

(上接B062版)

北京西城区南滨河路1号... 联系人: 唐静... 电话: (010) 63081000

84.南京证券股份有限公司... 住所: 江苏省南京市大钟亭8号... 联系人: 潘勇

85.上海证券有限责任公司... 住所: 上海市四川中路213号... 联系人: 许彦华

86.新时代证券有限责任公司... 住所: 北京市海淀区北三环西路99号... 联系人: 刘军

87.大同证券有限责任公司... 住所: 大同市城区迎宾街15号... 联系人: 董祥

88.国联证券股份有限公司... 住所: 江苏省无锡市太湖新城金融一街... 联系人: 李洪

89.浙商证券股份有限公司... 住所: 浙江省杭州市庆元路1号... 联系人: 许雁行

90.国海证券股份有限公司... 住所: 广西桂林市辅星路13号... 联系人: 李孟宇

91.东菱证券股份有限公司... 住所: 广东省东莞市莞城区可园南路1号... 联系人: 张运勇

92.中原证券股份有限公司... 住所: 郑州市郑东新区商务外环10号... 联系人: 程旭

93.国都证券股份有限公司... 住所: 北京市东城区东直门南大街3号... 联系人: 董皓

94.中银国际证券有限责任公司... 住所: 上海市浦东新区银城中路200号... 联系人: 李丹

95.恒泰证券股份有限公司... 住所: 内蒙古呼和浩特市新城区新华大街111号... 联系人: 陈介民

96.国盛证券有限责任公司... 住所: 江西省南昌市北京西路88号... 联系人: 曹春香

97.第一创业证券股份有限公司... 住所: 广东省深圳市福田区福源路12号... 联系人: 刘智程

98.金元证券股份有限公司... 住所: 海南省海口市南宝路36号... 联系人: 陆琦

99.德邦证券有限责任公司... 住所: 上海市普陀区曹杨路510号... 联系人: 魏文平

100.西部证券股份有限公司... 住所: 陕西省西安市东大街222号... 联系人: 刘霞

101.华龙证券有限责任公司... 住所: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号... 联系人: 李野田

102.财通证券股份有限公司... 住所: 杭州市杭大路15号... 联系人: 沈婕宁

103.上海华信证券有限责任公司... 住所: 上海市浦东新区世纪大道100号... 联系人: 罗逸

104.华鑫证券有限责任公司... 住所: 深圳市福田区金田路4018号... 联系人: 孔泉

105.瑞银证券有限责任公司... 住所: 北京市西城区金融大街7号... 联系人: 程伟

106.中山证券有限责任公司... 住所: 深圳市福田区益田路6009号... 联系人: 吴永良

107.国融证券股份有限公司... 住所: 呼和浩特市新城区锡林南路18号... 联系人: 孔佑杰

108.江海证券有限公司... 住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号... 联系人: 刘霞

黑龙江哈尔滨香坊区赣水路56号... 联系人: 刘霞

109.国金证券股份有限公司... 住所: 成都市东城根上街95号... 联系人: 冉云

110.中国民族证券有限责任公司... 住所: 北京市西城区金融街5号... 联系人: 赵大建

111.华宝证券有限责任公司... 住所: 上海市浦东新区世纪大道100号... 联系人: 陈琳

112.长城国瑞证券有限公司... 住所: 厦门市莲前西路2号... 联系人: 王勇

113.爱建证券有限责任公司... 住所: 上海市浦东新区世纪大道1600号... 联系人: 官云云

114.华融证券股份有限公司... 住所: 北京市西城区金融大街8号... 联系人: 宋德清

115.天风证券股份有限公司... 住所: 湖北省武汉市武昌区中南路99号... 联系人: 余磊

(二)场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

(三)基金注册登记机构

中国证券投资基金登记结算有限公司... 住所: 北京市西城区太平桥大街17号

(四)律师事务所和经办律师

北京市金杜律师事务所... 住所: 北京市朝阳区东三环中路7号

(五)会计师事务所和经办注册会计师

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)... 住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号

四、基金的投资

基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%;权证市值不超过基金资产净值的3%。

基金采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差率不超过1.4%。

如果未来法律法规或监管机构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。

基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定,法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%), 说明. Rows include 权益投资, 固定收益投资, 资产支持证券, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产.

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 说明. Rows include 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 电力热力燃气及生产供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利环境和公共设施管理业, 居民服务修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化体育和娱乐业, 综合.

(2)报告期末非指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 说明. Rows include 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 电力热力燃气及生产供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利环境和公共设施管理业, 居民服务修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化体育和娱乐业, 综合.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 中国平安, 兴业银行, 民生银行, 交通银行, 农业银行, 中国建筑, 招商银行, 工商银行, 万科A, 中国石化.

4.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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 中国建设, 小康股份, 玲珑轮胎, 上海沪工, 三德科技.

5.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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 国债, 央行票据, 金融债, 其中:政策性金融债, 企业债, 中期票据, 可转债(可交换债), 其他.

6.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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Row include 150215 15国开15.

注:报告期末,本基金仅持有上述1只债券。报告期末未持有资产支持证券。

7.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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

8.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

报告期末,本基金未持有权证。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。报告期末,本基金未持有资产支持证券。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。报告期末,本基金未持有资产支持证券。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。报告期末,本基金未持有资产支持证券。

报告期末,本基金未持有资产支持证券。报告期末,本基金未持有资产支持证券。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 说明. Rows include 万科A, 中国建设, 玲珑轮胎.

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%。

1.11.5.2 报告期末未积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 说明. Rows include 601611 中国建筑, 601966 中国铁建.

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。