

(上接B053版)

81)华泰证券股份有限公司			
注册地址	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦		
法定代表人	吴万善		
客服电话	95697	网址	www.htsc.com.cn
82)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28层A01、B01（b）单元		
法定代表人	陈亮		
客服电话	021-52106669; 029-68919889	联系人	杨莉娟
		网址	www.cfsc.com.cn
83)金元证券股份有限公司			
注册地址	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
法定代表人	陆涛		
客服电话	400-888-8228	网址	www.jyzq.cn
84)南京证券有限责任公司			
注册地址	江苏省南京市大钟亭9号		
法定代表人	孙国恒		
客服电话	400-828-5888	网址	www.njzq.com.cn
85)平安证券股份有限公司			
注册地址	深圳市福田区中心区金田路4030号荣超大厦16-20层		
法定代表人	谢永林		
客服电话	95511-8	网址	http://www.pingan.com
86)长城国瑞证券股份有限公司			
注册地址	厦门市莲厝西路2号莲富大厦17楼		
法定代表人	傅晓程		
客服电话	0592-5163888	网址	www.xmzq.cn
87)上海证券有限责任公司			
注册地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	龚德雄		
客服电话	400-891-8918; 021-962518	联系人	张维
		网址	http://www.962518.com
88)申银宏源证券股份有限公司			
注册地址	上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层		
法定代表人	李梅		
客服电话	95523; 400-888-5523	网址	www.swhysc.com
89)世纪证券有限责任公司			
注册地址	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层		
法定代表人	姜昧军		
网址	www.scsc.com.cn		
90)太平洋证券股份有限公司			
注册地址	云南省昆明市青年路389号志远大厦18层		
法定代表人	李长伟		
联系人	唐昌田		
客服电话	400-685-0959	网址	http://www.tpyzq.com
91)天风证券股份有限公司			
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼		
法定代表人	余磊		
联系人	刘鑫		
客服电话	028-86711410; 027-87618882	网址	www.tfzq.com
92)万联证券股份有限公司			
注册地址	广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F18、19层		
法定代表人	张建军		
联系人	王鑫		
客服电话	400-8888-133	网址	www.wljzq.com.cn
93)五矿证券股份有限公司			
注册地址	深圳市福田区金田路4028号卓越经贸中心办公楼47层01单元		
法定代表人	张永泰		
联系人	魏碧伟		
客服电话	400-184-0028	网址	www.wkzq.com.cn
94)西藏同信证券股份有限公司			
注册地址	西藏自治区拉萨市北京中路101号		
法定代表人	贾柏君		
联系人	曹亦忠		
客服电话	400-881-1177	网址	www.xtzsc.com
95)西南证券股份有限公司			
注册地址	重庆市江北区桥北苑8号		
法定代表人	余维佳		
客服电话	400-808-6086	网址	www.swsc.com.cn
96)湘财证券股份有限公司			
注册地址	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼		
法定代表人	林波		
联系人	赵小明		
客服电话	400-888-1161	网址	www.xcsc.com
97)兴业证券股份有限公司			
注册地址	福州市湖东路268号		
法定代表人	兰荣		
客服电话	95692	网址	www.xyqzq.com.cn
98)光大证券股份有限公司			
注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层		
法定代表人	吴昊		
客服电话	4000-188-688	网址	www.evgsc.com
99)招商证券股份有限公司			
注册地址	深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层		
法定代表人	宫少林		
联系人	林生迎		
客服电话	400-8888-1111; 95565	网址	www.newone.com.cn
100)浙商证券股份有限公司			
注册地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6/7		
法定代表人	吴承恩		
客服电话	0571-967777	网址	www.zscsc.com
101)中国中投证券有限责任公司			
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、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元		
法定代表人	龙智果		
联系人	刘毅		
客服电话	4008-008-008; 95532	网址	www.china-ivns.com
102)中航证券有限公司			
注册地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金茂大厦A座41楼		
法定代表人	杜航		
联系人	戴霞		
客服电话	400-8866-567	网址	www.avicsc.com
103)中山证券有限责任公司			
注册地址	深圳市南山区科技中一路华强高新大厦7楼、8层		
法定代表人	黄扬流		
联系人	罗艺琳		
客服电话	400-1022-011	网址	http://www.zszq.com/
104)中银国际证券有限责任公司			
注册地址	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层		
法定代表人	许刚		
联系人	王炜哲		
客服电话	400-620-8888	网址	www.bocichina.com
105)东莞农村商业银行股份有限公司			
注册地址	广东省东莞市东城区鸿福东路2号		
法定代表人	何伟强		
联系人	何茂才		
客服电话	0769-961122	网址	www.drcbank.com
106)上海天天基金销售有限公司			
办公地址	上海市徐汇区龙田路150号3C座908楼		
联系人	潘世华		
客服电话	400-1818-188	网址	www.1234567.com.cn
107)北京钱景财富投资管理有限公司			
办公地址	北京市海淀区海淀南路13号楼6层601室		
联系人	魏争		
客服电话	400-678-5005	网址	www.qianjin.net
108)嘉实财富管理有限公司			
办公地址	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
联系人	魏静雯		
客服电话	400-021-8850	网址	www.harvestwm.cn
109)浙江同花顺基金销售有限公司			
办公地址	浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903		
联系人	杨皓		
客服电话	0571-88323897	网址	www.123456.com
110)北京恒天明泽基金销售有限公司			
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		
联系人	陈攀		
客服电话	400-798-8988-5	网址	www.chtfund.com/
111)深圳众禄基金销售有限公司			
办公地址	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼		
联系人	章彩平		
客服电话	4006-788-887	网址	www.zlfund.cn 及 www.jimw.com
112)杭州数米基金销售有限公司			
办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼		
联系人	徐海峰		
客服电话	4000-706-123	网址	www.fund123.cn
113)上海好买基金销售有限公司			
办公地址	上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室		
联系人	罗梦		
客服电话	400-700-9665	网址	www.ehowbuy.com

基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

②场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二) 注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所及办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	崔巍
电话	010-66210988; 010-59378888	传真	010-66210938

(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		
住所及办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	021-31358666	传真	021-31358600
经办律师	吕红、黎明		

(四) 会计师事务所及经办注册会计师

名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)		
办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2楼东2A层(国际3办公楼)16层		
执行事务人	吴皓平	联系人	王珊珊
电话	010-58153280; 010-58152145	传真	010-58188286
经办注册会计师	李慧民、王珊珊		

**四、基金名称**

本基金名称:银华深证100指数分级证券投资基金

**五、基金的类型**

股票型基金

**六、基金的运作方式**

契约型开放式

**七、基金的投资目标**

本基金运用指数化投资方式,力争将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的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现跟踪深证100 指数的有效跟踪,分享中国经济的持续、稳定增长的成果,实现基金资产的长期增值。

**八、基金的投资范围**

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括深证100指数的成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%,其中投资于深证100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例5%—10%(其中权证资产占基金资产比例0—3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%)。

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

**九、基金的投资策略**

本基金采用完全复制制,按照成份股在深证100指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪深证100指数的收益表现,并根据跟踪的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

**1.资产配置策略**

本基金管理人主要按照深证100指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%,其中投资于深证100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%—10%(其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%)。基金管理人将综合考虑市场环境、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的资产配置比例。

**2.股票投资组合构建**

(1) 组合构建原则

本基金通过完全复制指数的方法,根据深证100指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

(2) 组合构建方法

本基金采用完全复制制,按照成份股在深证100指数中的基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

(3) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据深证100指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整,同时,本基金还将根据法律法规和《基金合同》中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以力争实现基金净值增长率与深证100指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起6个月内使本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。

**①定期调整**

根据深证100指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

**②临时调整**

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪深证100指数;

C. 根据法律、法规的规定,成份股在深证100指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重与指数一致。

**③其他调整**

针对我国证券市场新发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购、认购的非成份股将在规定持有期之后的一段时间以内卖出。

(4) 投资绩效评估

在正常市场情况下,本基金力争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误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

**十、业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。由于本基金的投资标的为深证100价格指数,且本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%,因此,本基金将业绩比较基准设定为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以变更业绩比较基准,但应与托管人协商一致,并在履行适当程序后报中国证监会备案,以及在中国证监会指定的媒体上及时公告。

**十一、风险收益特征**

本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,银华稳进份额具有低风险、收益相对稳定的特征;银华锐进份额具有高风险、高预期收益的特征。

**十二、投资组合报告**

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定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至2015年3月31日(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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,273,939,993.96	93.56
	其中:股票	9,273,939,993.96	93.56
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	576,619,837.07	5.82
7	其他资产	61,563,800.15	0.62
8	合计	9,912,122,631.17	100.00
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合			
2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合			

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	14,504,045.32	0.15
B	采矿业	128,542,020.88	1.31
C	制造业	5,036,646,582.70	51.16
D	电力、热力、燃气及生产供应业	60,506,646.83	0.61
E	建筑业	110,609,301.36	1.12
F	批发和零售业	246,549,362.93	2.50
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	736,945,522.46	7.48
J	金融业	1,471,421,531.28	14.94
K	房地产业	751,026,371.33	7.63
L	租赁和商务服务业	163,266,652.52	1.66
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	263,028,860.13	2.67
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	169,466,727.81	1.62
S	综合	79,479,825.70	0.81
	合计	9,221,884,101.25	93.66

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	52,045,892.70	0.53
D	电力、热力、燃气及生产供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	52,045,892.70	0.53

3. 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)
----	------	------	-------