(上接B087版)

传真:010-59200800
网址:www.datangwealth.com
客服电话:400—819—9858
(82)天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
联系人:郭宝亮
电话:010-59287984
传真:010-59287825
客服电话:400-111-0889
(83)中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号
法定代表人:徐福星
联系人:徐娜
电话:010-68292940
传真:010-68292941
客服电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com
(84)凤凰金信（银川）投资管理有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院18号楼
法定代表人:程刚
联系人:张旭
电话:010-58160168
客服电话:400-810-5919
网址:www.fengfd.com
(85)扬州国信嘉利投资理财有限公司
注册地址:广陵产业园创业路7号
办公地址:江苏省扬州市文昌西路56号公元国际320
法定代表人:王浩
联系人:燕斌
电话:021-52822063-8301
传真:021-62990063
客服电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com
(87)泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
网址:www.taichengcaifu.com
客服电话:400-6411-999
(88)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100号19层
办公地址: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:冯修敏
联系人:周丹
电话:021-33323999
传真:021-33323830
客服电话:400-820-2819
网址:www.fund.bundtrade.com
(89)北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
法定代表人:梁洪军
联系人:季长军
电话:010-52609656
传真:010-51957430
网址:http://www.buyforyou.com.cn/
客服电话:400-819-6665
(90)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
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(91)深圳前海京西票号基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场B座211室
法定代表人:吴永宏
联系人:盖润英
电话:0755-66607751
网址:http://a24111747.atobo.com.cn
(92)上海中正达广投资管理有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
电话:021-33768132
客服电话:400-6767-523
网址:www.zzwealth.cn
(93)深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:刘昊
电话:0755-83999907
传真:0755-83999926
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn
(94)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:孔繁
电话:027-87006009
网址:http://www.buyfunds.cn
客服电话:400-027-9899
(95)上海陆金所基金销售有限公司
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
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(96)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺市江东中路359号
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人:何庭宇
电话:13917225742
传真:021-22268089
客服电话:021-22267995/400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(97)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
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
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629021
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(98)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
法定代表人:李淑慧
联系人:方良治
电话:0371-55213196
客服电话:400-055-5671
网址:http://www.hgccpb.com
(99)奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸城大厦1115、1116及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(100)京东金融-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:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:陈超
联系人:赵德赛
电话:4000888816
客服电话:95118
网址:http://fund.jd.com
(101)上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人:戴新装
联系人:江辉
电话:021-20530224
传真:021-20538999
客服电话:400-820-1515
网址:www.zhengtongfunds.com
(102)深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人:陈姚坚
联系人:陈姿儒
网址:www.jfzinv.com
电话:4009500888
(103)深圳市华融金融服务有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道滨河路5022号联合广场A座裙楼A302
办公地址:深圳福田区联合广场A座裙楼A302
法定代表人:喻天柱
联系人:万力
电话:0755-83190388
传真:0755-82945664
网址:www.hrijin.com
客服电话:400-600-0583
(104)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法人代表:高锋
联系人:廖苑兰
联系电话:0755-83655588
网址:www.keynesasset.com
客服电话:400-804-8688
(105)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
办公地址:北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
网址:www.amcfortune.com
客服电话:400-817-5666
(106)中国平安人寿保险股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心14、15、16、37、41、44、45、46层
办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心14、15、16、37、41、44、45、46层
法定代表人:丁新民
联系人:张露
电话:021-38635631
传真:021-50475630
客服电话:95511转1
网址:http://life.pingan.com/
(107)中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:韩钰
电话:010-6083 3754
传真:010-5776 2999
客服电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
（108）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222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:臧晓强
客服电话:400-061-8518
网址:https://danjuanapp.com
（109）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
法定代表人:钱燕飞
联系人:赵邸
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
（110）深圳信诚基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋210室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
联系人:杨涛
客服电话:0755-23946579
网址:www.ecpefund.com
（111）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5层01、02、03室
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:胡燕亮
网址:www.wacaijijin.com
客服电话:021-50810687
(112)海银基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com
(113)华瑞保险销售有限公司
注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
法定代表人:路昊
联系人:邿勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:400-111-5818
网址:www.huaruisales.com
(114)通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路677弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
联系人:杨徐霆
电话:021-60818249
客服电话:95156
(115)中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号17层05单元
法定代表人:珥洪军
联系人:黄鹏
电话:021-33355333
传真:021-63353736
客服电话:400-876-5716
网址:www.cmiwm.com
(116)上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址:中国上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
联系人:宋楠
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn
（117）万和证券股份有限公司
注册地址:海口市南沙路49号通信广场二楼
办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
法定代表人:朱冶理
联系人:郭东彤
电话:0755-82830333-115
传真:0755-25170807
客服电话:400-888-2882
网址:www.wanhesec.com
（118）弘业期货股份有限公司
注册地址:南京市中华路50号
办公地址:南京市中华路50号
法定代表人:周剑秋
联系人:郭晓蓉
电话:025-68509525
传真:025-52313068
客服电话:400－828－1288
网址:http://www.ftol.com.cn/etrading/
(119)世纪证券有限责任公司
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
邮政编码:518000
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:4008-323-000
网址:www.csco.com.cn
(120)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
邮政编码:230081
法定代表人:李工
联系人:范超
客服电话:95318
网址:www.hazq.com
(121)民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
联系人:杨一新
电话:021-50206003
传真:021-50206001
客服电话:021-50206003
公司网站http://www.msftec.com
（122）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:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336500
客服电话:4008909998
网址:www.jnlc.com
（123）江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人:吴言林
电话:025-66046166转837
传真:025-56663409
联系人:孙平
客户服务热线:025-66046166
网址:www.huilinbd.com
（124）上海万得基金销售有限公司
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
法定代表人:王廷富
网址:www.520fund.com.cn
客服电话:400-821-0203
（125）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
邮政编码:330000
法定代表人:徐丽峰
联系人:占文驰
电话:0791-86283372
传真:0791-86281305
（126）上海陆享基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路888号1幢1区14032室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇广场二座16层
法定代表人:陈志英
联系人:唐京莎
电话:021-53398816
网址:http://www.luxxfund.com/
（127）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
法定代表人:陈继武
联系人:高浩辉
联系电话:021-63333389
客服电话:400 643 3389
网址:https://www.vstonewealth.com/
（128）北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
联系人:牛亚楠
联系电话:18610807009
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimubox.com
（二）注册登记机构
名称:平安基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
（三）出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:北京市京伦律师事务所
地址:北京市海淀区中关村南大街17号韦伯时代中心C座1910
负责人:曹斌（执业证号:11101200110651368）
电话:010-68938188
传真:010-88578761
经办律师:杨晓勇（执业证号:11101200210185600）
王月贤（执业证号:11101201011310452）
联系人:杨晓勇（执业证号:11101200210185600）
（四）审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:（021）2323 8888
传真电话:（021）2323 8800
经办注册会计师:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

四、基金的名称

平安深证300指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制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不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。

（二）投资范围

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，其中投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金的大类资产由股票资产和非股票资产构成。其中股票资产中绝大部分股票组合为全复制深证300指数的成份股及其备选成份股组合，非股票组合绝大部分由现金以及到期日在一年以内的政府债券的组成，主要用于支付赎回款、支付增发或配股款项，支付交易费用、管理费和托管费等。

本基金为增强型指数基金，股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，其中投资于深证300指数成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。在基金运作过程中，为尽量减少跟踪误差，基金管理人将在法律法规和基金合同规定的范围内，根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判，尽可能降低现金组合所占比重，防止因现金比例增加而导致跟踪误差的加大。

2、股票投资策略

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。

（1）指数复制策略

本基金将采用全样本复制的方式，即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现，具体包括：跟踪组合的构建和日常管理中的调整。

1）跟踪组合的构建

基金管理人将根据深圳证券信息有限公司提供的成份股及权重数据进行相应的买入或卖出操作，使跟踪组合的构成与标的指数基本一致。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股流动性不足、深证市场整体流动性不足等），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。

①单一或部分权重较大成份股流动性不足：若单一或部分权重较大的成份股流动性不足而无法有效交易时，基金管理人可以采用特征较为相近的股票或股票组合等方式进行部分或全部替代。对替代股票的选择一般需综合考虑备选股票和被替代股票在行业所属、基本面、股价相关性和贝塔特性近似程度等方面；在单个股票无法完全符合替代要求的情况下，基金管理人可以构建流动性好且属性相近的股票组合，并通过权重的调整获得与被替代股票相似的股价相关性和贝塔特性。

②较多成份股流动性不足或流动性不足成份股累计权重较大：在深证市场整体流动性偏弱，或较多成份股出现流动性不足的情况下，基金管理人可以采用分层优化的方法替代全样本复制进行跟踪组合构建，分层优化复制方式将综合考虑权重分布和行业分类等因素。通过分层优化，基金管理人可以用较少的流动性好的股票组合近似拟合标的指数组合，较少因流动性风险带来的额外交易成本和跟踪误差。

此外，对于因股票在实际投资中各种操作限制造成无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人将以减少跟踪误差为目标采取及时合理的方法进行组合优化。

2）跟踪组合的调整

本基金为开放式基金，由于基金开放日基金的申购、赎回、转换业务、标的指数成份股定期或不定期的调整、成份股权重调整、成份股投资受限等因素的影响，使得跟踪组合需要适时进行个股或权重的调整。

根据调整周期，具体分为定期调整和不定期调整：

①定期调整

深证300指数成份股的定期调整定于每年1月和7月的第一个交易日实施，通常在前一年的12月和当年的6月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案。在指数定期调整方案公布之后，基金管理人将根据调整后的成份股及权重状况，及时对现有组合的构成进行相应的调整。为减少成份股的集中调整短期内对调入或调出股票股价影响，基金管理人可以采用逐步渐进的调整方式，即在调整方案公布后至正式记入指数前，根据对市场趋势的判断将成份股调整分步推进。

②不定期调整

■标的指数相关的调整

由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、新股上市、临时调入及调出成份股等）的原因，基金管理人需要及时根据其调整方案对跟踪组合进行相应的调整。

■应对日常业务的调整

申购、赎回、转换等业务会需要基金保留一定比例现金并造成基金现金比例变化，尤其是在出现较大规模的申购、赎回、转换等业务的时，会造成基金资产现金比例大幅度变化，从而使得跟踪误差在短期内可能会加大。基金管理人将综合考虑市场趋势、基金持有人盈亏比例、历史现金流表现等因素预判应对申购、赎回、转换等业务所需现金流，尽可能将现金比例维持在较低水平。

■应对投资限制的调整

根据相关法律法规和基金合同的有关投资限制的规定，本基金在构建跟踪组合时应尽量避免超越相关限定性规定。若因全样本复制标的指数组合而导致出现突破投资限制的情况，则必须在规定的时间之内进行调整，以保证跟踪组合符合法律法规和基金合同的要求。

■应对禁止投资的调整

标的指数的部分成份股由于法律法规的限制无法作为本基金的投资标的，或因涨跌停、停牌等原因导致本基金无法按指数成份股要求进行投资。在这些情况下，本基金将采用相同行业属性、基本面特征相似、股价相关性和贝塔特性近似程度高的股票或构建流动性好且属性相近的股票组合进行投资。

■其他调整

在基金的实际运作过程中，因除上述原因导致的必须对当前的跟踪组合进行调整时，基金管理人可以根据实际情况，以减少跟踪误差为目标进行相应的临时调整。

（2）股票增强策略

本基金在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上，辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资，以求获取超越标的指数的收益率表现。

1）基于成份股基本面分析的增强

鉴于中国股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析，剔除或低配部分标的指数成份股，以达到增强组合收益的效果。

具体而言，主要考虑以下因素：

①上市公司基本面状况差、缺乏或正在丧失核心竞争优势、盈利增长能力弱和持续性差等；

②当前股价与中长期估值水平相比处在历史高位，或在可比公司中，股票相对估值水平偏高，并缺乏业绩支持；

③其他重大情况。例如面临重大的不利行政处罚或司法诉讼的个股、有充分而合理的理由认为其市场价格被操作的个股等。

为尽量减少跟踪误差，并达到基金投资比例的要求，本基金将对上述被剔除或低配的个股进行替换，该替换策略将遵循指数复制策略当中的替换原则。

2）基于非成份股投资机会的增强

本基金所跟踪的目标指数为深证300指数，该指数涵盖深圳主板、中小板和创业板三个市场。因此，本基金将基于公司对证券市场个股和新股（含首次公开发行和增发）深入研究的基础上，精选出具有综合性比较优势的个股，在基金投资比例允许的范围内适度参与非成份股和新股投资。

①非成份股精选策略

在控制风险水平和跟踪误差的前提下，为达到或超越标的指数收益的目的，在个股选择中将采用GARP选股策略精选股票进行投资。重点关注以下指标：

■成长速度：重点选择营业收入和营业利润在行业中未来将保持相对领先增长速度的公司。

■成长空间：通过分析公司所处的行业前景，行业集中度和在行业中的地位，选择服务和产品未来具备广阔成长空间的公司。

■成长模式：通过对公司的竞争壁垒、内部管理能力、行业属性等进行定性分析，选择业绩增长具有合理基础，在未来能够持续的公司。

■成长估值：重点关注PEG（1或低于行业平均水平的公司。

②一级市场股票投资

在对相关发行主体的基本面因素进行认真研究的基础上，结合二级市场的平均估值水平、类似券种上市之后的平均溢价率等指标，本基金将有选择性地参与一级市场股票投资，或基本面较好、股价被低估的增发或配股，以在不增加额外风险的前提下提高基金资产收益水平。

3、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

4、债券投资策略

本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在控制流动性风险的基础上，构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。基金管理人将优先选择信用等级较高、剩余期限较短、流动性较好的政府债券进行投资，合理分配基金资产在债券上的配置比例。

5、现金头寸管理

由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其主要用途包括：支付潜在赎回金额、计提管理费和托管费等各类费用的需求、支付交易费用、应对上市公司配股和增发等行为。为有效控制现金留存的影响，基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段。具体采用手段包括：

1）合理控制现金头寸：根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判，结合标的指数走势和成份股流动性进行合理的现金留存，最大限度降低现金的持有比例；

2）提升现金头寸收益：在法律法规或市场条件允许的前提下，通过现金权益化的方式降低现金拖累的影响。

6、跟踪误差控制与管理

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争控制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不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。每日对基金组合与业绩比较基准的收益率偏离度进行跟踪，每月末、季度末定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因，并根据跟踪误差的来源和其可控制性，有针对性的进行管理和控制。

年跟踪误差=[illegible]，其中：

跟踪偏离度r_i=第i日基金份额净值收益率-第i日业绩比较基准收益率

日均跟踪偏离度[illegible]，n为考察的天数

K为一年的实际交易天数

7、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

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、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（四）投资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）投资研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，结合投资研究部对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订所辖基金的具体投资计划，包括：资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由集中交易室执行。

（6）集中交易室按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险管理委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

本基金采用深证300指数和商业银行活期存款利率（税后）作为业绩比较基准主要基于以下原因：

本基金以深证300指数作为跟踪标的，但由于相关法规的要求，本基金股票投资的最高比例被设定为95%，因此在业绩比较基准中深证300指数的比例被设定为95%，剩余5%的业绩比较基准则采用商业银行活期存款利率（税后），以反映在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后不少于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券投资。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，在履行必要手续后，基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

（六）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（八）其他

1、投资理念

本基金采用全样本复制的方式进行指数化投资，并结合相对增强投资策略，以达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的深证300指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。

2、标的指数

本基金的标的指数是深证300指数。

深证300指数于2009年11月4日发布，对深圳A股初步筛选后的样本股，根据平均流通市值及平均成交金额进行综合排名，选取排名靠前300只股票组成样本。深证300指数的300只成份股涵盖了深圳主板、中小板和创业板三个市场，总流通市值占全部深圳证券市场的70%左右，是目前唯一覆盖深圳证券市场三个市场层次的规模指数。

若出现因深证300指数被停止编制并发布、被其他指数替代（单纯更名除外）或指数编制方法等出现重大变更等原因导致深证300指数不宜继续作为标的指数的情形，或法律法规或监管机构对证券投资基金股票投资比例限定的规定进行调整，则基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益的前提下，变更基金的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数，不需召开基金份额持有人大会通过，但应及时通知本基金托管人并报中国证监会，并在履行必要手续后，在中国证监会指定的媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

3、投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（2）本基金与基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；

（3）基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分不受前述比例限制；

（4）本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%；

（5）本基金投资于深证300指数成份股的资产占基金资产的比例不低于80%；

（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（11）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（12）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

（13）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（14）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（15）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（16）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货交易账户开立、清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

4、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（16）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

5、基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

（九）基金投资组合报告

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2019年3月31日，本财务数据未经审计。

1.1 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	71,309,907.15	93.41
	其中:股票	71,309,907.15	93