

(上接B79版)
客户服务电话:400-600-8008
网址:www.howcc.com
04 上海证券投资有限公司
住所:北京市西城区金融大街9号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:李敬
电话:010 85660235
传真:010 85668002
联系人:董旭
客户服务电话:010 85661118
网址:www.howcc.com
05 朴信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路卓越时代广场二期 北面13101-1305A、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 北面13101-1305A、14层
法定代表人:高磊
电话:0755 82959131
传真:0755 83217421
联系人:洪斌
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicof.com
06 沃拓期货投资有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林文彬
电话:010 86045529
传真:010 86045518
联系人:李博
客户服务电话:010 86045678
网址:http://www.wotuo.com.cn
07 联讯证券股份有限公司
住所:惠州市江东北路1号广电金融中心西座一层大堂和三、四座
办公地址:惠州市江东北路1号广电金融中心西座一层大堂三、四座
法定代表人:徐明
电话:021 83360676
联系人:潘磊
客户服务电话:95564
网址:www.lxj.com.cn
08 华信证券投资有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨伟华
电话:028 86135991
传真:028 86150400
联系人:董磊
客户服务电话:95564
网址:www.hx168.com.cn
09 国信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼
法定代表人:陈柏青
电话:0755 28827960、021 60897869
联系人:0755 26669353
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.guosen.com.cn
10 招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦
办公地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦
法定代表人:孙明
电话:0755 83227953
传真:0755 83227951
联系人:潘素娟
客户服务电话:400-708-8887
网址:www.zhaosheng.com.cn
11 上海长量基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区高东路527号2202室
办公地址:上海市浦东新区东陆路555号裕阳国际大厦16层
法定代表人:董承非
电话:021 20691832
传真:021 20691836
联系人:李博
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.shchangliang.com
12 上海好基宝基金销售有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号37楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:周晶
电话:021 88599616
联系人:李博
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.hjw.com.cn
13 北京汇通基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
法定代表人:王喆
电话:021 20835789
传真:021 20835879
联系人:王喆
客户服务电话:4009200022
网址:http://fund.htj.com.cn
15 上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙漕路190号2号楼9层
办公地址:上海市徐汇区龙漕路190号2号楼9层
法定代表人:其实
电话:021 84509988
客户服务电话:400-1818-1188
网址:www.1234567.com.cn
16 北京乾元信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
法定代表人:赵东辉
电话:010 87418829
联系人:魏善文
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.qiyuanfund.com
17 南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市雨花台区软件大道169号1006室
办公地址:南京市雨花台区软件大道169号1006室
法定代表人:陈海
电话:010 88325282
联系人:张冠文
客户服务电话:400-800-7771
网址:www.snjfund.com
18 北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号泛海国际大厦10层
法定代表人:王喆
电话:010 88121297
联系人:王喆
客户服务电话:400-011-1566
网址:http://www.zhenheng.com.cn
20 上海大智慧资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:申捷
电话:021-20211991
传真:021-80203555
联系人:马林
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.wisdom.com.cn
09 一路财富 北京 信息科技股份有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街9号五栋大楼702室
办公地址:北京市西城区阜成门大街9号五栋大楼702室
法定代表人:吴昊
电话:010-88112779
联系人:李奕
客户服务电话:400-011-1566
网址:http://www.yilu.com.cn
60 上海大智慧资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:申捷
电话:021-20211991
传真:021-80203555
联系人:马林
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.wisdom.com.cn
62 信安证券投资顾问(北京)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号4号楼1109号
办公地址:北京市朝阳区建国路88号4号楼1109号
法定代表人:沈博
电话:010-85825713
联系人:沈博
客户服务电话:400-6999-200
网址:www.xianan.com.cn
63 国信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼
法定代表人:李敬
电话:021 86370077
联系人:李博
客户服务电话:4006-11999
网址:www.guosen.com.cn
67 招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦
办公地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦
法定代表人:孙明
电话:0755 83399926
联系人:马博
客户服务电话:0755 83999907-802
网址:www.zhaosheng.com.cn
68 珠海盈富资产管理有限公司
住所:深圳市福田区深南中路1085号4-401
办公地址:广州市海珠区阅江中路保利国际广场二期1201-1202
法定代表人:肖勇
电话:020 89629099
传真:020 89629111

联系人:黄筱娟
客户服务电话:400 89629066
网址:www.zjmg.com.cn
89 上海证券投资有限公司
住所:上海市中山南路100号外滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹梅路180号漕河泾国际大厦7楼
法定代表人:李敬
电话:021 83332999
传真:021 83332837
联系人:陈云齐
客户服务电话:4008212999
客户服务电话:400-990-8826
60 上海陆金所资产管理有限公司
住所: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:李刚
电话:021 20665952
传真:021 22066653
联系人:李博
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.lufund.com
61 北京乐融多源投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路19号1号楼1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路19号1号楼1603室
法定代表人:董承非
电话:010 56580666
传真:010 56580660
联系人:李博
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jinlifund.com
62 上海石富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路760号2-115室
办公地址:上海市黄浦区西藏南路760号2-115室
法定代表人:陈维武
电话:021-63331319
传真:021-63332523
联系人:李刚
客服电话:4000 178 000
网址:www.shifund.com
63 上海利得基金销售有限公司
住所:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:沈婕华
电话:021-50855333
传真:021-50855633
联系人:徐勇
客服电话:400-005-6355
网址:www.lidfund.com
64 兴泰基金投资管理(上海)有限公司
住所:南京东路128号中法大上海国际中心一期4楼41006室
办公地址:上海市长宁区虹桥路386号文广大厦15楼
法定代表人:袁勇明
电话:025 68308448
传真:021 22288089
联系人:何庭宇
客户服务电话:400-226-6221-2267995
网址:www.xintaifund.com
基金管理人可根据有关法律法规的规定,选择其符合要求的机构销售本基金,并及时公告。
C. 基金注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街29号
办公地址:北京市西城区金融大街29号
法定代表人:周明
电话:010 59918177
联系人:程雁
三) 估值和会计核算机构
名称:上海立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1118号东方财富大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1118号东方财富大厦6楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:李丹
电话:021 23238888
联系人:李博
经办注册会计师:薛英、沈兆杰
四、基金的投资目标
本基金投资于具有良好流动性的资产,力争实现基金资产的长期稳定增值。
五、基金的投资策略
本基金整体采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,在控制风险并保障基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
六、基金的投资范围
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具(包括但不限于国债、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具)。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具(包括但不限于国债、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具)。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。
八、基金的投资策略
本基金整体采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,在控制风险并保障基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
九、基金的投资范围
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具(包括但不限于国债、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具)。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。
十、基金的投资方向
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具(包括但不限于国债、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具)。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。本基金还可投资于中国证监会认可的其他金融产品,如股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许投资的金融工具等。

2. 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末持有通过沪港通投资的股票。

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

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	600044	招商公路	97,700	2,356,520.00	6.65
2	600276	恒顺医药	44,700	2,111,181.00	5.96
3	600169	豫园股份	76,500	2,099,160.00	5.92
4	000858	五粮液	57,523	1,616,971.53	4.56
5	000538	云南铜业	25,000	1,532,500.00	4.32
6	601169	北京银行	167,600	1,487,400.00	4.20
7	000687	通化东宝	54,963	1,327,906.08	3.75
8	300161	华信国际	50,800	1,168,400.00	3.30
9	000333	美利纸业	36,800	1,135,280.00	3.20
10	600948	保利地产	121,800	1,130,300.00	3.19

4. 报告期末按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

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
本基金本报告期末持有债券。

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
本基金本报告期末持有资产支持证券。

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
本基金本报告期末持有贵金属。

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
本基金本报告期末持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
Q 1 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
Q 2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,267.01
2	应收证券清算款	149,210.14
3	应收股利	-
4	应收利息	1,441.28
5	应收申购款	38,363.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	213,782.02

Q 3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
Q 4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
Q 5 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有权证。
Q 6 报告期末前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
Q 7 报告期末前十名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
Q 8 报告期末前十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
Q 9 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 10 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 11 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 12 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 13 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 14 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 15 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 16 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 17 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 18 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 19 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 20 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 21 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 22 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 23 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 24 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 25 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 26 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 27 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 28 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 29 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 30 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 31 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 32 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 33 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 34 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 35 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 36 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 37 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 38 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 39 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 40 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 41 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 42 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 43 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 44 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 45 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 46 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 47 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 48 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 49 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 50 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 51 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 52 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 53 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 54 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 55 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 56 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 57 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 58 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 59 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 60 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 61 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 62 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 63 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 64 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 65 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 66 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 67 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 68 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 69 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 70 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 71 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 72 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 73 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 74 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 75 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 76 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 77 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 78 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 79 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 80 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 81 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 82 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 83 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 84 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 85 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 86 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 87 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 88 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 89 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 90 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 91 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 92 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 93 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 94 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 95 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 96 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 97 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 98 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 99 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。
Q 100 报告期末前十名其他资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有其他资产支持证券。

11. 投资组合报告附注

注:本基金投资于2016年6月31日,所附数据未经审计并附注。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金收益,也不保证基金份额净值,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 基金组合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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益与基金净值增长率差	①-③	②-④
过去三个月	-12.72%	2.43%	-9.73%	2.08%	-2.99%
自基金合同生效至2015年12月31日	109.57%	-	-	-	-
自2015年12月31日至2016年5月31日	-1.70%	1.69%	-1.09%	2.26%	-0.66%

注:交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金于2015年7月1日起正式转型为交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金,本系列列示的基金净值表现,转型前为基金的业绩比较基准为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,转型后为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率变更为 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,下同,详见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金变更并修改基金合同相关内容公告》。

Q 1 交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益与基金净值增长率差	①-③	②-④
2015年11月30日至2016年6月30日	34.70%	2.16%	42.28%	2.16%	-7.58%
2016年度	35.56%	1.07%	37.19%	1.09%	-1.63%
2014年度	1.52%	1.29%	1.33%	1.26%	0.09%
2013年度	基金资产净值发生日起	9.60%	1.21%	4.67%	1.33%
截至2013年12月31日	-	-	-	4.93%	-0.12%

注:交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金于2015年7月1日起正式转型为交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金,本系列列示的基金净值表现,转型前为基金的业绩比较基准为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,转型后为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率变更为 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,下同,详见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金变更并修改基金合同相关内容公告》。

Q 2 交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金



注:本基金投资于2016年6月31日,所附数据未经审计并附注。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金收益,也不保证基金份额净值,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 基金组合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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益与基金净值增长率差	①-③	②-④
过去三个月	-12.72%	2.43%	-9.73%	2.08%	-2.99%
自基金合同生效至2015年12月31日	109.57%	-	-	-	-
自2015年12月31日至2016年5月31日	-1.70%	1.69%	-1.09%	2.26%	-0.66%

注:交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金于2015年7月1日起正式转型为交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金,本系列列示的基金净值表现,转型前为基金的业绩比较基准为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,转型后为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率变更为 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,下同,详见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金变更并修改基金合同相关内容公告》。

Q 1 交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益与基金净值增长率差	①-③	②-④
2015年11月30日至2016年6月30日	34.70%	2.16%	42.28%	2.16%	-7.58%
2016年度	35.56%	1.07%	37.19%	1.09%	-1.63%
2014年度	1.52%	1.29%	1.33%	1.26%	0.09%
2013年度	基金资产净值发生日起	9.60%	1.21%	4.67%	1.33%
截至2013年12月31日	-	-	-	4.93%	-0.12%

注:交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金于2015年7月1日起正式转型为交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金,本系列列示的基金净值表现,转型前为基金的业绩比较基准为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,转型后为85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率变更为 85%*中证沪深300指数收益率+15%*中证红利指数收益率,下同,详见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金变更并修改基金合同相关内容公告》。

Q 2 交银罗福沪深3007分层权益指数证券投资基金



注:本基金投资于2016年6月31日,所附数据未经审计并附注。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金收益,也不保证基金份额净值,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 基金组合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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益与基金净值增长率差	①-③	②-④
过去三个月	-12.72%	2.43%	-9.73%	2.08%	-2.99%
自基金合同生效至2015年12月31日	109.57%	-	-	-	-
自2015年12月					