

(上接B049版)

传真:021-68865680
联系人:赵小明-21-69634510-8620
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xccsc.com
91 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
开放式基金咨询电话:400-698-9998
开放式基金业务传真:010-83561094
联系人:孙惺
联系电话:010-83561149
网址:www.xsdzq.cn
92 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼1层
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼1层
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
93 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:浦东新区民生路1199弄嘉大五道口广场1号楼20层
法定代表人:兰荣
客服电话:95562
业务联系电话:0591-38162212
公司网址: http://www.xyqz.com.cn/xyqz/index.html
94 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
开放式基金咨询电话:4008-888-888
开放式基金业务传真:010-66668990
联系人:田薇
联系电话:010-66568430
网址:www.chinastock.com.cn
95 美邦证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十三层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十三层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客服电话:4008-698-698
网址:www.ydscc.com.cn
96 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:95565 4008888111
公司网址:www.nowone.com.cn
97 浙商证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市机场大道1号黄龙世纪广场A区6-7层
办公地址:浙江省杭州市机场大道1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:赵坚
电话:0571-87901908,0571-87901053
传真:0571-87901913
联系人:刘虹,顾群
客户服务电话:0571-967777
公司网址:www.stocke.com.cn
98 中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座
法定代表人:王宜四
电话:0791-68768681
联系人:戴霞
客户服务电话:400-886-567
网址:www.wavicsc.com
99 中国国际金融有限公司
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1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:金立群
电:010-65051166
传:010-56679652
公司网址: http://www.cicc.com.cn
100 中天证券有限责任公司
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01,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23层
办公地址:深圳市福田区益田路10003号荣超商务中心A栋第04,18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invsc.com
102 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
基金业务对外联系人:权健
联系电话:400-8888-108
联系传真:010-65182261
公司网址:www.cscs.com.cn
客服电话:400-8888-108
103 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江干大道588号恒鑫大厦主楼19、20层(266061)
办公地址:浙江省杭州市滨江区江干大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
联系人:王常青
联系电话:0571-59522605
客户服务电话:0571-59522605
传真:0571-60090888
网址:www.citicsd.com
105 中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)
办公地址:深圳市福田区益田路222号青岛金融广场1号楼20层(266061)
法定代表人:杨宝林 基金业务联系人:吴忠超
联系人:尹伶
电话:010-66045152
传真:010-66045678
客户服务电话:010-66045152
传真:010-66045158
天相投顾网址: http://www.txsec.com
天相基金网址: www.jm.com.cn
109 江苏金百利投资咨询有限公司
注册地址:无锡市滨湖区锦溪99号
办公地址:无锡市滨湖区锦溪99号
法定代表人:费晓燕
电:0510-82758877
传:0510-88555858
110 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:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
法定代表人:王莉
订购热线:4009-946-899
客服中心:0755-88399099
传真号码:0755-88394677
新兰德网址: http://www.new-rand.cn/
111) 和讯信息科技股份有限公司
注册地址:北京市朝阳大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人:周铁
传真:021-20835789
网址:lihexun.com
112 厦门市鑫鼎盛证券投资咨询有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼

法定代表人:林松
联系人:高雪
电话:0592-8122719
传真:0592-9060771
客户服务电话:400-6980-777
网址:www.lkhs.com
113 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港公路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3楼801
法定代表人:唐静
电话:021-38600735
传真:021-38509777
114 深圳众禄基金销售有限公司
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
法定代表人:薛峰
联系人:薛峰
联系电话:0755-33227950
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:童彩平
网址:www.zlfund.com & www.jjmwm.com
115 上海天马基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
注册资本:人民币五千元
法定代表人:其安
电话:021-54950998
传真:021-6438308
客服电话:4000-766-123
网址: http://www.fund123.com/
118 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文
电话:021-53870011
传真:021-63569919
公司网址: http://www.howbuy.com/
117 杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏华
联系人:张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服电话:4000-766-123
网址: http://www.enrichfund.com
119 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市下城区文一路2号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市下城区文一路2号元茂大厦903室
法定代表人:张伟伟
联系人:单丙海
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-089-1289
公司网址: www.fundit.com
120 北京恒道易购销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪裕富大街6号
办公地址:北京市顺义区后沙峪裕富大街6号
法定代表人:闫振杰
电话:010-62000888
传真:010-62000888-8002
121 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:上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人:盛大
电话:021-5063533-3006
传真:021-50632633
客服电话:400-005-6356
网址: www.leadfund.com
122 中航期货投资基金(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建外SOHO光华路16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建外SOHO光华路16号1幢11层
法定代表人:路培
电话:010-65807866
传真:010-65807888
客服电话:95162 4008888160
网址: www.cifc.com
123 浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼D区801室
办公地址:浙江杭州西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心D区801室
法定代表人:陆彬彬
联系人:徐勇
电话:0571-56028620
传真:0571-56028620
客户服务电话:400-068-0058
公司网址: http://www.jincheng-fund.com/
124 北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区阜民胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区阜民胡同31号5号楼215A
法定代表人:李伟
电话:010-66154928
传真:010-89067625
客服电话:010-89067625
网址: www.cifund.com
125 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
办公地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海波
电话:028-82000966-805
传真:028-82000966-805
客服电话:400-588-588
网址: http://www.pyfund.cn/
126 北京宜信普信投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号1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18层1809
法定代表人:徐伟
公司网址: www.yixinfund.com
服务热线:400-609-200
客服电话:400-588-588
网址: www.yixinfund.com
127 万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市西城区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人:王强
电话:010-59393074
传真:010-59393074
客服电话:400-909-009
网址: www.pyfund.com
128 北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗珊
电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
客服电话:010-28932877
网址: www.cvcwm.com
129 深圳腾元基金融有限公司
客户服务电话:400-001-8811
130 深圳腾元基金融有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407
办公地址:深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407
服务热线:4006-877-899
联系人:王强
电话:021-62113098
传真:021-62112018
客服电话:021-62112018
名称:广东东凤昆仑律师事务所上海分所
住所:上海市延安西路128号华联·翰尊国际大楼13楼F座
法定代表人:林利军
电话:021-28932876
传真:021-28932876
联系人:王小东
(三)律师事务所和经办律师
名称:广东东凤昆仑律师事务所上海分所
住所:上海市延安西路128号华联·翰尊国际大楼13楼F座
法定代表人:林利军
电话:021-62113098
传真:021-62112018
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
首席合伙人:吴群华
住所: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: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
邮政编码:100739
公司电话:010-58153000
公司传真:010-58182898
签章会计师:徐驰、汤骏
业务联系人:汤骏
九、基金的名称
本基金名称:汇添富上证综合指数证券投资基金
五、基金的类型
本基金为契约型开放式股票型基金。
六、基金的投资目标
本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的准确跟踪。

七、基金的投资方向
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括上海证券交易所上市的所有股票,如一级市场初次发行或增发,其中其股

票资产占总资产的比例为90%~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。投资于指数成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。但因法律法规限制原因导致本基金不能投资于股票,其

股票资产占总资产的比例将不超过基金资产净值的10%。如果因法律法规允许,本基金的投资比例可以提高到基金资产净值的10%。

如以后法律法规或中国证监会允许,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,将其纳入投

资范围。

八、基金的投资策略

(一) 投资策略

本基金为被动式指数基金,原计划采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性和抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等变化时,或因基金的申购和赎回等对本基金净值表现比较基准的绩效可能带来影响,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,最终使跟踪误差控制在投资的范围内。

本基金建仓时间为3个月,3个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

(二) 资产配置

本基金采用自上而下的两层资产配置策略,首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例,再进一步以抽样复制基准指数的方法,将基金资产比例原则上将不低于基金资产净值的90%,在巨量申购赎回发生时,成份股大比例分红等情况下,管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪误差后,及时将股票配置比例调整至合理水平。

如果法律法规规定,本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的100%,此情况下须经基金份额持有人大会同意。

(三) 抽样组合构建

本基金原则上采用抽样复制基准指数的方法,在综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性和抽样组合与上证综合指数的相关性的基础上,采用“重点抽样+分层抽样”的方法,选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金的抽样股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股配置比例。

(四) 抽样组合筛选

由于上证综合指数包含在上海证券交易所上市交易的所有A股和B股股票,本基金在抽样复制时,将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

(五) 重点抽样

将预筛选出来的股票,按总市值从大到小排序,逐个累加总市值,累计总市值在前90%的股票,按照其在上证综合指数的比例进入抽样组合。

(六) 分层抽样

对于累计总市值在后20%的股票,按照行业分类在每个行业中进行抽样选取行业组合化。

(七) 确定抽样组合

对于“重点抽样+分层抽样”方法得到的股票,将被用作构建本基金的最终抽样股票组合。

针对当前上证综合指数个股集中度较高的特点,本基金采取“重点抽样+分层抽样”的方法对基准指数进行抽样复制。为了能够更好的跟踪上证综合指数,如果今后由于基准指数成份股结构的变化,其他抽样复制方法更适用于基准指数的跟踪,本基金将根据相应的变更。对于抽样复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更后的2个工作日内至少在一种指定媒体上刊登公告,并阐明变更抽样复制方法的原因。

(八) 股票组合调整

对于上证综合指数个股集中度较高的特点,本基金将采取“重点抽样+分层抽样”的方法对基准指数进行抽样复制,能够更好的跟踪上证综合指数,如果今后由于基准指数成份股结构的变化,其他抽样复制方法更适用于基准指数的跟踪,本基金将根据相应的变更。对于抽样复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更后的2个工作日内至少在一种指定媒体上刊登公告,并阐明变更抽样复制方法的原因。

(九) 投资组合调整

根据指数编制规则,当发生巨额赎回超过现金保有量时,本基金将对股票投资组合进行同比例调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准的相对正向和跟踪误差最小化。

在重点抽样调整时,如果已选股票位于累计总市值前85%则优先买入;在进行抽样组合调整时,如果已选股票在行业中所属类中流动性排名没有显著变化,则优先保留。

在重点抽样调整时,如果已选股票位于累计总市值前75%则优先买入;在进行抽样组合调整时,如果已选股票在行业所属类中流动性排名没有显著变化,则优先保留。

(十) 投资组合调整

对于上证综合指数个股集中度较高的特点,本基金将采取“重点抽样+分层抽样”的方法对基准指数进行抽样复制,能够更好的跟踪上证综合指数,如果今后由于基准指数成份股结构的变化,其他抽样复制方法更适用于基准指数的跟踪,本基金将根据相应的变更。对于抽样复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更后的2个工作日内至少在一种指定媒体上刊登公告,并阐明变更抽样复制方法的原因。

(十一) 投资组合调整

根据指数编制规则,当发生巨额赎回超过现金保有量时,本基金将对股票投资组合进行同比例调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准的相对正向和跟踪误差最小化。

在重点抽样调整时,如果已选股票位于累计总市值前85%则优先买入;在进行抽样组合调整时,如果已选股票在行业中所属类中流动性排名没有显著变化,则优先保留。

在重点抽样调整时,如果已选股票位于累计总市值前75%则优先买入;在进行抽样组合调整时,如果已选股票在行业所属类中流动性排名没有显著变化,则优先保留。

(十二) 投资组合调整

对于上证综合指数个股集中度较高的特点,本基金将采取“重点抽样+分层抽样”的方法对基准指数进行抽样复制,能够更好的跟踪上证综合指数,如果今后由于基准指数成份股结构的变化,其他抽样复制方法更适用于基准指数的跟踪,本基金将根据相应的变更。对于抽样复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更后的2个工作日内至少在一种指定媒体上刊登公告,并阐明变更抽样复制方法的原因。