

(上接B059版)
公司网站: www.fund123.cn
(7) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法人代表: 张伟
联系电话: 021-58788678-8201, 13585790204
传真电话: 021-58787608
联系人: 沈斌斌
客服电话: 400-089-1288
公司网站: www.erichfund.com
(78) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 杭州市文二西路1号903室
办公地址: 杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表: 凌顺平
联系电话: 0571-88911818
传真电话: 0571-88600423
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(79) 北京恒星基金有限公司
注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇富安街6号
办公地址: 北京市朝阳区德胜门外交公寓B座2号民建大厦6层
法人代表: 闫振杰
联系电话: (010) 62020088
传真电话: (010) 62020088
联系人: 宋丽娟
客服电话: 4008886661
公司网站: www.myfund.com
(80) 中期资产管理有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
法人代表: 路璐
联系电话: 010-59539718
传真电话: 010-59539701
联系人: 侯建英
客服电话: 95162, 4008888160
公司网站: www.cifcft.com
(81) 财实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 舒军
联系电话: 021-20289890
传真电话: 021-20280110
联系人: 张倩
客服电话: 400-921-8950
公司网站: www.harvestwm.cn
(82) 北京创金启富投资管理有限公司
注册地址: 北京市西城区民主胡同31号5号楼215A
办公地址: 北京市西城区民主胡同31号5号楼215A
法人代表: 翟晋
联系电话: (010) 66154828
传真电话: (010) 88067626
联系人: 张倩
客服电话: 400-622-8118
公司网站: www.5ifund.com
(83) 宜信普惠投资顾问(北京)有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路8号9号楼15层1009
办公地址: 北京市朝阳区建国路8号SOHO现代城C座1809
法人代表: 徐伟伟
联系电话: 010-52855713
传真电话: 010-95894288
联系人: 陈利
客服电话: 400-609-9200
公司网站: www.yixinfund.com
(84) 凯京德汇富投资有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502
办公地址: 北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座1502
法人代表: 李振
联系电话: 010-65181028
传真电话: 010-65174782/65231189
联系人: 魏蕊
客服电话: 400-0266653
公司网站: www.kjdfund.com
(85) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼090单元
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法人代表: 郭坚
联系电话: 021-20665952
传真电话: 021-22206653
联系人: 宇博宇
客服电话: 4008219031
公司网站: www.lufund.com
(86) 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105室-3491
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼090单元
法人代表: 陈文博
联系电话: 021-20361818
传真: (021) 20361616
联系人: 雷青雪
(三) 出具法律意见书的律师事务所(基金募集时)
名称: 上海源泰律师事务所
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
负责人: 廉海
联系电话: (021) 51150098
传真: (021) 51150098
联系人: 廉海
经办律师: 黎明、吴军威
(四) 审计基金资产的会计师事务所
名称: 安永华明会计师事务所
注册地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人: 葛明
联系电话: 021-22288888
传真: 021-22250000
联系人: 徐皓
经办注册会计师: 徐皓、蒋蕙华

四、基金的名称

富国中证红利指数增强型证券投资基金
(2012年4月16日“富国中证红利指数增强型证券投资基金”更名为“富国中证红利指数增强型证券投资基金”)

五、基金的类型

指数量

六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金,其在遵循“程序化指数投资、有限度个股调整,精细化风险管理”的原则的基础上,实现对中证红利指数的有效跟踪,力争在风险调整后收益超越指数所带来的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有流动性高的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产占基金资产的比例不低于基金资产的90%,投资于中证红利指数成份股的比例不低于基金资产的80%,保持不低于基金资产净值的0.5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资策略,在完全复制目标的基础上有度地调整个股,从而最大限度降低由于交易成本造成的跟踪误差组合相对于目标指数的偏离,并力求投资收益能够有效跟踪市场平均收益。

(1) 在成份股内进行有度地调整

本基金主要采用完全复制目标指数策略,按照成份股在目标指数中的基准权重来构造股票投资组合,从而有效跟踪目标指数,控制跟踪误差,并相对应于目标指数的大幅度偏离。

(2) 在指数化投资过程中,由于交易成本的成分,完全复制策略可能很难达到拟合目标指数的成分。因此,本基金将主要采用有度个个股调整策略(主动性投资)对指数化投资进行修正,以降低由于交易成本导致的对指数跟踪技术的影响,并力争适度超越指数,获取超额收益。

(3) 在成份股内进行有度地调整

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的论证,进行以下三种具体操作:

(1) 合理替代部分流动性缺失的成份股。因本基金将根据其具体在组合中的基准权重来构造股票投资组合,在综合考虑跟踪误差、分位数、行业分布、风险等因素后,本基金将有度地增持部分流动性缺失的成份股。

(2) 对非成份股进行适度调整。

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的论证,进行以下三种具体操作:

(3) 跟踪误差的控制和再平衡调整。

本基金将及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会,并适度进行股票重仓,以实现对股票的套利操作,以求提高资金运用效率。同时,本基金也可能审慎使用资金进行增发,以对冲某些特殊的突发事件和某些特殊情况下的流动性风险。

九、基金的申购和赎回

本基金在申购和赎回时,将目标指数的成份股分成三类——价值被低估的低风险收益预期的成份股、价值较合理的中风险收益预期的成份股以及价值被高估的高风险收益预期的成份股。

在申购组合投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查或受到行政限制时,本基金将有度地增持部分流动性缺失的成份股的资产,不低于基金资产净值的80%,保持不低于基金资产净值的0.5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

在赎回组合投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查或受到行政限制时,本基金将有度地减持部分流动性缺失的成份股的资产,不低于基金资产净值的80%,保持不低于基金资产净值的0.5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金将根据其在申购和赎回时,将目标指数的成份股分成三类——价值被低估的低风险收益预期的成份股、价值较合理的中风险收益预期的成份股以及价值被高估的高风险收益预期的成份股。

在赎回组合投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被