

(上接B191版)

网址:www.avicsc.com
 (104) 中金公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼27层及28层
 法定代表人:金立群
 联系人:宋宇洲
 联系电话:0755-825548240
 网址:www.cicc.com.cn
 (105) 中信证券
 注册地址:北京市朝阳区中航路6009号新世界中心29层
 法定代表人:吴永良
 联系人:罗艺琳
 客户服务电话:4001022011
 网址:www.csqq.com.cn
 (106) 招商证券
 注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
 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
 法定代表人:虞海泉
 联系人:李微
 客户服务电话:400-869-5618
 网址:www.cs.com.cn
 (107) 中航证券
 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18-21层
 及第14层01,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23单元
 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
 法定代表人:罗增来
 联系人:刘毅
 联系电话:0755-82023442
 客户服务电话:400-600-8008,96532
 传真:025-83320066
 网址:www.wjzq.com.cn
 (85) 平安证券
 注册地址:深圳市福田区中心金田路4036号荣超大厦16-20层
 办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
 法定代表人:谢永林
 联系人:郑舒丽
 客户服务电话:95511-8
 开放式基金净值传真:0755-82400862
 网址:www.pjganc.com
 (86) 齐鲁证券
 注册地址:山东省济南市经七路96号
 法定代表人:李伟
 联系人:吴阳
 联系电话:0531-68889165
 客户服务电话:400-660-9839
 传真:010-66412537
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (88) 瑞银证券
 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
 法定代表人:程宜荪
 联系电话:010-56328112
 客户服务电话:400-887-8827
 传真:010-58328170
 网址:www.wtsecurities.com
 (89) 西南证券
 注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
 办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
 法定代表人:侯巍
 联系人:郭熠
 联系电话:0351-8686659
 客户服务电话:0351-73004-666-1618
 传真:0351-8686619
 网址:www.wt16.com.cn
 (90) 申银万国证券
 注册地址:上海市徐汇区长乐路998号世纪商贸广场45层
 办公地址:上海市徐汇区长乐路998号世纪商贸广场40层
 法定代表人:储晓明
 联系人:曹群
 联系电话:021-32389898
 客户服务电话:0952-23008523
 传真:021-3238214
 网址:www.zyyw.com
 (91) 世纪证券
 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:姜黎军
 联系人:袁媛
 联系电话:0755-83199511
 开放式基金净值传真:0755-83199511
 开放式基金净值传真:0755-83199645
 网址:www.csco.com.cn
 (92) 天源证券
 注册地址:西安市新街22号陕西信托大厦16-17层
 办公地址:西安市新街22号陕西信托大厦16-17层
 法定代表人:刘建武
 联系人:刘莹
 联系电话:029-67406409
 客户服务电话:029-95682
 传真:029-87406710
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (94) 西部证券
 注册地址:西安市新街22号陕西信托大厦16-17层
 办公地址:西安市新街22号陕西信托大厦16-17层
 法定代表人:余维佳
 联系人:张煜
 联系电话:023-63786633
 客户服务电话:4000806096
 传真:023-63786212
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (96) 西南证券
 注册地址:重庆市江北区桥北8号
 办公地址:重庆市江北区桥北8号西南证券大厦
 法定代表人:余维佳
 联系人:张煜
 联系电话:023-63786633
 客户服务电话:4000806096
 传真:023-63786212
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (97) 湘财证券
 注册地址:湖南省长沙天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 办公地址:湖南省长沙天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 法定代表人:林俊
 联系人:赵小明
 联系电话:021-6361140
 客户服务电话:400-888-133
 开放式基金净值传真:020-22373718-1013
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (98) 新时代证券
 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号15层
 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号15层
 法定代表人:刘安军
 联系人:孙侃
 联系电话:010-83361149
 客户服务电话:400-698-9898
 开放式基金净值传真:010-83361094
 网址:www.wt2xq.com.cn
 (99) 信达证券
 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 法定代表人:张志刚
 联系人:唐静
 联系电话:010-63081000
 客户服务电话:400-800-8899
 传真:010-63090978
 网址:www.cindasc.com
 (100) 兴业证券
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1619号
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1619号
 法定代表人:陈有安
 联系人:宋明
 联系电话:010-66568450
 客户服务电话:400-888-8888
 传真:010-66568990
 网址:www.csco.com.cn
 (101) 银泰证券
 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
 法定代表人:陈有安
 联系人:林生迎
 联系电话:0755-82943666
 客户服务电话:95565-400-888-111
 传真:0755-82943636
 网址:www.newone.com.cn
 (102) 招商证券
 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
 法定代表人:宫少林
 联系人:林生迎
 联系电话:0755-82943666
 客户服务电话:95565-400-888-111
 传真:0755-82943636
 网址:www.newone.com.cn
 (103) 中航证券
 注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
 法定代表人:王宜四
 联系人:董薇
 联系电话:0791-86763861
 客户服务电话:400-886-567
 传真:0791-86770178

本投资组合报告有关数据的期间为2014年4月1日至2014年6月30日。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,291,086.78	0.03
	其中:股票	1,291,086.78	0.03
2	基金投资	4,307,671,649.23	94.58
3	固定收益投资	200,220,000.00	4.40
	其中:债券	200,220,000.00	4.40
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	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	38,389,201.70	0.84
	其他资产	6,749,056.89	0.15
9	合计	4,554,320,994.60	100.00

(2) 基金托管人的托管费:

(3) 基金财产按支付的银行费用;

(4) 基金合同生效后的基金信息披露费用;

(5) 基金份额持有人的人大费;

(6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(7) 基金的证券交易费用;

(8) 基金的指数使用费;

(9) 购销服务费;

(10) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 上述基金费用由基金管理人按基金合同的规定范围参照公允的市场价格确定,法律法另有规定的从其规定。

3. 基金费用的计提方法、计费标准和支付方式:

由于本基金管理人和基金托管人同为为目标ETF的基金管理人与基金托管人,为避免重复收费,基金管理人、基金托管人不对基金财产中投资于目标ETF的部分计提管理费、托管费。本基金制定了以下的收费标准。

(1) 基金管理人的管理费:

本基金管理人按前一日基金资产净值扣除前一天持有目标ETF公允价值后的余额的0.05%,即0.05%的费率计算。管理费的计算方法如下:

H = E × 0.05% = 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为每日基金资产净值扣除前一天持有目标ETF公允价值后的余额,若为负数,则取0。

基金管理人的管理费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(2) 基金托管人的托管费:

本基金托管费前一日基金资产净值扣除前一天持有目标ETF公允价值后的余额的0.01%,即0.01%的费率计算。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.01% = 当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为每日基金资产净值扣除前一天持有目标ETF公允价值后的余额,若为负数,则取0。

基金管理人按前一日基金资产净值扣除前一天持有目标ETF公允价值后的余额的0.01%的费率计算。基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(3) 基金管理人的管理费:

根据本基金管理人与沪深300指数所有人民币指数有限公司签署的协议,基金管理人有权使用由基金管理人与沪深300指数所有人民币指数有限公司授权的基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(4) 基金的销售服务费:

本基金销售服务费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的销售服务费率为0。

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(5) 基金的指数使用费:

根据本基金管理人与沪深300指数所有人民币指数有限公司签署的协议,基金管理人有权使用由基金管理人与沪深300指数所有人民币指数有限公司授权的基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(6) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(7) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(8) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(9) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(10) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(11) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(12) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(13) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出资资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣收,基金管理人如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(14) 基金的指数使用费:

本基金指数使用费的在0.05%的范围内,具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施。目前,本基金的指数使用费率为0。

指数使用费每日计提,按月支付。由基金管理人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在每五个