

(上接B082版)

61	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号高科大厦四楼 办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路9号保利国际A座37楼 法定代表人:余磊 联系人:夏莹 电话:027-37619753 传真:027-37619863 客服电话:4008006000或96391 网址:www.tzfz.com	81	上海大智慧财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东杨高南路428号10层10-11层 办公地址:上海市浦东杨高南路428号10层10-11层 法定代表人:申伟 联系人:王昭明 电话:021-20219536 传真:021-20219923 客服电话:021-0212019931 网址:http://www.hjzq.com	101	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街1号1108室 办公地址:北京市西城区金融大街1号1108室 法定代表人:王伟伟 联系人:丁向明 电话:010-56281240 传真:010-62630027 客服电话:4006190969 网址:www.hcjzq.com	34. 报告期基金的会计师事务所 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 办公地址:上海市陆家嘴环路202号普华永道中心11楼 执行事务合伙人:李明 联系电话:(021)123238888 传真:(021)23238800 联系人:陈熹 经办注册会计师:薛亮、陈熹	注:本基金本报告期末持有权证。 9. 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基金投资明细
62	诺亚正行(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360号9号3724室 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号3栋 法定代表人:汪静波 联系人:张鹤 电话:021-3850777 传真:021-821-5399 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah-fund.com	82	上海联泰资产管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号底层101室 办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8层3层 法定代表人:燕燕 联系人:吴东 电话:021-52222063 传真:021-52975270 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.lfzqchan.com	102	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址:南京市鼓楼区苏宁大道1号5层 办公地址:南京市鼓楼区苏宁大道1号5层 法定代表人:王峰 联系人:王峰 电话:025-69999999-887226 传真:025-69999999 客服电话:051-177 网址:www.njzfj.com	10. 报告期末按基金资产的公允价值占总资产的比例排序的前五名基金投资情况说明 11. 报告期末按公允价值占基金资产的公允价值排序的前五名债券投资 12. 本基金投资的前十名股票没有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。	
63	深圳众盈金融控股股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资贸易大厦9楼 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资贸易大厦9楼 法定代表人:薛峰 联系人:童平平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:400-768-887 网址:www.zlfund.cn, www.jxnmw.com	83	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号建威大厦1208 办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 法定代表人:罗增财 联系人:王丽丽 电话:010-67009889-6028 传真:010-67009889-6000 客服电话:010-67009889 网址:www.zxvc.com	103	北京广源达信投资管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11号楼9层 办公地址:北京市朝阳区望京东园四期商务中心B座9层 法定代表人:王剑峰 联系人:吴英华 电话:010-262656960 客服电话:40062626060 网址:www.nmifund.com	13. 本基金在进行股票投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过分析证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型,寻求合理的价值水平,与现货资产进行匹配,通过过多头空头套期保值策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险,对冲特殊情况下流动性的风险,如大额申购赎回等;运用衍生金融产品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 注:本基金本报告期未投资国债期货。	
64	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区宜山路196号26号楼2楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路118号鄂尔多斯国际大厦C座-908室;上海市虹口区欧阳路196号(泛舟新创园)126号2楼 法定代表人:黄文斌 联系人:张茹 电话:021-20613399 传真:021-69506916 客服电话:400-700-9666 网址:www.ehuyi.com	84	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路475号1023室 办公地址:上海市宝山区蕴川路475号1023室 法定代表人:李春晓 联系人:王怡晨 电话:021-50683633 传真:021-50683633 客服电话:400-921-7755 网址:www.leadfund.com	104	上海万得基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区峨山路91弄103号 办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄103号 法定代表人:孙斐斐 联系人:王斐 电话:010-61649888 传真:010-61649899 客服电话:400-821-0203 网址:https://www.jianpinganpc.com	14. 报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细 注:本基金本报告期未持有可转换债券。	
65	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仓前街一西路1218号1栋202室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙国际广场B座9层 法定代表人:陈柏青 联系人:韩彬 电话:0571-766-123 客服电话:400-766-123 网址:www.fund123.cn	85	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路109号19层 上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人:金伟 联系人:陈云卉 电话:021-33233999 传真:021-33233837 客服电话:400-820-1515 网址:www.zhangtongfund.com	105	北京汇基基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区顺通东大街1号院6号楼2单元212号2507 办公地址:北京市朝阳区顺通东大街1号院6号楼2单元212号2507 法定代表人:孙斐斐 联系人:孙斐斐 电话:010-50710161 传真:010-50710161 客服电话:400-15851810 网址:https://www.jianpinganpc.com	15. 基金的投资组合比例:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的的目标ETF份额可计在内)。每个交易日终日在扣除股指期货合约的未净额的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。 § 8 基金的投资策略	
66	上海长盈基金销售顾问有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路6号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区浦东北大道556号裕景国际B座9层 法定代表人:张跃伟 联系人:余峰峰 电话:021-20691982 传真:021-20691981 客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com	86	厦门鑫鼎盛控股有限公司	注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人:施洪生 联系人:云云 电话:0592-3122575 传真:0955-3122701 客服电话:400-918-0008 网址:www.xds.com	106	上海云投投资管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13层 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13层 法定代表人:戴斯蒙 联系人:戴斯蒙 电话:021-20638888 传真:021-20638899 客服电话:400-820-1515 网址:www.zhangtongfund.com	16. 基金的投资组合比例:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、债券、股票、权证、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定,可以将其纳入投资范围,并可依椐届时有效的法律法规适时地调整投资范围。	
67	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路6号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区浦东北大道556号裕景国际B座9层 法定代表人:张跃伟 联系人:余峰峰 电话:021-20690998 传真:021-4509998 客服电话:400-6021 网址:www.1234567.com.cn	87	中信建投期货有限公司	注册地址:重庆市渝中区中山路107号上站大楼平11-B,名都11-A,8-B,8-C 办公地址:渝中区中山路107号上站大楼平11-B,名都11-A,8-B,8-C 法定代表人:彭文彬 联系人:王杰 电话:021-68763007 传真:021-68763048 客服电话:400-997-780 网址:www.cfc100.com	107	上海中广达信投资管理有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙腾大道281号302室 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道281号302室 法定代表人:黄晓微 联系人:黄晓微 电话:021-3769132 传真:021-3769132-802 客服电话:400-6767-523 网址:www.zzzwealth.com	17. 基金的投资组合比例:本基金并不以目标ETF的管理。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不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整等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。 (一) 资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、债券、股票、权证、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。	
68	北京恒基基金销售有限公司	注册地址:北京市顺义区后沙峪嘉富国际9号 办公地址:北京市顺义区后沙峪嘉富国际9号 法定代表人:周杰 联系人:周杰 电话:010-56013366 传真:010-62020555 客服电话:400198000 网址:www.myfund.com	88	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1334号14楼9层 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:胡学勤 联系人:胡学勤 电话:021-20669562 传真:021-22066653 客服电话:4008210901 网址:www.lfunds.com	108	南京途牛金融服务有限公司	注册地址:南京市玄武区龙蟠路699-1号 办公地址:南京市玄武区龙蟠路699-1号 法定代表人:胡志伟 联系人:胡志伟 电话:025-98559399-66727 客服电话:4007-999-999 网址:www.tutu.com	18. 基金的投资策略 本基金以目标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。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不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整等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。 (二) 目标ETF的交易策略 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。 (三) 成份股、备选成份股的投资策略 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。因此可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即按照指数的构成比例或与其重构基金股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额的股票投资时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 (四) 债券投资策略 在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面变化和投资人行为分析判断未来市场期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的配置比例;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在资金操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获得超额的债券收益。 (五) 权证投资策略 本基金投资于权证的方式如下: (1) 申购和赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回或按照目标ETF法律文件的规定以其他方式申购赎回目标ETF。 (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。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。 (三) 成份股、备选成份股的投资策略 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。因此可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即按照指数的构成比例或与其重构基金股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额的股票投资时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 (四) 债券投资策略 在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面变化和投资人行为分析判断未来市场期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的配置比例;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在资金操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获得超额的债券收益。 (五) 权证投资策略 本基金投资于权证的方式如下: (1) 申购和赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回或按照目标ETF法律文件的规定以其他方式申购赎回目标ETF。 (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。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。 (三	