

## B99 信息披露 | Disclosure

## (上海B09/版)

法人代表: 沈健宇  
联系人: 曹力雄  
客服电话: 0573-83 浙江省·4008965336 全国一  
公司网站: www.ctsec.com  
(77) 上海华信证券有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区世博大道100号环球金融中心4楼  
办公地址: 上海市浦东新区世博大道100号环球金融中心4楼  
法人代表: 陈国辉  
联系人: 倪丹  
客服电话: 68777778  
公司网站: www.hx178.com  
(78) 华鑫证券有限责任公司  
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦29层A01、B01(0)单元  
办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦29层A01、B01(0)单元  
联系人: 俞斌  
联系人: 杨莉娟  
客服电话: 95323  
公司网站: http://www.cfsc.com.cn/  
(79) 国信证券股份有限公司  
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: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
法人代表: 程江喜  
联系人: 张帆  
客服电话: 4008878827  
公司网站: www.huaxinc.com  
(80) 申银万国证券股份有限公司  
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栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11  
办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
法人代表: 高涛  
联系人: 张琳  
客服电话: 95532, 400-600-8008  
公司网站: www.ciccm.com  
(81) 东方证券有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道160号  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道160号  
法人代表: 陈宏  
联系人: 胡博  
客服电话: 95507  
公司网站: www.dfzq.com.cn  
(82) 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66号  
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市南岗区红旗街308号33楼  
法人代表: 赵斌波  
联系人: 姜志伟  
客服电话: 956077  
公司网站: www.jhzq.com.cn  
(83) 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  
联系人: 杨斌  
客服电话: 4008-006-000  
公司网站: www.tfzq.com  
(84) 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  
办公地址: 大连市沙河口区会展路129号  
法人代表: 张智华  
联系人: 鞠立  
客服电话: 400-169-169  
公司网站: www.datong.com.cn  
(85) 太平洋证券股份有限公司  
注册地址: 云南省昆明市高新区389号志远大厦18层  
办公地址: 北京市朝阳区北三环北路99号华信国际D座30单元  
法人代表: 李宏伟  
联系人: 王璇  
客服电话: 95377  
公司网站: www.tpyzq.com  
(87) 开源证券股份有限公司  
注册地址: 西安市高新区锦业路1号都市之门2幢505室  
办公地址: 西安市高新区锦业路1号都市之门2幢505室  
联系人: 李刚  
联系人: 邵丹  
客服电话: 95325  
公司网站: www.kysec.com.cn  
(88) 联讯证券股份有限公司  
注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧国际中心大厦9楼  
办公地址: 北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财国际中心C27层联讯证券  
法人代表: 吕卫工  
联系人: 丁皓  
客服电话: 400-620-6868  
公司网站: www.lxjzq.com  
(89) 中信期货有限公司  
注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层  
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层  
法人代表: 张皓  
联系人: 韩志  
客服电话: 400-000-8926  
公司网站: www.citicf.com  
(90) 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: 北京市西城区新街口外大街28号中电大厦  
法人代表: 林文相  
联系人: 尹玲  
客服电话: 010-66045678  
公司网站: www.txsec.com  
(91) 江苏金百裕投资咨询有限公司  
注册地址: 无锡市太湖新城锦溪街道康乐9号楼  
办公地址: 无锡市太湖新城锦溪街道康乐9号楼  
联系人: 魏晓燕  
联系人: 袁丽萍  
客服电话: 0510-9688988  
公司网站: www.jbzy.com  
(92) 深圳市第三赢泰投资咨询有限公司  
注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006F  
办公地址: 深圳市福田区宣武门大街28号富都大厦A座9层  
法人代表: 张磊  
联系人: 张磊  
客服电话: 400-166-1188  
公司网站: http://78.jt.com.cn  
(93) 和讯信息科技有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东三环泛利大厦10层  
办公地址: 上海市浦东新区东方路1818号保利大厦18楼  
法人代表: 王莉  
联系人: 于静  
客服电话: 400-020-0022  
公司网站: hlxk.bhexun.com  
(94) 江苏汇林保大基金销售有限公司  
注册地址: 南京市高淳区经济开发区古檀大道47号  
办公地址: 南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室  
法人代表: 吴言林  
联系人: 林伊凡  
客服电话: 025-66964166-810  
公司网站: www.huilinfund.com  
(95) 上海搜利财富管理有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号3号楼5层011\_02\_03室  
办公地址: 上海浦东陆家嘴金融世纪广场3号楼6F  
联系人: 冷飞  
联系人: 李刚  
客服电话: 021-50810673  
公司网站: http://www.wecaijin.com/  
(96) 民晟基金销售有限公司  
注册地址: 上海市黄浦区北京东路666号1区(东座)6楼A31室  
办公地址: 上海市黄浦区北京东路666号1区(东座)6楼A31室  
法人代表: 范奇军  
联系人: 杨一  
客服电话: 021-50206003  
公司网站: www.msfc.com.cn  
(97) 北京恒信百盈基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区安定路11号10层1101  
办公地址: 北京市朝阳区安定路11号10层1101  
法人代表: 张旭阳  
联系人: 孙颖  
客服电话: 0529-4  
公司网站: www.baiyingfund.com  
(98) 诺亚正行基金销售有限公司  
注册地址: 上海市金山区陆家嘴环路666号205室  
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼  
法人代表: 张婉杰  
联系人: 张婉杰  
客服电话: 400-821-5399  
公司网站: www.noah-fund.com  
(99) 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单元  
法人代表: 薛峰  
联系人: 汤素娟  
客服电话: 4006-788-887  
公司网站: www.zlfund.com  
(100) 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2层  
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号20楼  
法人代表: 其实  
联系人: 潘世友  
客服电话: 400-1818-188  
公司网站: www.1234567.com.cn  
(01) 上海友基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区东大名路260号2楼241号  
办公地址: 上海市浦东新区1118号鄂尔多斯大厦903-906室  
法人代表: 杨文  
联系人: 张磊  
客服电话: 4007-009-665  
公司网站: www.ehowbuy.com  
(102) 诺诚(杭州)基金销售有限公司  
注册地址: 杭州市余杭区仓前文一西路1218号1栋202室  
办公地址: 杭州市滨江区长河路360号恒生大厦12楼  
法人代表: 陈伟君  
联系人: 张莉  
客服电话: 4000-766-123  
公司网站: www.nuoceng.com  
(103) 上海长量基金销售有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室  
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道565号裕景国际B座16层  
法人代表: 张峻  
联系人: 沈亚琴  
客服电话: 4008-1088-1088  
公司网站: www.shichangfund.com  
(104) 诺亚正行基金销售有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道1609号世纪汇广场二期28楼28层  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1609号世纪汇广场二期28楼28层  
法人代表: 周涛  
联系人: 周涛  
客服电话: 4008-773-772  
公司网站: www.noahfund.com  
(105) 北京展恒基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区安立路36号院4号楼6层601-010单元  
办公地址: 北京市朝阳区安立路36号院4号楼6层601-010单元  
法人代表: 梁洪军  
联系人: 梁洪军  
客服电话: 4000-896-616  
公司网站: www.zhenhengfund.com  
(106) 上海利得基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区临潼路647号1033室  
办公地址: 上海市虹口区临潼路647号1033室  
法人代表: 沈亚琴  
联系人: 曹伟  
客服电话: 400-067-6266  
公司网站: http://aleadfund.com.cn  
(107) 中财证券资产管理有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层  
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层  
法人代表: 路彬  
联系人: 路彬  
客服电话: 95162, 4008888160  
公司网站: www.cftout.com.cn  
(108) 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1600号46楼06-10单元  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1600号46楼06-10单元  
法人代表: 赵军平  
联系人: 张静  
客服电话: 400-021-8850  
公司网站: www.harvestwm.cn  
(109) 北京创金启源基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区民生南路19号院5号楼215A  
办公地址: 北京市朝阳区民生南路19号院5号楼215A

法人代表: 张旭  
联系人: 魏智  
客服电话: 400-6262-818  
公司网站: www.birch.com  
(110) 宜信普华(北京)基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城B1809  
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城B1809  
法人代表: 沈伟  
联系人: 魏智  
客服电话: 400-609-9200  
公司网站: www.yixinfund.com  
(111) 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  
法人代表: 钱枫飞  
联系人: 王峰  
客服电话: 95177  
公司网站: www.snjfund.com  
(112) 北京诺亚正行基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路39号701内09室  
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路39号701内09室  
法人代表: 李欣  
联系人: 李欣  
客服电话: 400-066-8686  
公司网站: https://www.inqiaofund.com/  
(113) 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东达北路10号5层5122室  
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层  
法人代表: 周斌  
联系人: 马鹏程  
客服电话: 400-786-8868  
公司网站: www.htwm.com  
(114) 北京汇成基金销售有限公司  
注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号1118号  
办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号1118号  
法人代表: 王志刚  
联系人: 丁舒  
客服电话: 400-619-9069  
公司网站: www.hcfn.com.cn  
(115) 深圳前海微众银行股份有限公司  
注册地址: 深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201-1(111-812)  
办公地址: 广东省深圳市南山区海德路广发证券大厦6楼  
法人代表: 胡洪波  
联系人: 魏智  
客服电话: 4007-903-6788  
公司网站: www.fundying.com  
(116) 上海大智慧基金销售有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区杨高南路428号1号楼4102、1108室  
办公地址: 上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1108室  
法人代表: 申健  
联系人: 印旃明  
客服电话: 021-20220231  
公司网站: https://88.gw.com.cn/  
(117) 北京新陆合基金销售有限公司  
注册地址: 北京市石景山区金顶街30号3层  
办公地址: 北京市石景山区金顶街30号3层  
法人代表: 张琪  
联系人: 付文红  
客服电话: 010-62675399  
公司网站: www.xlcf.com.cn  
(118) 北京辉腾汇信基金销售有限公司  
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室  
办公地址: 北京市东城区朝外大街11号北国大厦8层815室  
法人代表: 李晨  
联系人: 魏亮  
客服电话: 400-067-8855  
公司网站: www.ktseastone.com  
(119) 济安财富(北京)资本管理有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼402室4601室  
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层  
法人代表: 杨煜  
联系人: 李海婧  
客服电话: 400-673-7010  
公司网站: www.jianfortune.com  
(120) 上海万得基金销售有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴33号1楼B座  
办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼  
法人代表: 王廷富  
联系人: 姜吉灵  
客服电话: 400-021-0203  
公司网站: www.52fund.com.cn  
(121) 上海联泰基金销售有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区泰山路277号310室  
办公地址: 上海市市长宁区福泉北路518号9座3楼  
法人代表: 燕斌  
联系人: 倪悦  
客服电话: 400-1046-6788  
公司网站: www.66zichang.com  
(122) 上海融基基金销售有限公司  
注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室 上海东和经济发  
展区  
办公地址: 上海市崇明县长兴镇潘园公路1818号A1002室  
法人代表: 丁伟  
联系人: 孟杰  
客服电话: 400-821-0203  
公司网站: www.52fund.com.cn  
(123) 上海联泰基金销售有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区泰山路277号310室  
办公地址: 上海市市长宁区福泉北路518号9座3楼  
法人代表: 燕斌  
联系人: 倪悦  
客服电话: 400-1046-6788  
公司网站: www.66zichang.com  
(124) 上海融基基金销售有限公司  
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  
法人代表: 施海彬  
联系人: 宁博宇  
客服电话: 4008-219-031  
公司网站: www.lutund.com  
(125) 大晟基金销售有限公司  
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号106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B1201-1203  
法人代表: 冯雯  
联系人: 黄敏  
客服电话: 020-88250000  
公司网站: www.yinying.com  
(126) 众邦基金销售有限公司  
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市)  
办公地址: 深圳市南山区海德三道海航大厦大厦 111B、1116、1307 室  
法人代表: TEO WEE HOWE  
联系人: 魏智  
客服电话: 400-684-0600  
公司网站: http://www.zbfund.com/  
(127) 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: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室  
法人代表: 彭澎  
联系人: 陈静  
客服电话: 400-809-9988  
公司网站: www.jin.com.cn  
(128) 北京君得利基金销售有限公司  
注册地址: 北京市海淀区苏庄三街2号4层401-15  
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层  
法人代表: 江涛  
联系人: 徐宇平  
客服电话: 400-700-9700  
公司网站: www.junteli.com.cn  
(129) 天津爱建基金销售有限公司  
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室  
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室  
法人代表: 魏怀东  
联系人: 贾国顺  
客服电话: 400-899-1000  
公司网站: www.yibaijin.com  
(130) 深圳市众安基金销售有限公司  
注册地址: 深圳市福田区香梅路1001号中农国际中心B座11层1108  
办公地址: 深圳市福田区香梅路1001号中农国际中心B座11层1108  
法人代表: 魏怀东  
联系人: 魏怀东  
客服电话: 400-300-0660  
公司网站: www.zafund.com  
(131) 北京嘉实基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层  
办公地址: 北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2407  
法人代表: 韩爱华  
联系人: 韩爱华  
客服电话: 400-159-9288  
公司网站: danjiaapp.com  
(132) 钱袋财富投资管理(上海)有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号729E  
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼  
法人代表: 许欣  
联系人: 隋明强  
客服电话: 400-700-9700  
公司网站: www.qidai.com.cn  
(133) 上海华夏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8层  
法人代表: 李一  
联系人: 中秋月  
客服电话: 400-817-5666  
公司网站: www.amcfund.com.cn  
(134) 中财期货有限公司  
注册地址: 上海市东方路800号7、8、10楼  
办公地址: 上海市东方路800号7、8、10楼  
法人代表: 李进伟  
联系人: 李进伟  
客服电话: 400-888-7888  
公司网站: www.sywgw.com  
(135) 上海爱建基金销售有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室  
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室  
法人代表: 冯志军  
联系人: 卢倩倩  
客服电话: 400-080-8208  
公司网站: www.iaimifund.com  
(136) 中财人寿保险有限公司  
注册地址: 中国北京西城区金融大街16号  
办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法人代表: 杨明生  
联系人: 陈军  
客服电话: 010-63631519  
公司网站: www.e-chinalife.com  
(三) 其他  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并在基金管理人网站公示。

二、基金登记机构  
名称: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇广场二期27-30层  
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇广场二期27-30层  
法定代表人: 王明  
成立时间: 1999年4月13日  
电话: (021) 12361018  
传真: (021) 20361616  
联系人: 徐慧  
三、出具法律意见书的律师事务所  
名称: 上海恒宇律师事务所  
住所: 上海市虹口区东大名路689号时代金融中心19楼  
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人: 薛峰  
电话: (021) 31358966  
传真: (021) 31358600  
联系人: 安琴  
经办律师: 薛峰、安琴  
四、会计师事务所  
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴东路166号9楼  
办公地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场东2座16层  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心C606楼  
法定代表人: 毛慧宁  
联系人: 毛慧宁  
电话: 021-22288888  
传真: 021-22280000  
联系人: 上海海华  
经办注册会计师: 薛燕华、费泽湘

第四部分 基金名称  
富国沪深300增强证券投资基金 第五部分 基金类型  
股票型

第六部分 投资目标  
本基金为增强型股票指数基金,在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的风险管理与资产配置,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

第七部分 投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%,投资于国家债券、政府债券、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、可转债等固定收益类资产的比例不高于一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

第八部分 基金投资策略  
本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”,在复制目标指数的基础上一定程度上地调整个股,力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

1. 标的指数  
本基金跟踪的标的指数为沪深300指数。沪深300指数由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场代表性股票,流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

如果沪深300指数被暂停编制及发布,或沪深300指数由其他指数替代(单纯名称除外),或由指数编制方法等发生重大变更导致沪深300指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据审慎原则和最大限度保护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后,依法变更本基金的标的指数和投资对象,并依法公告。变更标的指数、流动性、与原指数的相关性等指标。

由于上述原因变更标的指数和投资对象,基金管理人将在履行适当程序后报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上公告。

2. 指数化投资为主、主动性投资为辅  
本基金主要策略为复制目标指数,投资组合将以成份股在目标指数中的权重为主,利用富国固定投资策略在有限范围内进行超配或低配选择,一方面将严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离目标指数,另一方面在指数跟踪的困难力求超越指数。

富国研究的量化投资策略借鉴国际一定定量分析的应用经验,利用多因子alpha模型预测股票超额回报,在有效风险控制及交易成本最低的基础上优化投资组合。  
(1) 多因子alpha模型—股票超额回报预测  
富国多因子alpha模型以对中国股票市场的长期研究为基础,一定程度上结合前瞻性市场判断,用精确的量化模型对沪深300指数成份股,以及权重在不同、或上的不同行业股票个股的超额回报。概括来讲,本基金alpha模型的因素可分为以下几类: 价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)。

这些类别均来自于市场各类投资者的买入行为,分析师及监管政策等各方面信息。富国多因子alpha模型利用前瞻性市场判断,对沪深300指数成份股,以及权重在不同、或上的不同行业股票个股超额回报状况及变化与各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适时调整投资组合内子类的具体构成及权重。

(2) 风险控制模型—有效风险控制预警  
量化投资力求跟踪误差较小,主动性投资则需要适度风险预算的支持,风险预算模型是风险控制模型。本基金将结合市场波动及自主研发的风险控制模型,有效将投资组合风险控制到预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中,跟踪误差为核心风险控制,跟踪误差为辅助风险控制,以有效控制投资组合相对于目标指数的跟踪误差。本基金标的跟踪误差控制目标: 力争基金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0.5%,年化跟踪误差率不超过1.75%。

(3) 交易成本模型—控制成本并保护业绩  
本基金交易力求在兼顾国际考虑固定成本,也考虑交易的市场冲击效应,在控制成本最低的基础上减少交易造成的业绩侵蚀影响。  
(4) 投资组合优化模型  
本基金将综合考虑跟踪回报、风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以成份股为主,并包括与成份股相关性较强、流动性强,流动性好,从更好地保护基金份额持有人的利益。

3. 对目标指数的跟踪调整  
(1) 定期调整  
本基金所构建的投资组合将主要根据跟踪标的的目标指数对其成份股调整而进行相应的跟踪调整,中证指数公司有权对成份股不定期发布成份股调整决定及其调整权重采用方式,进行相应调整。  
(2) 不定期调整  
根据指数编制规则,当沪深300指数成份股增发、送配等股权变动而需进行成份股权权重调整时,本基金将根据中证指数公司有权发布成份股公告次日发布的成份股调整决定及其调整权重采用方式,进行相应调整。

调整规则原则上为:中证指数公司调整决定公布后至该调整除权日之前。  
此外,基金管理人将结合跟踪的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的情况下,将采取合理方式寻求替代,由于受替代资产流动性不足以及跟踪误差等因素,基金可能不能按照跟踪指数持有成份股,此时也将需要寻求替代。  
4. 债券投资策略  
本基金将结合对国内外宏观经济形势的深入分析、国家财政政策与货币市场政策等因素对债市运行情况的判断,在严格控制利率期限结构、判断债券市场基本走势,制定久期策略下的资产配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场择时、信用利差和相对价值策略,信用风险控制,现金管理等管理手段进行个券选择。

5. 金融衍生品投资策略  
在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地保护基金份额持有人的利益。

第九部分 标的指数与基金业绩比较基准  
本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+15%×指前期货结算价,评价按期间折算。  
本基金以上述业绩比较基准为跟踪标的,判断本基金投资业绩。沪深300指数为沪深300指数A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场代表性股票,流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

本基金认为,该业绩比较基准目前能够客观地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或在市场上出现更合理的、更适用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金可以变更业绩比较基准,但应与托管人协商一致,在履行适当程序后报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

第十部分 基金费用  
本基金是一只股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。  
第十一部分 投资组合报告  
一、报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	8,420,238,266.19	92.36
2	固定收益投资	6,420,238,266.19	92.36
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	应收利息	-	-
7	其他资产	20,132,068.61	0.22
8	合计	9,116,228,773.89	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合  
(A) 农、林、牧、渔业 18,563,426.00 0.21  
B 采矿业 26,292,074.00 0.28  
C 制造业 798,903,012.36 8.86  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 54,462,102.00 0.58  
E 建筑业 - -  
F 批发和零售业 69,539,262.01 0.77  
G 交通运输、仓储和邮政业 63,231,241.32 0.59  
H 住宿和餐饮业 - -  
I 信息技术和通信技术服务业 10,980,104.00 0.12  
J 金融业 57,772,962.11 0.63  
K 房地产业 36,862,188.00 0.41  
L 租赁和商务服务业 - -  
M 科学研究和技术服务业 9,051,640.08 0.10  
N 水利、环境和公共设施管理业 - -  
O 房地产业、物业管理和其他服务业 180,980,270.00 1.97  
P 教育 - -  
Q 卫生健康工作 26,364,262.00 0.28  
S 综合 - -  
合计 1,142,821,976.77 12.67

三、报告期末按股票投资行业分类的股票投资组合  
(A) 农、林、牧、渔业 276,366,897.94 3.06  
B 采矿业 266,188,691.71 2.91  
C 制造业 2,908,072,694.20 32.24  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 153,594,367.00 1.68  
E 建筑业 196,729,893.17 2.17  
F 批发和零售业 69,539,262.01 0.77  
G 交通运输、仓储和邮政业 100,915,501.28 1.11  
H 住宿和餐饮业 - -  
I 信息技术和通信技术服务业 289,546,861.58 3.21  
J 金融业 2,574,697,873.69 28.54  
K 房地产业 266,012,568.01 2.92  
L 租赁和商务服务业 17,488,672.00 0.19  
M 科学研究和技术服务业 16,496,917.89 0.17  
N 水利、环境和公共设施管理业 12,538,900.00 0.14  
O 房地产业、物业管理和其他服务业 - -  
P 教育 54,712,696.00 0.61  
Q 卫生健康工作 63,532,667.66 0.68  
R 文化、体育和娱乐业 24,240,000.00 0.27  
S 综合 - -  
合计 7,277,416,380.42 80.67

四、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细  
(一) 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	6,006,628.00	417,563,586.76	4.63
2	000333	美的集团	5,542,776.00	269,346,176.10	2.99
3	600936	招商局	8,170,126.00	263,753,894.60	2.92
4	600519	贵州茅台	231,579.00	267,284,390.00	2.95
5	600276	诺德股份	14,316,982.00	257,471,878.00	2.83
6	601109	华信股份	14,316,982.00	227,783,242.72	2.52
7	602288	海天味业	1,379,688.00	172,696,540.00	1.91
8	601688	华泰证券	9,642,400.00	166,138,552.00	1.84
9	601121	国泰君安	10,064,702.00	163,600,548.56	1.81
10	600094	招商局	8,170,126.00	163,053,279.20	1.78

(二) 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	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	000672	上海绿新	6,500,160.00	109,679,073.20	1.22
2	600720	上海地产	5,809,520.00	76,761,443.80	0.84
3	600746	江苏银行	543,261.00	55,139,976.60	0.61
4	601872	招商公路	7,533,100.00	48,156,500.00	0.53
5	000887	云南铜业	11,983,200.00	46,066,384.00	0.51

五、报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券投资。  
六、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债券投资明细  
七、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  
八、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  
九、本基金本报告期末未持有贵金属投资  
十、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  
十一、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
(一) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
(二) 股指期货持仓和损益明细表  
(三) 股指期货持仓和损益明细表  
(四) 股指期货持仓和损益明细表

注:本基金本报告期末未持有股指期货投资。  
十二、本基金本报告期末持有的股票融资情况  
在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地保护基金份额持有人的利益。

十三、基金投资组合报告附注  
(一) 本基金投资的前十名股票未出现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。  
(二) 本基金投资的前十名股票未出现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。  
(三) 本基金投资的前十名股票未出现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。  
(四) 本基金投资的前十名股票未出现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。

十四、基金投资组合报告附注  
(一) 本基金投资的前十名股票未出现被