人 张勇
电话 (0661) 8728022 传真 (0661) 8728030
http://www.hfwz.com.cn/ 客服电话 (0661) 96326

(104) 中国国际金融股份有限公司
办公地址 北京建国门外大街1号国贸大厦2层2及2层
注册地址 北京朝阳区建国路1号外1号国贸大厦2层2及2层
法定代表人 丁宇浩 联系人 杨宇宁
电话 (010)955651166 传真 (010)959679283
http://www.cicc.com 400 910 1166

(105) 联讯证券股份有限公司
办公地址 广东省深圳市福田区江北一路6号广电新闻中心C1-西首一层的三二二
注册地址 广东省深圳市福田区江北一路6号广电新闻中心C1-西首一层的三二二
法定代表人 彭瑞 联系人 彭捷
电话 0755-82531196 客服电话 19654
http://www.lxsec.com/

(106) 宏信证券有限责任公司
办公地址 成都市人民南路一段18号川信大厦10楼
注册地址 成都市锦江区人民南路一段18号川信大厦10楼
法定代表人 阮玉明 联系人 胡进博
电话 028-86198278 传真 (028-86198382
http://www.hxsc.com 400863666

(107) 东海期货有限责任公司
办公地址 江苏常州新北区横路35、36、27、29号、上海市浦东新区东方路1629号东海证券大厦
注册地址 江苏常州新北区横路35、36、27、29号
法定代表人 陈兆雄 联系人 李天明
电话 021-68797102 传真 (021-68797102
http://www.donghai.com.cn 9631400888888

(108) 长江证券股份有限公司
办公地址 湖北武汉新华路新融中心长江证券大厦
注册地址 湖北武汉市新华路新融中心长江证券大厦
法定代表人 尤习贵 联系人 李锐
电话 (027)162799999 传真 (027)1854019000
http://www.cjsc.com 客服电话 4008-888-999

(109) 西南证券股份有限公司
办公地址 重庆市江北北区新丰道西南证券大厦
注册地址 重庆市江北北区新丰道西南证券大厦
法定代表人 杨晓军 联系人 张煜
电话 (023)227870141 传真 (023)22787212
http://www.swsc.com.cn 客服电话 400893966

(110) 万联证券股份有限公司
办公地址 广州中华二路18号电信广场36、37楼
注册地址 广州天河区珠江东路11号高德置地广场E座16、18楼
法定代表人 张建军 联系人 罗敏
电话 (020)13796570 传真 (020-22273718-1013
http://www.wlsc.com 400888133

(111) 民生证券股份有限公司
办公地址 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A16层-18层
注册地址 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A16层-18层
法定代表人 冯立志 联系人 李阳
电话 01095512776 传真 010955127317
http://www.mscj.com 客服电话 400-619-8888

(112) 国元证券股份有限公司
办公地址 安徽省合肥市春园路179号
注册地址 安徽省合肥市庐江路5号
法定代表人 顾敏 联系人 陈静
电话 1905112224723 传真 (0651)12222108
http://www.gysec.com 客服电话 19678

(113) 渤海证券股份有限公司
办公地址 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
注册地址 天津市滨海新区滨水西道20号
法定代表人 王春峰 联系人 蔡煜
电话 02222461991 传真 02222461852
http://www.bhsc.com 客服电话 4000615688

(114) 山西证券股份有限公司
办公地址 太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
注册地址 太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼21层
法定代表人 侯斌 联系人 胡明
电话 103511888959 传真 103511888619
http://www.sxsc.com 客服电话 400-696-1618

(115) 东吴证券股份有限公司
办公地址 苏州工业园区星阳街5号
注册地址 苏州工业园区星阳街5号
法定代表人 吴永敏 联系人 王芳静
电话 0512959681136 传真 0512959689021
http://www.dwsc.com 客服电话 96330

(116) 信达证券股份有限公司
办公地址 北京市西城区闹市口大街9号院6号楼
注册地址 北京市西城区闹市口大街9号院6号楼
法定代表人 张志刚 联系人 尹旭航
电话 0109532081483 传真 0109532081344
http://www.cindasc.com 客服电话 96321

(117) 南京证券股份有限公司
办公地址 南京市江东中路389号
注册地址 江苏省南京市江东中路389号
法定代表人 步国钧 联系人 邵明
电话 025963619623 传真 025963697256
http://www.njzq.com 客服电话 96386

(118) 上海证券有限责任公司
办公地址 上海市四川路213号上海证券大厦
注册地址 上海市四川路2号华东国际商贸大厦6楼
法定代表人 李俊杰 联系人 邵珍珍
电话 02130888988 传真 02130896100-7008
http://www.shsc.com 客服电话 96330

(119) 新时代证券股份有限公司
办公地址 北京市海淀区北三环西路98号院1号楼15层1501
注册地址 北京市海淀区北三环西路98号院1号楼15层1501
法定代表人 孙建忠 联系人 田丹芳
电话 01082625146 传真 01082625169

(120) 大同证券有限责任公司
办公地址 山西省大同市城区迎宾街11号山西大同证券大厦12、13层
注册地址 大同市城区迎宾街11号山西大同证券大厦12、13层
法定代表人 董祥 联系人 邵捷
电话 (0352)14130322 传真 (0352)14130322
http://dhtsec.com.cn/ 客服电话 4007121212

(121) 国联证券股份有限公司
办公地址 无锡中南路一-附1号
注册地址 江苏省无锡市金融一街89号
法定代表人 姚志勇 联系人 孙奕
电话 0510-82831662 传真 0510-82830162
http://www.glsc.com 客服电话 96570

(122) 浙商证券股份有限公司
办公地址 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
注册地址 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人 吴强 联系人 尹霞行
电话 (0571)18990192 传真 (0571)18900193
http://www.zsc.com.cn/ 客服电话 (0571)1967777

(123) 平安证券股份有限公司
办公地址 深圳市福田区中心区金田路4002号平安大厦16-20层
注册地址 深圳市福田区中心区金田路4002号平安大厦16-20层
法定代表人 何江 联系人 唐一博
电话 021-58872436 传真 021-58901896
http://www.stock.pingan.com 客服电话 96511-8

(124) 东莞证券股份有限公司
办公地址 东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
注册地址 广东省东莞市莞城区可园南路1号
法定代表人 张东勇 联系人 李尧
电话 0769922115712 传真 0769922115712
http://www.dgsc.com 客服电话 96328

(125) 中原证券股份有限公司
办公地址 河南省郑州市高新区商务内环路10号
注册地址 河南省郑州市高新区商务内环路10号
法定代表人 菅爱群 联系人 程月梅、李朝刚
电话 0371-86080822 传真 0371-86684890
http://www.czysec.com 客服电话 96377

(126) 国都证券股份有限公司
办公地址 北京市东城区东直门内大街2号国华投资大厦10层
注册地址 北京市东城区东直门内大街2号国华投资大厦10层
法定代表人 王少华 联系人 李超
电话 010701433389 传真 010701433311
http://www.guodu.com 客服电话 400-818-8118

(127) 东海证券有限责任公司
办公地址 江苏常州新北区横路35号投资广场10楼
注册地址 江苏省常州市延政西路3号投资广场10楼
法定代表人 赵顺 联系人 王一菲
电话 051928333333 传真 021764098288
http://www.donghai.com 客服电话 9631400-888-8888

(128) 中银国际证券有限公司
办公地址 上海浦东新区世纪大道1600号
注册地址 上海浦东新区世纪大道1600号
法定代表人 汪建刚 联系人 李捷
电话 021-38812333 传真 021-38812333

信息披露 Disclosure

(129) 恒泰证券股份有限公司
办公地址 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方广场D座光大银行办公楼14-15层
注册地址 内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方广场D座光大银行办公楼14-15层
法定代表人 熊介昆 联系人 甄翔
电话 194711972675 传真 (0471)97267605
http://www.hhtsec.com 客服电话 4001666188

(130) 国盛证券有限责任公司
办公地址 江西省南昌市北京西路88号
注册地址 江西省南昌市北京西路88号(信用创新金融大厦)
法定代表人 徐国晖 联系人 胡欣序
电话 079186281306 传真 079186281306
http://www.gssec.com/ 客服电话 4008222111

(131) 金元证券股份有限公司
办公地址 湖南省长沙市芙蓉中路3号证券大厦4楼
注册地址 湖南省长沙市芙蓉中路3号证券大厦4楼
法定代表人 王作安 联系人 马国涛
电话 07558302622 传真 07558302625
http://www.jysec.com/ 客服电话 400-8888-228

(132) 德邦证券股份有限公司
办公地址 上海市普陀区曹杨路510号南半球大厦
注册地址 上海市普陀区曹杨路510号南半球大厦
法定代表人 俞萍 联系人 罗芳
电话 021168791616 传真 (021)16879781
http://www.tebon.com.cn/ 客服电话 4008881128

(133) 华龙证券股份有限公司
办公地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州国际中心21楼
注册地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州国际中心21楼
法定代表人 曹洋 联系人 杨瑞刚
电话 0931-4806732 传真 021-48067322
http://www.hlsc.com.cn 客服电话 021-32199999-029-69018888-4001099118

(134) 华鑫证券有限责任公司
办公地址 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(15)单元
注册地址 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(15)单元
法定代表人 俞萍 联系人 杨瑞刚
电话 0931-4806732 传真 021-48067322
http://www.hlsc.com.cn 客服电话 021-32199999-029-69018888-4001099118

(135) 瑞银证券有限责任公司
办公地址 北京市西城区金融大街7号新益国际金融中心12层、15层
注册地址 北京市西城区金融大街7号新益国际金融中心12层、15层
法定代表人 钱宇 联系人 陈静
电话 01015622112 传真 010166828748
http://www.wisdomsec.com/ 客服电话 400-887-8827

(136) 中山证券有限责任公司
办公地址 广东省深圳市福田区益田路17号大厦18层11室
注册地址 深圳市福田区益田路17号大厦18层11室
法定代表人 郭东 联系人 罗敏
电话 0755-82767663 传真 0755-82969562
http://www.zsc.com 客服电话 85320

(137) 江海证券有限公司
办公地址 哈尔滨市香坊区泰山路5号
注册地址 哈尔滨市香坊区泰山路5号
法定代表人 赵鼎 联系人 鞠童
电话 0451-4603728 传真 0451-82237279
http://www.jhsc.com.cn/ 客服电话 400-666-2288

(138) 国金证券股份有限公司
办公地址 四川省成都市青羊区东城根上街95号
注册地址 四川省成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人 冉云 联系人 刘婧
电话 028-39690007、028-39690008 传真 028-95900126
http://www.gjsci.com.cn 客服电话 96310

(139) 中国民族证券有限责任公司
办公地址 北京市朝阳区北四环中路2号互联网金融大厦A座16-18层
注册地址 北京市朝阳区北四环中路2号互联网金融大厦4-3层
法定代表人 姜志军 联系人 齐冬妮
电话 010949368877 传真 010949347013
http://www.mzsc.com 客服电话 400-889-5618

(140) 华宝证券有限责任公司
办公地址 上海市浦东新区世纪大道100号华宝金融中心527层
注册地址 上海市浦东新区世纪大道100号华宝金融中心
法定代表人 魏林 联系人 夏元
电话 (021)16877222 传真 (021)16877622
http://www.hbasc.com.cn 客服电话 4008203966

(141) 长城国瑞证券有限公司
办公地址 厦门湖里区殿前二路33号嘉禾大厦十七楼
注册地址 厦门湖里区殿前二路33号嘉禾大厦20楼
法定代表人 江涛 联系人 林月
电话 05922279259 传真 05922279902
https://www.gwsc.com/ 客服电话 400-1099-886

(142) 爱建证券有限责任公司
办公地址 上海浦东新区世纪大道1600号32楼
注册地址 上海浦东新区世纪大道1600号32楼(陆家嘴商务广场)
法定代表人 李 联系人 夏元
电话 021-16877222 传真 (021)16877622
http://www.aijsec.com 客服电话 4008203966

(143) 华融证券股份有限公司
办公地址 北京市西城区金融大街9号
注册地址 北京市西城区金融大街9号
法定代表人 宋超 联系人 熊焱
电话 01013222888 传真 021-68728762
http://www.hfsc.com/ 客服电话 1(021)163340678

(144) 天风证券股份有限公司
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
注册地址 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 李姝
电话 027-87671017 传真 027-87671883
http://www.tfsc.com 客服电话 4008060000

(145) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
办公地址 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋1011006
注册地址 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋1011006
法定代表人 于百 联系人 宋雯
电话 010-82831011 传真 010-83388772
http://www.xinlande.com.cn 客服电话 400-119-1196

(146) 上海挖财基金销售有限公司
办公地址 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
注册地址 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人 冷飞 联系人 靳树
电话 021-50819887 传真 021-50819829
http://www.wacaij.com 客服电话 021-50810673

(147) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
办公地址 浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1202室
注册地址 浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1202室
法定代表人 陈柏青 联系人 陈静
电话 021-60897940 传真 0971-26697013
http://www.hund123.com 客服电话 4000-709-123

(148) 北京汇京基金销售有限公司
办公地址 北京海淀区中关村大街11号11层1108室
注册地址 北京海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人 王磊 联系人 王静
电话 010-56212140 传真 010-56203227
http://www.hjzsc.com/ 客服电话 400-910-9169

(149) 北京新金石基金销售有限公司
办公地址 北京市朝阳区北四环西路86号理想国际大厦900室
注册地址 北京市朝阳区北四环西路86号理想国际大厦900室
法定代表人 王文文 联系人 李强
电话 010-62767406 传真 010-62767369
http://www.xinshi.com/ 客服电话 010-62767369

(150) 上海万得基金销售有限公司
办公地址 中国(上海)自由贸易试验区浦电路33号
注册地址 中国(上海)自由贸易试验区浦电路33号
法定代表人 李 联系人 姜吉灵
电话 021-68922280 传真 021-68922203
http://www.wand.com.cn 客服电话 400-821-0203

(151) 凤凰金(银川)基金销售有限公司
办公地址 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
注册地址 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
法定代表人 郭朝晖 联系人 郭朝晖
电话 010-58190168 传真 010-58190173
http://www.fenghuang.com 客服电话 400-810-5619

(152) 鼎和传媒基金销售有限公司
办公地址 郑州市郑东新区东经一路与康宁街交汇处201室
注册地址 郑州市郑东新区东经一路与康宁街交汇处201室
法定代表人 孙小 联系人 孙小
电话 0371-86418396 4000-656-477 传真 0371-86518397

(153) 北京中汇基金销售有限公司
办公地址 北京市海淀区中关村东路86号11号楼22层2202C-06
注册地址 北京市海淀区中关村东路86号11号楼22层2202C-06
法定代表人 江涛 联系人 江涛
电话 4008885111 传真 010-81918800
http://www.hzsc.com 客服电话 010-81918842

(156) 北京康金销售服务有限公司
办公地址 北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元2102Z2607
注册地址 北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元2102Z2607
法定代表人 韩志军 联系人 曹真
电话 010-41840888 传真 010-41840699
http://www.kwj.com 客服电话 4000-618-518

(1) 四川天府银行股份有限公司
办公地址 四川省南充市顺庆区阕家坝一路二段79号
注册地址 四川省南充市顺庆区阕家坝一路二段79号
法定代表人 黄光伟 联系人 姚海霞
电话 0917-8930023 传真 0917-8930033
http://www.tfsc.com

(2) 深圳众禄基金销售有限公司
办公地址 深圳市福田区莲花路3333号众禄大厦1003
注册地址 深圳市福田区莲花路3333号众禄大厦1003
法定代表人 薛锋 联系人 董影华
电话 0755-33227969 传真 0755-33227961
http://www.zlfund.com, http://www.zlfund.cn 客服电话 4006-788-887

(3) 上海天天基金销售有限公司
办公地址 上海市徐汇区宛平南路88号
注册地址 上海市徐汇区宛平南路88号
法定代表人 其实 联系人 潘思远
电话 021-54509977 传真 021-64380300
http://www.1234567.com 客服电话 96021

(4) 上海好买基金销售有限公司
办公地址 上海市虹口区欧阳路196号20号楼2层
注册地址 上海市虹口区欧阳路196号20号楼2层
法定代表人 杨文斌 联系人 张蕊
电话 021-20613999 传真 021-68609316
http://www.hoamifund.com 客服电话 4007006665

(5) 浙江阿方达基金销售有限公司
办公地址 浙江省杭州市西湖区古墩路
注册地址 浙江省杭州市西湖区古墩路
法定代表人 李慧琦 联系人 林珊珊
电话 0571-89909423 传真 0571-89909423
http://www.afund.com 客服电话 4008-773-772

(6) 聚财财富管理有限公司
办公地址 上海市浦东新区世纪大道100号1006-1010室
注册地址 上海市浦东新区世纪大道100号1006-1010室
法定代表人 李 联系人 李
电话 021-32228888 传真 021-32228888
http://www.jcwm.com 客服电话 400-021-8880

(7) 珠海盈米财富管理有限公司
办公地址 珠海横琴新区宝华路6号1605室-3491
注册地址 珠海横琴新区宝华路6号1605室-3491
法定代表人 肖 联系人 孙慧琦
电话 020-30629019 传真 020-30629011
http://www.yingmi.com 客服电话 020-88626066

(8) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
办公地址 杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1202室
注册地址 浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1202室
法定代表人 陈柏青 联系人 陈静
电话 021-60897940 传真 0971-26697013
http://www.hund123.com 客服电话 4000-709-123

(9) 上海万得基金销售有限公司
办公地址 中国(上海)自由贸易试验区浦电路33号11楼
注册地址 中国(上海)自由贸易试验区浦电路33号11楼
法定代表人 李 联系人 姜吉灵
电话 021-68922280 传真 021-68922203
http://www.wand.com.cn 客服电话 400-821-0203

(10) 凤凰金(银川)基金销售有限公司
办公地址 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
注册地址 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
法定代表人 郭朝晖 联系人 郭朝晖
电话 010-58190168 传真 010-58190173
http://www.fenghuang.com 客服电话 400-810-5619

(11) 北京肯特瑞基金销售有限公司
办公地址 北京市海淀区中关村软件园11号楼22层2202C-06
注册地址 北京市海淀区中关村软件园11号楼22层2202C-06
法定代表人 江涛 联系人 江涛
电话 4008885111 传真 010-81918800
http://huanjia.com 客服电话 010-81918842

(12) 北京康金销售服务有限公司
办公地址 北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元2102Z2607
注册地址 北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元2102Z2607
法定代表人 韩志军 联系人 曹真
电话 010-41840888 传真 010-41840699
http://www.kwj.com 客服电话 4000-618-518

(二) 基金注册登记机构
嘉实基金管理有限公司(同上)
(三) 律师事务所和经办律师
名称 上海锦天城律师事务所
住所 办公地址 上海浦东新区银城中路501号金汇大厦21楼
负责人 韩炯 联系人 廖明
电话 02131258888 传真 02131258800

(四) 会计师事务所及注册会计师
名称 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所 办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号锦泰大厦25楼
负责人 魏 联系人 李
电话 02122328888 传真 02122328800

四、基金的投资
基金名称:嘉实中创400交易开放式指数证券投资基金联接基金
五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式
六、基金的投资目标
紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,在正常市场条件下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。

七、基金的投资范围
本基金以目标ETF基金份额,标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

八、基金的投资策略
(一) 投资策略
本基金为跟踪ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场条件下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人应当综合考虑采用其他合理投资措施,将跟踪偏离度控制在上述范围之内。本基金在综合考虑合格境内机构投资者基金合同约定、流动性管理等因素的基础上,决定采用一级市场申购的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的投资。

此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小、创业板及其他中国证监会核准发行的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债、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、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)。
九、基金的投资限制
(一) 投资组合
本基金投资于目标ETF基金份额,本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

十、基金的投资限制
(一) 投资组合
本基金投资于目标ETF基金份额,本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

十一、基金的投资限制
(一) 投资组合
本基金投资于目标ETF基金份额,本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

十二、基金的投资限制
(一) 投资组合
本基金投资于目标ETF基金份额,本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

十三、基金的投资限制
(一) 投资组合
本基金投资于目标ETF基金份额,本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中不包含债券回购;本基金可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股;本基金还可投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股。

1. 投资组合的建立
在基金建仓期,为避免有可能在二级市场造成的价格冲击,基金经理将主要采取一级市场申购的方式建立联接基金的初期投资组合。
2. 投资组合的日常管理
(1) 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。
(2) 基金经理每日根据本基金申购赎回情况及已有现金管理,在综合考虑申购、赎回、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
3. 正常行情下,联接基金的投资组合主要体现为持有目标ETF基金份额,对于目标ETF暂停申购、停牌或其他原因导致其投资组合中出现的现金,基金经理将根据市场情况按照本基金的资产配置目标进行其他投资品种调整。

九、基金的业绩比较基准
中创400指数收益率*95%+银行活期存款税后利率*5%。
十、基金的风险收益特征
本基金为中创400ETF的联接基金,主要通过投资于中创400ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的表现将与中创400指数及中创400ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
十一、基金的投资范围及投资对象
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责原则,秉承保护基金份额持有人利益优先原则,根据相关法律法规,结合基金合同约定,在基金合同约定的范围内,为基金份额持有人谋求最佳利益,并履行相应义务。
十二、基金管理人承诺
(一) 基金管理人承诺
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责原则,秉承保护基金份额持有人利益优先原则,根据相关法律法规,结合基金合同约定,在基金合同约定的范围内,为基金份额持有人谋求最佳利益,并履行相应义务。

2 报告期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
表
序号 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 计算机设备 3,486,104.50 3.13
其中:思源 3,486,104.50 3.13
2 基金投资 101,383,779.76 91.16
3 固定收益投资 - -
其中:国债 - -
公司债券 - -
中期票据 - -
资产支持证券 - -
4 其他资产 - -
5 买入返售金融资产 - -
其中:买入返售金融资产 - -
6 其他负债 - -
7 银行存款和结算备付金合计 5,836,950.62 5.25
8 其他负债 - -
9 合计 111,226,264.13 100.00

2 报告期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
表
序号 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业 39,420.40 0.04
B 采矿业 26,400.00 0.02
C 制造业 2,240,460.00 2.02
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 15,450.00 0.01
E 建筑业 63,694.80 0.06
F 交通运输、仓储和邮政业 122,620.00 0.11
G 批发和零售业 20,233.00 0.02
H 住宿和餐饮业 0.00 0.00
I 金融业 89,361.50 0.08
J 文化、体育和娱乐业 72,082.20 0.07
K 房地产业 10,136.00 0.01
L 租赁和商务服务业 60,566.00 0.06
M 科学研究和技术服务业 32,372.00 0.03
N 水利、环境和公共设施管理业 37,360.00 0.03
O 房地产业 0.00 0.00
P 教育 0.00 0.00
R 文化、体育和娱乐业 72,082.20 0.07
合计 3,486,104.50 3.13

3 报告期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
表
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 300035 德方纳米 1,460 46,820.00 0.04
2 300142 沃顿生物 2,200 43,960.00 0.04
3 00075 华信船舶 2,000 41,912.00 0.04
4 430026 兴图环通 2,500 41,676.00 0.04
5 300122 翔丰盛 800 36,920.00 0.03
6 300347 泰格医药 500 30,928.00 0.03
7 000140 产康达 1,100 29,563.00 0.03
8 002211 赛米能源 1,200 28,220.00 0.02
9 300252 汇通新材 2,000 24,780.00 0.02
10 002853 爱迪药业 200 22,760.00 0.02

4 报告期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
报告期,本基金未持有债券。
5 报告期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
报告期,本基金未持有债券。
6 报告期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
报告期,本基金未持有资产支持证券。
7 报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细