

(上接B248版)		
71	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号南昌国际金融中心A座41层 办公地址:北京市朝阳区望京东园三区2号中航资本大厦36层 法定代表人:王翔博 客服电话:06528 网址:www.avicsec.com.cn 注册地址:江苏省常州市延陵西路23号广电广场10层 办公地址:江苏省浦东新区东兴路1102号东海证券大厦 法定代表人:赵俊 客服电话:06631 网址:www.jongtong.com.cn 注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4.5号楼3701-3717 办公地址:北京市朝阳区东四环北路27号盘古大观A座40楼 法定代表人:董晖 客服电话:06671 网址:www.jiandao.com.cn 注册地址:太原市府西街69号山西国际金融中心东塔楼 法定代表人:侯晓 联系人:郭勇 电话:0361-8886659 传真:0351-8886619 客服电话:400-666-1618、06673 网址:www.j618.com.cn 注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号湘海商务中心A栋11楼 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号湘海商务中心A栋11楼 法定代表人:刘永华 客服电话:06361 网址:www.xscc.com.cn 注册地址:北京市西城区金融大街9号 办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号 法定代表人:杨毅忠 客服电话:06380 网址:www.bmac.com.cn 注册地址:深圳市南山区海德三道100号招商证券大厦11楼 法定代表人:刘国祥 联系人:刘国祥 电话:0871-3677942 传真:0871-3578527 客服电话:0871-3677930 网址:www.hongtong.com.cn 注册地址:深圳市宝安区西乡街道福林南路100号 法定代表人:孔凡彪 联系人:唐春杉 电话:010-69413306 传真:010-69412637 客服电话:010-88008630 网址:www.xczq.com.cn 注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号 法定代表人:赵洪波 联系人:姜宏伟 电话:0451-47765732 传真:0451-82337279 客服电话:400-666-2288 网址:www.jiuzq.com.cn 注册地址:广州市天河区珠江新城9号广州国际金融中心主楼19楼、20楼 法定代表人:刘东 联系人:林洁茹 电话:020-68839656 传真:020-68839654 客服电话:020-961201 网址:www.guosen.com.cn 注册地址:浙江省杭州市江干区庆元路201号 法定代表人:吴承根 联系人:高海 电话:0571-87902974 传真:0571-87901313 客服电话:06346 网址:www.ztc.com.cn 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦5层 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦5层 法定代表人:李峻 客服电话:4006268888 网址:www.chinaciti.com.cn 注册地址:北京市西城区德胜门内大街399号招商证券大厦1001 办公地址:北京市海淀区世纪城3号招商证券大厦1001 法定代表人:叶卫刚 客服电话:06389 网址:www.xszzq.com.cn 注册地址:重庆市江北区江北桥8号 法定代表人:廖庆轩 联系人:周青 电话:023-67616310 传真:023-63798312 网址:www.xscc.com.cn 注册地址:北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址:北京市西城区阜成门内大街6号中国银河证券大厦10层 客服电话:4008188118 网址:www.guosen.com.cn 注册地址:西安市锦业路1号都市之门100805层 法定代表人:李刚 联系人:王斌 电话:029-68632310 客服电话:400-880-8866 网址:www.kysec.com.cn 注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 法定代表人:章宏韬 客服电话:06318 网址:www.haazq.com.cn 注册地址:深圳市福田区益田路4018号安联大厦28层A1、B011、B1单元 办公地址:上海市静安区江苏路9号 法定代表人:俞萍 客服电话:06223 网址:www.citic.com.cn 注册地址:四川省成都市东城根路186号 办公地址:四川省成都市东城根路186号 法定代表人:黄勇 联系人:黄勇 电话:028-96960058 传真:028-96960126 客服电话:4006600109 网址:www.gjzq.com.cn 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13层1301-1306室、14层 办公地址: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13层1301-1306室、14层 法定代表人:张磊 客服电话:400-990-8826 网址:www.citic.com.cn 注册地址:新疆乌鲁木齐齐平高新区(新市区)北京南路368号大成国际大厦20楼2009室 法定代表人:李海 联系人:王环春 电话:0991-2307105 传真:0991-2301927 客服电话:4008005062 网址:www.zjysec.com.cn 注册地址:四川省成都市锦江区天府一街198号华西证券大厦 办公地址:四川省成都市锦江区天府一街198号华西证券大厦 法定代表人:杨怀祥 客服电话:06584 网址:www.hx168.com.cn 注册地址:广东省深圳市福田区中心区中心广场中港中心大厦第五层(01A、02-04、17A、18A、24A、26A) 法定代表人:吴恩德 客服电话:0755-42426020 网址:www.hzq.com.cn 注册地址:山东省青岛市市南区江西路100号 办公地址:北京市朝阳区安立路30号弘道大厦C-12号楼 法定代表人:魏兆辉 客服电话:06306 网址:www.jiasec.com.cn

(2) 第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息
1	诺正行基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区北虹路300号50724室 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c座 法定代表人:汪静波 联系人:李莉 电话:021-38927277 传真:021-38939777 客服电话:400-021-5399 网址:www.znzh-fund.com
2	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1967号26号楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号东方财富大厦900-900室 法定代表人:杨文斌 联系人:傅华 电话:021-20613999 传真:021-68609616 客服电话:400-700-9655 网址:www.shsbuy.com
3	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层09室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人:祖国明 联系人:韩楠 客服电话:4000-788-123 网址:www.hund123.cn 注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗社区笋岗路8801 办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗社区笋岗路8801 法定代表人:薛峰 联系人:董彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-82808798 客服电话:4006-788-887 网址:www.zfund.cn及www.jimuw.com
4	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号220室 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11楼 法定代表人:张欣波 联系人:邵瑞芳 电话:021-20691039 传真:021-20691961 客服电话:400-820-2899 网址:www.zsfund.com
5	上海长量基金销售有限公司	注册地址:北京市顺义区东沙峪街道顺泰路8号 法定代表人:何振杰 联系人:李骏芳 电话:010-59601366 传真:010-62010355 客服电话:4008128000 网址:www.shyfund.com
6	北京展恒基金销售有限公司	注册地址:杭州市文二西路1号903室 办公地址:杭州市余杭区五常街道御银100号阿波罗大厦 法定代表人:陈敏平 联系人:董一峰 电话:0571-88911818 传真:0571-88800423 客服电话:4008-773-772 网址:www.zsfund.com
7	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1967号1033室 办公地址:上海市虹口区东大名路1088号国际金融中心广场18层 法定代表人:李秀春 联系人:李勇彪 电话:021-50583533 传真:021-50583533 客服电话:95733 网址:www.jiashifund.com
8	江苏金百临投资咨询股份有限公司	注册地址:北京市海淀区太阳宫路8号楼521室 办公地址:北京市海淀区太阳宫路8号楼521室 法定代表人:齐建峰 联系人:阮志凌 电话:010-52605620 传真:010-52686110 客服电话:400-158-5050 网址:www.95fund.com
9	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 法定代表人:其实 联系人:宋柱 电话:021-54509977 传真:021-64383798 客服电话:4001818188 网址:www.1234567.com.cn
10	公募基金(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区望京乡望京村中里504-09 法定代表人:魏晓娟 联系人:李旭 电话:010-59497361 传真:010-64788016 客服电话:400-576-9688 网址:www.zsfund.com
11	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路475号1033室 办公地址:上海市虹口区东大名路1088号国际金融中心广场18层 法定代表人:李秀春 联系人:李勇彪 电话:021-50583533 传真:021-50583533 客服电话:95733 网址:www.jiashifund.com
12	南京汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区太阳宫路8号楼521室 办公地址:北京市海淀区太阳宫路8号楼521室 法定代表人:齐建峰 联系人:阮志凌 电话:010-52605620 传真:010-52686110 客服电话:400-158-5050 网址:www.95fund.com

13	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址:杭州市拱墅区仓前云谷4号(银昌大厦)1幢10楼1001室 办公地址:杭州市拱墅区仓前云谷4号银昌大厦1幢10楼1001室 法定代表人:徐黎云 联系人:冯成昌 电话:0571-88337888 传真:0571-56899710 客服电话:400-088-0058 网址:www.jinsheng-fund.com
14	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号上海国金中心办公楼二第3层5312-15单元 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层(100022) 法定代表人:赵学军 联系人:李雯 电话:010-60842206 客服电话:400-01-0850 网址:www.harvestwm.cn 注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 法定代表人:赵兵 联系人:魏晨 电话:010-52826244 传真:010-59641496 客服电话:400-6999-200 网址:www.yicai.com.cn
15	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208 办公地址:北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦10层 法定代表人:吴晋秀 联系人:董雷 电话:400-001-1566 联系电话:010-88312877 网址:www.yihuxin.com.cn
16	一联财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号12层1208号 办公地址:北京市西城区南礼士路66号12层1208号 客服电话:400-001-1566 联系电话:010-88312877 网址:www.yihuxin.com.cn
17	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12层1208号 办公地址:北京市西城区南礼士路66号12层1208号 客服电话:400-001-1566 联系电话:010-88312877 网址:www.yihuxin.com.cn
18	上海联泰基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市市长宁区福泉北路518号8层310室 法定代表人:尹彬彬 联系人:董雷 电话:021-52822063 传真:021-52957270 客服电话:400-166-6788 网址:www.lntai.com.cn
19	汇付基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201室A区066号 办公地址:上海市徐汇区汇山路700号普天软件园C座 法定代表人:金浩 联系人:甄宝林 客服电话:021-34013999 手机客户端:天天基金宝 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 法定代表人:王之光 联系人:李博宇 电话:021-20965952 传真:021-22069653 客服电话:4008219031 网址:www.huifu.com.cn
20	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾龙润广场 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾龙润广场 法定代表人:李善吉 联系人:李博宇 电话:0411-8891212 传真:0411-84396536 客服电话:4000411001 网址:www.lufund.com.cn
21	泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾龙润广场 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾龙润广场 法定代表人:李善吉 联系人:李博宇 电话:0411-8891212 传真:0411-84396536 客服电话:4000411001 网址:www.taicheng.com.cn
22	北京铁盾基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区广安门内大街118号1008-1012 办公地址:北京市西城区广安门内大街118号1008-1012 法定代表人:赵永春 联系人:李博宇 电话:010-67418829 传真:010-57659871 客服电话:400-880-6886 网址:www.tiedun.com.cn
23	北京红点基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙楼二层 办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙楼二层 法定代表人:王耀辉 联系人:李博宇 电话:010-67418829 传真:010-57659871 客服电话:400-880-6886 网址:www.hongdianfund.com
24	北京微动利基金销售有限公司	注册地址:北京市石景山区古城西路113号财富广场3层342室 办公地址:北京市石景山区古城西路113号财富广场3层342室 法定代表人:李长军 联系人:李博宇 电话:010-67418829 传真:010-57659871 客服电话:400-880-6886 网址:www.windongli.com.cn
25	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区福田街道福安社区金田路4008号中洲大厦2002A单元 办公地址:深圳市福田区福田街道福安社区金田路4008号中洲大厦2002A单元 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:0755-83989007 传真:0755-83989007 客服电话:400-021-5399 网址:www.xinlan.com.cn
26	珠海盈米基金销售有限公司	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楼12楼1201-1203单元 法定代表人:肖冰 联系人:李博宇 电话:020-68620099 传真:020-68620011 客服电话:020-68620066 网址:www.yingmi.com.cn
27	深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区东大街19号中关村软件园二期(二期扩)1N-1-2地块新浪总部科研楼5层18室 办公地址:北京市东城区东大街19号中关村软件园二期(二期扩)1N-1-2地块新浪总部科研楼5层18室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
28	上海万得基金销售有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11幢1101 办公地址:上海市浦东新区福山路33号11幢1101 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:021-60712762 传真:021-50770161 客服电话:400-799-1898 网址:www.wand.com.cn
29	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(苏宁总部) 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号(苏宁总部) 法定代表人:王峰 联系人:李海 电话:025-66909699-882706 传真:025-66909800-882706 客服电话:96177 网址:www.sujin.com.cn
30	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区中关村大街11号111108 办公地址:北京市西城区中关村大街11号111108 法定代表人:王峰 联系人:李海 电话:010-56251471 传真:010-62808227 客服电话:400-819-9599 网址:www.hcjj.com.cn
31	上海万得基金销售有限公司	注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号浙商商贸大厦B座2-2413室 办公地址:天津市滨海新区塘沽泰达大街11号111108 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:021-60712762 传真:021-50770161 客服电话:400-799-1898 网址:www.wand.com.cn
32	北京创金基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 办公地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
33	万家财富基金销售有限公司(天津)有限公司	注册地址:天津市滨海新区塘沽泰达大街11号111108 办公地址:天津市滨海新区塘沽泰达大街11号111108 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:021-60712762 传真:021-50770161 客服电话:400-799-1898 网址:www.wand.com.cn
34	北京创金基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 办公地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
35	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号浙商商贸大厦B座2-2413室 办公地址:天津市滨海新区塘沽泰达大街11号111108 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:021-60712762 传真:021-50770161 客服电话:400-799-1898 网址:www.wand.com.cn
36	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区白广门大街19号1幢4层1101室 办公地址:北京市西城区白广门大街19号1幢4层1101室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
37	北京微众基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东大街19号中关村软件园二期(二期扩)1N-1-2地块新浪总部科研楼5层18室 办公地址:北京市东城区东大街19号中关村软件园二期(二期扩)1N-1-2地块新浪总部科研楼5层18室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
38	北京恒安基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 办公地址:北京市东城区东三环北路19号701F09室 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-62676406 传真:010-62676151 客服电话:010-62676389 网址:www.xinlan.com.cn
39	上海华理财富投资管理有限公司	注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座10层 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-88066332 传真:010-63136184 客服电话:400-817-5666 网址:www.amcfortune.com

40	通华财富(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区四川北路1077号201室 办公地址:上海市浦东新区金环路56号通华科技大厦7层 法定代表人:沈丹义 联系人:王浩 电话:021-60818666 客服电话:4001019301 网址:www.tonghuafund.com
41	北京联信基金销售有限公司	注册地址:北京市密云县兴昌南路8号2号楼106室-67 办公地址:北京市密云县兴昌南路8号2号楼106室-67 法定代表人:李龙 联系人:李博宇 电话:010-56075718 传真:010-67767615 客服电话:4006-902-123 网址:www.lxjz.com.cn
42	和群传承基金销售有限公司	注册地址:河南省自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼503 办公地址:河南省自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼503 法定代表人:王群 联系人:李博宇 电话:0371-86518355 传真:0371-86518387 客服电话:4000-555-671 网址:www.hqcfund.com
43	腾安基金销售有限公司(深圳)有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市南山区科技园一路腾讯大厦 法定代表人:刘明军 联系人:李博宇 电话:15112688889 客服电话:400617 网址:www.tenganxin.com.cn
44	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球新闻中心A座5层 法定代表人:钱昊雯 联系人:李博宇 电话:010-59386644 传真:010-59386644 客服电话:4008090998 网址:www.zjzq.com.cn
45	北京百盈基金销售有限公司	注册地址:北京市丰台区上地十街10号11楼1011 办公地址:北京市丰台区上地十街10号11楼1011 法定代表人:李海 联系人:李博宇 电话:010-61961007 传真:010-61962703 客服电话:010-59922163 网址:www.baiyingfund.com

(二) 注册登记机构

名称: 国泰基金管理有限公司
 住所: 中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室
 办公地址: 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层
 法定代表人: 陈勇胜
 联系人: 辛怡
 传真: 021-31081800
 客户服务专线: 400-888-8688, 021-31089000
 (三) 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
 住所: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
 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
 联系电话: 021-31358666
 传真: 021-31358600
 经办律师: 黎明、丁媛
 联系人: 丁媛
 (四) 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: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银大厦507单元
 办公地址: 上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
 执行事务合伙人: 李丹
 联系电话: 021-23238888
 传真: 021-23238800
 联系人: 魏佳亮
 经办注册会计师: 许康伟、魏佳亮

四、基金的名称

国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金类型和存续期限

1、基金类型: 联接基金

2、基金运作方式: 契约型、开放式

3、基金的存续期间: 不定期

六、投资目标

通过投资目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、投资范围

本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中投资于目标ETF资产的比例不低于基金资产净值的90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等)。

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

八、投资策略

本基金为目标ETF的联接基金,以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。

1、资产配置策略

为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF,其余资产可投资于非标的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过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。

2、目标ETF投资策略

(1) 投资组合的构建

基金合同生效后,在建仓期内本基金将按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,在目标ETF开放申购赎回后将股票组合换购成目标ETF份额,使本基金投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

(2) 投资组合的投资方式

1) 申购和赎回: 目标ETF开放申购赎回后,在股票组合进行申购赎回。

2) 二级市场方式: 目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

本基金在二级市场买卖目标ETF基金份额属于追求基金充分投资、降低跟踪误差的目的,在目标ETF暂停申购赎回,本基金投资目标ETF受到最小申购赎回单位限制的情况下,本基金可在二级市场买卖目标ETF。本基金在二级市场的ETF份额投资将不以套利为目的。

本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额,也可以在二级市场买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况,综合考虑流动性、成本、效率等因素,决定目标ETF的投资方式。通常情况下,本基金以申购和赎回为主;当收到净申购时,本基金构建股票组合、申购目标ETF;当收到净赎回时,本基金赎回目标ETF,卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股,本基金将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。

3、成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,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投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在特殊情况下(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

4、债券投资策略

债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例。并灵活运用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以构建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合,在一定的风险度下能提供最大的预期收益,或者在确定收益率上承担最小的风险。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融股指期货收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的变更更大等等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的,或证券市场有其他更具代表性更强、更适合作投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、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,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告

本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,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。

基金托管人中国银行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止2019年3月31日。本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	66,546.36	0.00
1	其中:股票	66,546.36	0.00
2	基金投资	1,547,789,790.70	94.10
3	固定收益投资	20,000.00	0.00
3	其中:债券	20,000.00	0.00
3	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	-	-
7	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	95,866,121.50	5.83
8	其他各项资产	1,168,255.06	0.07
9	合计	1,644,309,744.51	100.00