



Disclosure 信息披露

2018年11月10日 星期六
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B27

（上接B26版）

（限公司）
办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人：高峰
联系电话：0755-83655588
传真号码：0755-83655518
客户服务热线：400-804-8668
公司网址：www.keyuensecurities.com
（57）深圳市金斧子基金销售有限公司
办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋单元11层
法定代表人：赖建军
联系电话：0755-66892301
传真号码：0755-66892399
客户服务电话：400-930-0660
公司网址：www.jfmmv.com
（58）上海天天基金销售有限公司
办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人：其实
联系电话：4001818188
网址：www.1234567.com
（59）江苏常熟农村商业银行股份有限公司
办公地址：江苏省常熟市新世纪大道58号
法定代表人：宋建明
客户服务电话：400926000、0512-962000或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询。
网址：www.crbank.com
（60）北京展翼基金销售有限公司
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
住所：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：钟斐雯
客户服务电话：4000618518
传真：010-61840699
网站：<http://dajianapp.com/>
（61）上海浦东东杨基金销售有限公司
注册地址：上海浦东杨高南路428号11号楼10-11层
办公地址：上海浦东杨高南路428号11号楼10-11层
法定代表人：申健
客服电话：021-20219931
公司网站：<http://www.wg.com.cn>
（62）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区丰盛胡同32号中水大厦215A
办公地址：北京市西城区丰盛胡同32号中水大厦215A
法定代表人：梁喜
联系电话：010-66184828
传真号码：010-88067526
客户服务电话：400-676-2182
公司网站：www.sinc.com
（63）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
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系电话：010-56282140
传真号码：010-62688272
客户服务电话：400-619-9059
公司网站：www.hcjin.com
（64）江苏昆山农村商业银行股份有限公司
注册地址：江苏省昆山市前进东路828号
办公地址：江苏省昆山市前进东路828号
法定代表人：蔡碧清
联系电话：（0512）357579810
传真号码：（0512）35767960
网址：www.tongshangbank.com
（65）北京新浪乐信基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区北四环西路96号K2A0903室
办公地址：北京市海淀区海淀东三街10号1层1108
法定代表人：邢磊
联系电话：010-62675369
传真号码：010-62670516
客户服务电话：010-62675369
公司网址：www.xinxinle.com
（66）嘉兴银行股份有限公司
注册地址：嘉兴市建国南路409号
办公地址：嘉兴市建国南路409号
法定代表人：董兆华
联系电话：0573-96328
传真号码：0573-82099628
客户服务电话：0573-96328
网址：www.jbq.com
（67）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南路700号
法定代表人：陆华裕
客户服务电话：95574
网址：www.nbcb.com.cn
（68）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：喻明
联系电话：025-66996909-884131
传真号码：025-66996909
联系邮箱：15071484@qq.com
客户服务电话：95177
公司网站：www.sujin.com
（69）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：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号8楼
法定代表人：王廷富
联系电话：021-51327185
传真号码：021-68862241
客户服务电话：400-821-0203
（70）天津国融基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南开区工业综合服务区办公楼B座二层2012-12室
办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦19层
法定代表人：丁东华
联系电话：010-59287061
传真号码：010-59287825
公司网站：www.goufund.com
客服电话：400-111-0889
（71）南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人：宋科琳
联系电话：025-86853969
传真号码：025-86853969
客服电话：4007-999-999
网址：<http://gzrui.com>
（72）和融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
联系电话：0371-85518396
传真号码：0371-85518396
客服电话：4000-555-671
网站：<http://www.hgqr.com>
（73）上海鸿湾基金销售有限公司
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：陈新装
联系电话：021-20538888
传真号码：021-20538999
客服电话：4008201515
网址：www.zhengtongfund.com
（74）乾道基金信息服务有限公司（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层717室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
联系电话：010-62062800
传真号码：010-82057741
客服电话：4000880880
网站：<http://www.qiandao.com>
（75）北京懒猫基金销售有限公司
注册地址：江苏省石泉区石坝路31号院盛原国际广场号楼1119
办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河产业园1111号
法定代表人：许良辰
联系电话：4001-500-882
传真号码：010-57649620
（76）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦38层A01、B01（b）单元
法定代表人：俞萍
客服电话：021-20199999
网站：<http://www.cfsc.com.cn>
（77）东方财富证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东方财富大厦 8 楼
法定代表人：陈杰夫
电话：95331/400-8888888
网址：www.qh168.com.cn
（78）上海控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楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼
法定代表人：胡燕飞
联系电话：021-58106677
传真号码：021-58802721
客户服务电话：021-50816733
网址：www.wacapp.com
（79）济安财富（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市东城区东三环中路39号4号楼402-4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路9号 财富中心A座604 济安财富
法定代表人：杨峰
联系人：李海婧
联系电话：010-65956116
网址：上海有鱼基金销售有限公司

传真：010-65330699
客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）
客服电话：021-69007378
网站：<http://www.youyufund.com>
（106）洪泰财富（青岛）基金销售有限公司
法定代表人：林卓
地址：辽宁省大连市沙河口区星海广场 3 号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星岛园 3 号
电话：400-6411-999
网址：www.taichangfund.com
（81）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-层
办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-层
法定代表人：黄金琳
电话：（0591）87383623
传真：（0591）87383610
客户服务电话：96326
网址：www.hfq.com.cn
（82）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
电 话：4000988117/4000888116
传 真：010-89188000
客服电话：010-5919118 企业咨询：400-088-8816
公司网址：<http://fund.jd.com/>
（83）福建海峡银行股份有限公司
注册地址：福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
办公地址：福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
法定代表人：苏素华
联系电话：0591-87332762
传真号码：0591-87330926
客户服务热线：400-893-9999
公司网站：www.fhbank.com
（84）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区川沙路977号1幢B座812室
办公地址：上海浦东东微路609号4号楼2楼
法定代表人：邢水
联系电话：021-80234888
传真号码：021-80234898
网址：<http://www.goal.com>
（85）贵州新华文惠基金销售有限公司
注册地址：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房
办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路贵州医科大学学术交流中心C16楼
法定代表人：李陆军
联系电话：（0851）86099950
传真号码：（0851）86099950
客户服务电话：400-8391818
网址：<http://www.hyqh.com>
（86）上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼260室
办公地址：上海市西城区金融大街9号瀚华大厦B座8层
法定代表人：李一梅
联系人：仲秋明
联系电话：010-88066632
传 真：010-88066552
客户服务电话：400-817-5666
网址：www.huaxia.com
（87）上海浦东华富基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区吴淞路667弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号
法定代表人：马刚
客户服务电话：021-61760600
网址：www.tongshangfund.com
（88）杭州恒信基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二路与泛泛路交叉口中央商务区泛泛国际SOHO408（一期）第七楼22室14号
办公地址：杭州市文二路与泛泛路交叉口中央商务区泛泛国际SOHO408（一期）第七楼22室14号
法定代表人：郝鹏
联系电话：（027）87066609
传真号码：（027）87066110
客户服务电话：400-279-8999
网址：<http://www.hongxinfund.com>
（89）江西正融资产管理有限公司
注册地址：江西省南昌市高新区紫阳大道绿地都会38栋2107室
办公地址：江西省南昌市高新区紫阳大道绿地都会38栋2108室
法定代表人：阮庭
联系电话：1387912841
传真号码：0791-86629512
网址：<http://www.jiangxi.com.cn/index.asp>
（90）中民财富管理（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号17层
法定代表人：苏洪军
联系电话：021-33353333
全国统一客服热线：400-876-5716
公司网站：www.cnmw.com
（91）杭州同顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区文澜路2号中1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号沃德国际4楼
法定代表人：陈刚
客户服务电话：0571-86655920
公司网站：<http://www.cdt121.com/>
（92）北京基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路园公科技园1800号4号楼6153室（上海崇明经济开发区）
法定代表人：王翔
联系电话：021-65370077
公司网站：<http://www.jiyufund.com/>
客户服务电话：400-820-5369
（93）深圳市铂安基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区西线一路1号A座101室（前海深港合作区管理局综合办公区）
办公地址：深圳市前海深港合作区西线一路1号A座101室（前海深港合作区管理局综合办公区）
法定代表人：李季东
联系电话：020-6191-9888
网址：<http://zg.danm.com.cn/>
（94）江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址：江苏省常州市和平中路413号
办公地址：江苏省常州市和平中路413号
法定代表人：李响
联系电话：0519-80589510
（95）天津万得财富资产管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）泰达大道1988号滨海新区大厦2-241室
法定代表人：李修群
联系电话：13901314076
客户服务电话：010-59013825
网址：<http://www.wandewealth.com/>
（96）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C1809
法定代表人：戎兵
联系电话：010-52143385
传真号码：010-58804285
客服电话：400-6099-200
网址：<http://www.yixinfund.com/>
（97）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西线一路1号A座201室（入驻深圳前海商务秘书有限公司）
法定代表人：周文
总机：（86）21-68649788
传真：（86）21-50120888
网站：400-666-0066
网址：www.xcfunds.com
（98）嘉实财富基金销售有限公司
住所：贵州省贵阳市观山湖区长岭路A133室
法定代表人：陈皓
客服电话：0891-6177483
网址：<http://www.jiashifund.com/>
c/ov/home/aboutUs
（99）泛华普益基金销售有限公司
注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人：于泽洋
客户服务电话：400-588-5888
网址：www.puyifund.com
（100）四川天府银行股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼
法定代表人：胡燕飞
联系电话：021-58106677
传真号码：021-58802721
客户服务电话：021-50816733
网址：<http://www.danjiangfund.com/>
（104）国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
客户服务电话：95310
网址：<http://www.gq.com.cn>
（105）上海有鱼基金销售有限公司

法定代表人：林琛
办公地址：上海徐汇区桂平路391号B座19层
客服电话：021-69007378
网站：<http://www.youyufund.com>
（106）洪泰财富（青岛）基金销售有限公司
法定代表人：任淑娟
注册地址：山东省青岛市市南区香港东路195号9号楼701室
办公地址：山东省青岛市市南区香港东路195号9号楼706室
北京市西什库大街31号九思众创
客服电话：400 676 863
网址：<https://www.hongtaifund.com>
（107）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人：洪淋生
联系电话：0592-3122673
传真号码：0592-3122701
客服电话：400-918-0808
公司网址：www.xd.com.cn
（108）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2楼230室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1504/1505室
法定代表人：张冠宇
联系电话：86-10-85876862
传真号码：86-10-85932880
客服电话：400-819-9868
网址：<http://www.tdyhfund.com/>
（109）上海源泽钰基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区北蔡镇镇坪路2号24幢N13187室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路479号金耀大厦4楼
法定代表人：胡珂刚
联系电话：021-50778975
传真号码：021-68367031
（110）中银国际证券有限责任公司
地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦2层
办公地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦41层
法定代表人：宁晓
联系电话：021-400208888
网址：www.bocchina.com
（111）嘉实财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1号上海国金中心办公楼二期5层512-15单元
312-15单元
法定代表人：赵学军
客户服务电话：4000128850
公司网站：<http://www.harvestwm.com>
（二）登记机构
名称：华安基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1号上海国金中心二期311-32层
法定代表人：朱圣宇
电话：（021）38699999
传真：（021）33297962
联系人：赵晨
客户服务中心电话：40088-50099
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海锦泰律师事务所
住所：上海市浦东新区城南南路256号万年里大厦14楼
办公地址：上海市浦东新区城南南路256号万年里大厦14楼
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150998
联系人：刘佳
网址：www.tongshangfund.com
（四）审计机构名称、地址、电话
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：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23228800
联系人：魏佳亮
经办会计师：单峰、魏佳亮

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金名称：华安沪深300量化增强证券投资基金
本基金类型：契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

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、股指期货、权证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，但须符合中国证监会相关规定。
本基金将根据法律法规的规定参与融资融券及其他证券出借业务。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的90%；每个交易日终在扣除股指期货合约和债券正回购的资金余额后，现金或到期日在一年以内的国债逆回购占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

（一）股票策略
本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股的基础上根据量化模型进行资产配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

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。

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，或在市场上出现其他更适合投资的指数作为本基金的标的指数时，本基金管理人可以在充分保护持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象；4）依据标的指数代表性、流动性、与原标的指数的相关性等多因素选择确定新的指数。基金管理人将在调整前3个工作日内在中国证监会指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

（2）多因子量化增强模型
1）因子分析
本基金基于标的指数成份股及其他股票的历史数据，对价值、成长、趋势、动量、情绪、分析师预期等方面的因子在不同市场环境下的个股表现的影响进行统计分析，找出可能影响股票回报的因子。具体分析的因子包括以下几个类别：
价值指标：P/E、企业价值/EBITDA、P/B、PEG等；
成长指标：主营业务利润复合增长率等；
盈利指标：净资产报酬率、总资产报酬率等；
运营指标：存货周转率、总资产周转率等；
一致预期指标：分析师预期数据；
市场行为指标：动量、反转、换手率等。

在因子分析的基础上，本基金将进一步利用统计计划建立单个因子与未来超额回报关系，即因子预测能力。筛选统计对不同市场环境的有效因子，并根据预测能力因子间相关性来最终构建多因子量化增强模型。

（3）风险控制与组合优化
在正常的市场情况下，本基金将主要依据多因子量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场趋势的变化。在市场中出现非正常波动或市场出现区域性市场可能出现较大非正常波动时，基金经理将根据公司研发团队结论及市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体权重及权重。

（4）权证投资策略
本基金为指数增强型基金，在追求超越收益的同时，本基金将建立专门的权证风险控制模型，力争将权证相对于沪深300的跟踪误差控制在一定范围内。

（5）债券投资策略
本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围内和风险控制的前提下，审慎选择债券，参与融资和转融通证券出借业务。

参与融资融券业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购或赎回造成的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

参与转融通证券出借业务时，本基金将在对基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通证券出借对象，力争为基金份额持有人增厚投资收益。

（二）投资限制

1.组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制：
（1）本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%，其中沪深300指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的90%；
（2）本基金持有一家上市公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情况除外；
（3）本基金管理人管理的且由本基金持有的全部基金持有的一家上市公司发行的证券，不超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的且由本基金持有的全部基金持有的一家上市公司发行的可流通股，不超过该上市公司可流通股总额的30%；但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不计入在内；
（4）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（5）本基金管理人管理的且由本基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（6）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（7）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（8）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%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（9）本基金仅在投资股指期货时遵守下列要求：本基金在任何交易日终，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%，持有买入股指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%，其中持有价证券指债券、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；本基金在任何交易日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日终交易（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%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值的不差不得低于基金资产净值的80%；

（10）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所保证金后，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（11）本基金在参与融资融券时遵守下列要求：本基金参与融资的每个交易日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

（12）本基金仅在参与转融通证券出借业务时遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的资产不超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司停牌、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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（14）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；

（15）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（10）、（13）、（14）项外，因证券市场波动、证券发行入合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）承销证券；
（2）违反证券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，但是中国证监会另有规定的除外；
（5）向基金管理人、基金托管人出资；
（6）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；
（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（三）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的原则和处理方法
1.基金管理人按照国家有关规定代表基金行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2.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；
3.有利于基金财产的安全与增值；
4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系第三人牟取任何不当利益。

（四）基金的融资、融券
本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

九、基金的投资比较基准

本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×同期商业银行活期存款基准利率

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，或是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准及其权重配置。业绩比较基准的变更须经基金管理人及基金托管人协商一致并报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月3日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等内容，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2018年6月30日。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	745,591,029.63	88.35
2	固定收益投资	745,591,029.63	88.35
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	应收利息和应收资产支持证券	91,573,018.60	10.88
7	其他资产	6,517,028.10	0.77
8	合计	843,881,766.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,499,064.23	2.49
C	制造业	307,366,445.56	35.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,494,937.27	2.31
E	建筑业	20,360,987.00	2.42
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	20,326,060.00	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	49,226,277.20	5.89
J	金融业	217,966,311.98	25.71
K	房地产业	23,396,644.00	2.80
L	租赁和商务服务业	14,517,623.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,226,127.14	0.74
O	医药生物、医药和医疗器械业	-	-
P	文教、体育和娱乐业	-	-
Q	医疗保健业	-	-
R	综合	9,842,960.70	1.20
S	其他	6,799,638.78	0.83
K	合计	745,591,029.63	88.35

5.3 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)
----	------	------	-------