（上接A31版）

客服电话：0931-96668、4006898888
公司网站：www.hlzqgs.com
（70）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦3层
法人代表：李剑阁
联系电话：010-65051166
传真电话：010-65051166
联系人员：陶亭
客服电话：010-65051166
公司网站：http://www.cicc.com.cn
（71）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法人代表：杨锐敏
联系电话：021-38784818
传真电话：021-68775878
联系人员：倪丹
客服电话：68777877
公司网站：www.cf-clsa.com
（72）瑞银证券有限责任公司
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：程宜荪
联系电话：010-58328888
传真电话：010-58328112
联系人员：牟冲
客服电话：4008878827
公司网站：www.ubssecurities.com
（73）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
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
联系电话：0755-82023442
传真电话：0755-82026539
联系人员：张鹏
客服电话：95532、400-600-8008
公司网站：www.china-invs.cn
（74）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56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表：孙名扬
联系电话：0451-85863719
传真电话：0451-82287211
联系人员：刘爽
客服电话：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn
（75）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：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层
法人代表：祝献忠
联系电话：010-85556012
传真电话：010-85556053
联系人员：李慧灵
客服电话：400-898-9999
公司网站：www.hrsec.com.cn
（76）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
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法人代表：余磊
联系电话：027-87610052
传真电话：027-87618863
联系人员：杨晨
客服电话：4008005000
公司网站：www.tfzq.com
（77）大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法人代表：张智河
联系电话：0411-39673202
传真电话：0411-39673219
联系人员：谢立军
客服电话：4008-169-169
公司网站：www.datong.com.cn
（78）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法人代表：李悦章
联系电话：010-65983456
传真电话：010-65983333
联系人员：张林
客服电话：400-066-8586
公司网站：https://www.igesafe.com/
（79）江苏金百临投资咨询有限公司
注册地址：无锡市太湖新城锦溪道棟泽路9号楼
办公地址：无锡市太湖新城锦溪道棟泽路9号楼
法人代表：费晓燕
联系电话：0510-82758877
传真电话：0510-88555898
联系人员：袁丽萍
客服电话：0510-9688988
公司网站：www.jsjbl.com
（80）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法人代表：张彦
联系电话：010-83363099
传真电话：010-83363010
联系人员：张燕
客服电话：400-166-1188
公司网站：http://8.jrj.com.cn
（81）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法人代表：王莉
联系电话：400-920-0022
传真电话：021-20835879
联系人员：于杨
客服电话：400-920-0022
公司网站：licaike.hexun.com
（82）上海挖财金融信息服务有限公司
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01、02、03室
办公地址：上海浦东陆家嘴金融世纪广场3号楼5F
法人代表：胡燕亮
联系电话：021-50810673
传真电话：021-58300279
联系人员：李娟
客服电话：021-50810673
公司网站：http://www.wacaijijin.com/
（83）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650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：汪静波
联系电话：021-3860-0672
传真电话：021-3860-2300
联系人员：张姣杰
客服电话：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com
（84）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、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I、J单元
法人代表：薛峰
联系电话：0755-33227950
传真电话：0755-82080798
联系人员：汤素娅
客服电话：4006-788-887
公司网站：www.zlfund.cn
（85）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26楼
法人代表：其实
联系电话：021-54509998
传真电话：021-64385308
联系人员：潘世友
客服电话：400-1818-188
公司网站：www.1234567.com.cn
（86）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903～906室
法人代表：杨文斌
联系电话：021-58870011
传真电话：021-68596916
联系人员：张茹
客服电话：4007009665
公司网站：www.ehowbuy.com
（87）蚂蚁杭州基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表：陈柏青
联系电话：021- 60897840
传真电话：0571-26697013
联系人员：张裕
客服电话：4000766123
公司网站：www.fund123.cn
（88）上海长量基金销售投资顾问有限公司
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555号裕景国际B座16层
法人代表：张跃伟
联系电话：021-58788678 -8201,13585790204
传真电话：021—58787698
联系人员：沈雯斌
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com
（89）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表：凌顺平
联系电话：0571-88911818
传真电话：0571-86800423
联系人员：吴强
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com
（90）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法人代表：闫振杰
联系电话：010-62020088
传真电话：010-62020088
联系人员：宋丽冉
客服电话：4008886661
公司网站：www.myfund.com
（91）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5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法人代表：沈继伟
联系电话：021-50583533
传真电话：021-50583633
联系人员：曹怡晨
客服电话：400-067-6266
公司网站：http://a.leadfund.com.cn
（92）中期资产管理有限公司
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：路瑶
联系电话：010-59539718
传真电话：010-59539701
联系人员：侯英建
客服电话：95162,4008888160
公司网站：www.cifcofund.com
（93）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8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表：赵学军
联系电话：021-20289890
传真电话：021-20280110
联系人员：张倩
客服电话：400-021-8850
公司网站：www.harvestwm.cn
（94）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法人代表：梁蓉
联系电话：010-66154828
传真电话：010-88067526
联系人员：张旭
客服电话：400-6262-818
公司网站：www.5irich.com
（95）宜信普泽投资顾问北京有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法人代表：沈伟桦
联系电话：010-52855713
传真电话：010-85894285
联系人员：程刚
客服电话：400-609-9200
公司网站：www.yixinfund.com
（96）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：钱燕飞
联系电话：025-66996699-887226
传真电话：025-66996699
联系人员：王锋
客服电话：95177
公司网站：www.snjijin.com
（97）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11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法人代表：王伟刚
联系电话：010-56282140
传真电话：010-62680827
联系人员：丁向坤
客服电话：400-619-9059
公司网站：www.hcjijin.com
（98）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼
办公地址：上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1108室
法人代表：申健
联系电话：021-20219188
传真电话：021-20219923
联系人员：印强明客服电话：021-20292031
公司网站：https://8.gw.com.cn/
（99）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室、海淀北二街10号秦鹏大厦12层
法人代表：张琪
联系电话：010-62675369
传真电话：010-62675979
联系人员：付文红
客服电话：010-62675369
公司网站：www.xincai.com
（100）北京君德汇富投资咨询有限公司
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：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法人代表：李振
联系电话：010-65181028
传真电话：010-65174782/65231189
联系人员：魏尧
客服电话：400-057-8855
公司网站：www.kstreasure.com
（101）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40层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：杨健
联系电话：010-65309516
传真电话：010-65330699
联系人员：李海燕
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
（102）上海万得投资顾问有限公司
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
联系电话：021-51327185
传真电话：021-50710161
联系人员：姜吉灵
客服电话：400-821-0203
公司网站：
（103）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3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法人代表：燕斌
联系电话：021-52822063
传真电话：021-52975270
联系人员：凌秋艳
客服电话：400-046-6788
公司网站：www.66zichan.com
（104）上海基煜基金销售有限公司
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 上海泰和经济发展区-
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法人代表：王翔
联系电话：021-65370077
传真电话：021-55085991
联系人员：蓝杰
客服电话：400-820-5369
公司网站：www.jiyufund.com.cn
（105）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法人代表：陈继武
联系电话：021-63333319
传真电话：021-63332523
联系人员：李晓明
客服电话：4000-178-000
公司网站：www.lingxianfund.com
（106）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：鲍东华
联系电话：021-20665952
传真电话：021-22066653
联系人员：宁博宇
客服电话：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
（107）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105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：肖雯
联系电话：020-89629099
传真电话：020-89629011
联系人员：黄敏娥
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
（108）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：北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法人代表：彭运年
联系电话：010-59336529
传真电话：010-59336510
联系人员：陈珍珍
客服电话：400-8909-998
公司网站：www.jnlc.com
（109）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街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：江卉
联系电话：010-89189291
传真电话：010-89188000
联系人员：徐伯宇
客服电话：95118
公司网站：http://fund.jd.com/
（110）深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼18号东方科技大厦18F
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼18号东方科技大厦18F
法人代表：赖任军
联系电话：0755-66892301
传真电话：0755-66892399
联系人员：张烨
客服电话：400-9500-888
公司网站：www.jfzinv.com
（111）北京蛋卷基金销售有限公司
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2507
法人代表：钟斐斐
联系电话：010-61840688
传真电话：010-61840699
联系人员：戚晓强
客服电话：4000618518
公司网站：danjuanapp.com
（112）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：李一梅
联系电话：010-88066632
传真电话：010-88066552
联系人员：仲秋月
客服电话：400-817-5666
公司网站：www.amcfortune.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，并及时公告。

二、基金登记机构

名称：富国基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
法定代表人：薛爱东
成立日期：1999年4月13日
电话：（021）20361818
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：通力律师事务所
住所：上海市银城中路68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：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安冬
经办律师：秦悦民、安冬

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼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50楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

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指数组合管理与风险控制，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 基金投资方向

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的股票、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的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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。

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

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数。沪深300指数是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股市场中代表性强、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指数被停止编制及发布，或沪深300指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维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，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人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基准权重为基础，利用富国定量投资模型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同时力求超越指数。

富国研发的定量投资模型借鉴国际一流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化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，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)。

这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。富国多因子alpha模型利用富国长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

（2）风险估测模型——有效控制风险预算

指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。

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，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使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%，年化跟踪误差不超过7.75%。

（3）交易成本模型——控制成本并保护业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，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负业绩影响。

（4）投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以成分股为主，并包括非成分股中与成分股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。

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所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数公司原则上每半年审核一次沪深300指数成份股。本基金将按照沪深300指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

（2）不定期调整

根据指数编制规则，当沪深300指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

调整期间原则上定为：中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。由于受到各项投资禁止行为以及持股比例等限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时也需要寻求替代。

4、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。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、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，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，从而更好地实现本基金的投资目标。

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＋1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

沪深300指数是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股市场中代表性强、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忠实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，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 基金的风险收益特征

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、债券型基金与货币市场基金。

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	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,016,068,247.96	92.69
	其中：股票	2,016,068,247.96	92.69
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	8,100,000.00	0.37
	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	147,658,690.20	6.79
7	其他资产	3,276,728.27	0.15
8	合计	2,175,103,666.43	100.00

二、报告期末积极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	-	-
B	采矿业	285,045.60	0.01
C	制造业	236,547,268.21	10.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	73,555.60	0.00
F	批发和零售业	26,462,607.14	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	170,463.90	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,203,337.23	1.77
J	金融业	32,418,243.68	1.50
K	房地产业	20,298,942.20	0.94
L	租赁和商务服务业	4,713,184.72	0.22
M	科学研究和技术服务业	93,718.14	0.00
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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	13,687,759.34	0.63
S	综合	-	-
	合计	373,100,519.19	17.28

三、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	-	-
B	采矿业	68,390,498.00	3.17
C	制造业	622,383,282.73	28.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,406,411.00	1.73
E	建筑业	22,922,245.54	1.06
F	批发和零售业	66,182,685.14	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	49,613,205.00	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,688,657.93	0.73
J	金融业	649,544,022.93	30.09
K	房地产业	58,134,917.50	2.69
L	租赁和商务服务业	25,832,564.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,869,239.00	1.24
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	1,642,967,728.77	76.10

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）报告期末指数投资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	2,434,871.00	131,872,613.36	6.11
2	600016	民生银行	7,672,100.00	61,530,242.00	2.85
3	600519	贵州茅台	114,000.00	59,010,960.00	2.73
4	601328	交通银行	9,314,100.00	58,865,112.00	2.73
5	601288	农业银行	14,242,861.00	54,407,729.02	2.52
6	600030	中信证券	2,688,279.00	48,899,795.01	2.26
7	600887	伊利股份	1,725,279.00	47,445,172.50	2.20
8	601211	国泰君安	2,004,800.00	43,363,824.00	2.01
9	000651	格力电器	1,086,289.00	41,170,353.10	1.91
10	601818	光大银行	9,257,300.00	37,492,065.00	1.74

（二）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600438	通威股份	3,035,100.00	28,620,993.00	1.33
2	600801	华新水泥	1,492,200.00	21,532,446.00	1.00
3	600643	爱建集团	1,504,400.00	21,031,512.00	0.97
4	600308	华泰股份	2,742,300.00	20,704,365.00	0.96
5	600325	华发股份	2,646,500.00	20,298,655.00	0.94

五、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

九、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

注：本基金本报告期末未持有权证。

十、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

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

（二）本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

十一、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（一）本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

（二）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	-
国债期货投资本期收益（元）	-
国债期货投资本期公允价值变动（元）	-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

（三）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

十二、投资组合报告附注

（一）申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中信证券”的发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年5月24日公告称公司收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57号），因公司存在未按照规定与客户签订业务合同的行为，中国证监会拟决定对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款的行政处罚。

中信证券为本基金跟踪标的指数成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期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）申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

（三）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	479,598.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,719.70
5	应收申购款	2,770,409.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	3,276,728.27

（四）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（五）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1、期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

2、期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

（六）投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

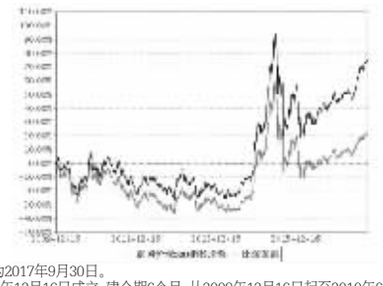
第十二部分 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009.12.16-2009.12.31	4.50%	0.78%	-0.13%	1.71%	4.63%	-0.93%
2010.01.01-2010.12.31	-9.00%	1.54%	-10.47%	1.50%	1.47%	0.04%
2011.01.01-2011.12.31	-17.67%	1.25%	-22.70%	1.23%	5.03%	0.02%
2012.01.01-2012.12.31	12.64%	1.24%	8.89%	1.22%	3.75%	0.02%
2013.01.01-2013.12.31	-8.50%	1.30%	-5.77%	1.32%	-2.73%	-0.02%
2014.01.01-2014.12.31	55.39%	1.15%	50.90%	1.15%	4.49%	0.00%
2015.01.01-2015.12.31	20.89%	2.29%	7.28%	2.36%	13.61%	-0.07%
2016.01.01-2016.12.31	-5.01%	1.33%	-9.29%	1.33%	4.28%	0.00%
2017.01.01-2017.09.30	21.32%	0.56%	16.36%	0.55%	4.96%	0.01%
2009.12.16-2017.09.30	74.70%	1.42%	21.19%	1.43%	53.52%	-0.01%

二、 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2017年9月30日。

2、本基金于2009年12月16日成立，建仓期6个月，从2009年12月16日起至2010年6月15日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

第十三部分 费用概览

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、与基金使用相关指数有关的费用；
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.18%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金指数使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的0.016%年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

H=E×0.016%/当年天数（H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值）

如果基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用基点费的下限，则该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。

上述一、基金费用的种类