

(上接 C7 版)

联系电话:010-63081000
客户服务热线:400-800-8899
网址:www.cindae.com
09 东兴证券
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤海川
联系电话:010-66555316
客户服务热线:400-8888-993
传真:010-66555246
网址:www.dxzq.net.cn
80 华龙证券
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李新田
联系电话:0931-4890208
客户服务热线:0931-4890100、4890619、4890618、4890828
传真:0931-4890118
网址:www.hlzq.com
81 瑞银证券
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
法定代表人:刘泓
联系人:邱晓玲
联系电话:010-58328366
客户服务热线:400-887-8827
传真:010-59228748
网址:www.asiasecurities.com
82 汇山证券
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:李珍
客户服务热线:4001022011
网址:www.hszq.com.cn
83 厦门证券
注册地址:厦门市莲前西路2号鑫富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号鑫富大厦十七楼
法定代表人:傅献明
联系人:卢金文
联系电话:0592-5161642
客户服务热线:0592-5163588
传真:0592-5161140
网址:www.xmzq.cn
C 基金注册登记机构
名称:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市香洲区横琴路428号九洲港大厦4001室
办公地址:广州市体育西路189号城建大厦25.26.27.28楼
法定代表人:梁寒
电话:4008818088
传真:020-38799249
联系人:余霞高
C 律师事务和经办律师
名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
负责人:王立华
联系电话:010 88092188
传真:010 88092150
联系人:宋蔚明
经办律师:陈华、宋娟娟
四 会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号延展大厦6楼
办公地址:上海市湖南路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨劲松
联系电话:021 32338888
传真:021 32338800
联系人:金锐
经办会计师:薛竞、金毅
四、基金的投资
本基金名称:易方达沪深300指数证券投资基金
五、基金的投资目标
本基金类型:契约型开放式
六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
七、基金的投资范围
1. 股票投资:具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数成份股及备选成份股、新股(一级市场和次发行增发)、债券、债券回购以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将资产纳入投资范围。
八、基金的投资策略
1. 资产配置策略
本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。
2. 股票投资策略
本基金主要采用完全复制法进行投资,即按照沪深300指数的成份股组成及权重构建投资组合,但是当以下情况发生时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪:① 基金管理人预期标的指数的成份股发生重大变化;② 由于市场因素影响,法律法规限制等原因,本基金无法根据指数成份股组成;③ 基金发生申购赎回,或成份股发生股息等可能影响跟踪效果的情形。
待指数衍生品金融产品推出以后,基金管理人将在履行适当程序后,可以采用衍生品产品进一步降低跟踪误差。
在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将对投资组合进行调整,以降低跟踪误差,实现对业绩比较基准的紧密跟踪:
① 指数成份股发生变更,基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股权重变化的影响,适时进行投资组合调整;
② 指数成份股发生流动性不足、增发、配股、派发现金股息等情形,基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响,在确保不降低跟踪误差的前提下,进行投资组合调整。
③ 沪深300指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形,基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响,在确保不降低跟踪误差的前提下,进行投资组合调整。
(上接 C7 版)

05 鼎晖证券
注册地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
办公地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
法定代表人:马金声
联系人:孙旭
联系电话:010-83561149
客户服务热线:400-698-9898
开放式基金业务传真:010-83561094
网址:www.sdzq.cn
06 瑞福证券
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7及8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7及10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张帆
联系电话:0591-87383623
客户服务热线:0591-96326
传真:0591-87383610
网址:www.mqzq.com.cn
07 红塔证券
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
网址:www.hongtastock.com
08 信达证券
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:赵志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
客户服务热线:400-800-8899
传真:010-63080978
网址:www.cindae.com
09 东兴证券
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤海川
联系电话:010-66555316
客户服务热线:400-8888-993
传真:010-66555246
网址:www.dxzq.net.cn
80 华龙证券
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李新田
联系电话:0931-4890208
客户服务热线:0931-4890100、4890619、4890618、4890828
传真:0931-4890118
网址:www.hlzq.com
81 瑞银证券
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
法定代表人:刘泓
联系人:邱晓玲
联系电话:010-58328366
客户服务热线:400-887-8827
传真:010-59228748
网址:www.asiasecurities.com
82 汇山证券
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:李珍
客户服务热线:4001022011
网址:www.hszq.com.cn
83 厦门证券
注册地址:厦门市莲前西路2号鑫富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号鑫富大厦十七楼
法定代表人:傅献明
联系人:卢金文
联系电话:0592-5161642
客户服务热线:0592-5163588
传真:0592-5161140
网址:www.xmzq.cn
C 注册登记机构
名称:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市香洲区横琴路428号九洲港大厦4001室
办公地址:广州市体育西路189号城建大厦25.26.27.28楼
法定代表人:梁寒
电话:400 881 8088
传真:020-38799249
联系人:余霞高
C 律师事务和经办律师
名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
负责人:王立华
电话:010-88092188
传真:010-88092150
经办律师:王新康、高亮国
联系人:杨科
四 会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东座经緯城安永大厦 四座三办公楼 16 层
法定代表人:葛明
电话:010-58153000
传真:010-58158298
经办会计师:王新康、唐海霞

[illegible]

C99	其他制造业		14,204,094.85	0.17	
D	电力、煤气及水的生产和供应业		174,761,452.19	2.06	
E	建筑业		120,220,320.89	2.95	
F	交通运输、仓储业		285,690,584.17	3.37	
G	信息技术业		253,677,377.79	2.99	
H	批发和零售贸易		218,814,382.00	2.58	
I	金融、保险业		2,305,208,870.71	26.01	
J	房地产业		378,268,223.93	4.46	
K	社会服务业		67,315,875.65	0.79	
L	传播与文化产业		9,149,845.56	0.11	
M	综合类		166,245,713.93	1.96	
	合计		7,773,675,826.65	91.69	
3.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					
□ 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)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	4,728,446	228,242,088.42	2.69
2	600036	招商银行	17,452,357	227,229,688.14	2.68
3	600016	民生银行	31,877,588	182,658,579.24	2.15
4	601398	工商银行	36,599,105	163,232,008.30	1.93
5	601328	交通银行	29,396,023	162,853,967.42	1.92
6	600000	浦发银行	15,795,197	155,424,738.48	1.83
7	600030	中信证券	11,232,660	146,923,192.80	1.73
8	601166	兴业银行	10,655,859	143,640,979.32	1.69
9	601088	中国神华	4,654,726	140,230,441.64	1.65
10	600837	南通证券	13,669,603	123,299,819.06	1.45
□ 期末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	002073	软控股份	1,048,383	21,596,689.80	0.26
2	002106	宝豪高科	508,780	15,390,595.00	0.18
3	000869	张裕A	147,757	14,598,391.60	0.17
4	600859	王府井	353,802	14,141,465.94	0.17
5	600267	海正药业	370,522	13,835,291.48	0.16
4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合					
序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)		
1	国债债券	-	-		
2	央行票据	367,225,000.00	4.33		
3	金融债券	-	-		
4	其中:政策性金融债	-	-		
5	企业债券	-	-		
6	企业短期融资券	-	-		
7	中期票据	-	-		
8	可转债	31,944,091.50	0.38		
9	其他	-	-		
10	合计	399,169,091.50	4.71		
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债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	1101023	11央行票据23	3,700,000	367,225,000.00	4.33
2	110015	石化转债	296,190	31,944,091.50	0.38
注:本报告期末本基金仅持有以上债券。					
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十名资产支持证券投资明细					
本报告期末本基金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权证投资明细					
本报告期末本基金未持有权证。					
8.投资组合报告附注					
a. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
b. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
c. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
d. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
e. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
f. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
g. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
h. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
i. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
j. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
k. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
l. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
m. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					
n. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。					

[illegible]