

上证综指交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

上证综指交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由中国证监会2010年10月31日证监许可【2010】1379号文批准发起设立。本基金的基金合同于2011年1月30日正式生效。

【重要提示】

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并自行承担基金投资中出现的各种风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。本基金为股票基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于中风险类型,中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相当的产品。

基金的投资业绩并不预示其未来表现,也不保证基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额时,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读本基金的基金合同。

本招募说明书书内容截止至2016年1月30日,基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2015年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司,基本情况如下:
名称:富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
法定代表人:薛灵波
总经理:陈戈
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)20361816
传真:(021)20361616
联系人:范伟男
注册资本:1.8亿元人民币
股权结构(截止至2016年1月30日):

股东名称	出资比例
南京证券股份有限公司	27.77%
南京证券资产管理分公司	27.77%
加拿大丰业银行(中国)有限公司	27.77%
山东国际信托投资有限公司	16.67%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的核心决策和投资风险管理。风险控制委员会负责制定公司日常运作的风险控制和管理程序,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范规范化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设二十个部门、三个分公司和二个子公司,分别是:权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益研究部、量化与海外投资部、权益专户投资部、养老投资部、权益研究部、集中交易部、董事会办公室、综合管理部、机构业务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、信息技术部、运营部、北京分公司、风险管理部、广州分公司、期货资产管理(香港)有限公司、期货资产管理(上海)有限公司。权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益投资部:负责固定收益类公募基金和非固定收益类公募基金的投资部分(包括公司自有资金等)的投资管理;固定收益专户投资部:负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理;固定收益研究部:负责固定收益类公募基金和非固定收益类公募基金的投资部分的研究管理等等;量化与海外投资部:负责量化权益投资、量化衍生品投资及境外权益等各类投资的研究与投资管理;权益专户投资部:负责社保、保险、QDII、一对一、一对多等非公募基金类专户的投资管理;养老基金部:负责养老金(企业年金)计划、企业年金、基本养老金、补充养老金等各类专户等产品的投资管理;权益研究部:负责行业研究、上市公司研究宏观研究等等;集中交易部:负责投资决策和风险风控;董事会办公室:履行公司章程规定的工作职责,参与综合管理部办公室、综合管理部;负责公司董事会日常工作、公司文秘管理、公司(内部)宣传、信息披露、行政后勤管理工作;机构业务部:负责企业、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心(广州分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分公司)、北京营销中心(北京分公司)、期货资产管理(香港)有限公司;期货资产管理(上海)有限公司:负责共同基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的制定和落实、品牌建设和媒体关系管理、为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式营销支持;客户服务部:制定客户服务策略,制定客户服务规范,建设客户服务团队,提高客户满意度;信息技术部:分析客户数据,支持业务决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,制定并落实公司电子商务发展战略和实施方案,有效推进公司电子商务业务;战略与产品部:负责开发、维护公募基金和非公募基金,协助营销研究、制定、落实、调整公司发展战略,建立数据搜集、分析平台;为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持;监察稽核部:负责公司监察、风控方法和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;富国资产管理(香港)有限公司:证券交易、就业务提供意见和建议资产管理;富国资产管理(上海)有限公司:经营特定客户资产管理及中国证监会许可的其他业务。

截止2015年11月30日,公司有员工31人,其中62%以上具有硕士以上学历。

(二)主要人员情况

1.董事会成员

薛灵波先生,董事长,研究生学历,高级经济师。历任交银银行扬州分行监察室副主任、办公室主任、主任助理、证券部经理,海通证券股份有限公司扬州营业部总经理,兴安证券有限责任公司托管组组长,海通证券股份有限公司黑龙江管理总部总经理兼党委书记,上海分公司总经理兼党委书记,公司机关党委书记兼总经理助理。

陈戈先生,董事、总经理,研究生学历。历任国泰君安证券有限责任公司研究员等职,富国基金管理有限公司研究员、基金经理、研究部总经理、总经理助理、副总经理,2005年4月至2014年4月任富国天益价值混合型证券投资基金基金经理。

麦陈露女士 Ms.(Constance Mak),董事,文学及商科学士,加拿大注册会计师。现任 BMO 金融集团 亚洲业务总经理 (General Manager, Asia, International, BMO Financial Group),中加贸易理事会董事和加拿大中文报业顾问团的成员。历任 St. Margaret's College 教师,加拿大华马奥 (KPMG) 会计师事务所的合伙人。

方芳女士,董事,研究生学历,高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监。历任北京国际信托投资公司研究中心副主任,厦门大学工商管理教育中心副教授,中国人民银行深圳经济特区支行(深圳中心支行)计划处副科长,中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构管理处、中国人民银行营业管理部深圳监管局财务处处长、国有银行监管处处长,申银万国证券股份有限公司财务总监。

裴长江先生,董事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理,历任上海万国证券公司研究部研究员、南北营业部总经理助理、总经理,申银万国证券公司南北营业部总经理、浙江管理总部总经理、经纪总部副总经理,华宝信托投资有限公司投资总监,华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

Barry Monnard Leong 先生,董事,本科学历,加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁 (SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group), 1980年至1984年在Coopers & Lybrand担任审计工作;1984年至加入加拿大BMO银行担任集团财务副经理。

陈年先生,董事,本科学历,中级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司自营业务部副总经理。历任山东正源和信会计师事务所审计师、评估师,山东鲁信置业集团有限公司计财部业务经理,山东省国际信托有限公司计财部业务经理,山东省国际信托股份有限公司合规审计部副经理。

张克均先生,董事,研究生学历。现任申万宏源证券有限公司战略规划总部总经理,历任上海证券期货交易所技术部副经理,上海证券期货交易所技术部,上海证券期货交易所技术部副经理,上海证券期货交易所技术部副经理,上海证券期货交易所技术部副经理,上海证券期货交易所技术部副经理,上海证券期货交易所技术部副经理。

黄平先生,独立董事,研究生学历。现任上海瀚业投资(集团)有限公司首席财务主管。历任上海市市政规划处主任,上海华联实业发展有限公司副总经理,上海瀚业投资(集团)有限公司总经理、总裁。

阎国强先生,独立董事,研究生学历。现任上海财经大学MBA学院院长、党委书记。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,金融学院党委书记、教学副院长、金融学院院长;上海财经大学教授、博士生导师,金融学院党委书记、教授。

崔晓燕 (Cary S. Ng) 先生,独立董事,研究生学历,加拿大特许会计师。现任圣力嘉学院(Seneca College)工系系主任及财务金融科教授。1976年加入加拿大华社从事财务事务的前身Thornco Ltd担任审计工作,有30余年财务管理及信息系统项目管理经验,曾任职在 Neo Materials Technologies Inc. 前身 Amk Technologies Inc., MLJ Global Business Developments Inc., UniLink Telecom Inc. 等国际公司作为首席财务总监(CFO)及财务总监。

李阳先生,独立董事,研究生学历。现任上海市锦天城律师事务所律师,高级合伙人。历任吉林大学法学院副教授。

2.监事会成员

陆彬先生,监事长,本科学历,高级会计师。现任山东国际信托股份有限公司纪委书记、风控总监。历任山东省济南市经济发展总公司会计,山东正源和信有限公司任会计师事务所主任,山东鲁信实业集团有限公司财务,山东省鲁信投资控股集团有限公司财务,山东省国际信托股份有限公司财务经理。

沈寅先生,监事,本科学历。现任申银证券有限公司合规与风险管理总部总经理助理及公司律师。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判长;上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。

夏晓璇女士,监事,研究生学历。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。历任上海大学外语系教师,荷兰银行上海分行结构融资部经理,蒙特利尔银行金融期权部副经理,渣打银行上海分行副经理。

仇厚卿女士,监事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司计划财务部总经理。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所任职;在华夏证券有限公司东方路营业部任职。

孙凯先生,监事,本科学历。现任富国基金管理有限公司副总监。历任杭州恒生电子股份公司职员,东吴证券股份有限公司职员,富国基金管理有限公司系统管理、IT 总监助理。

唐吉女士,监事,本科学历,CFA。现任富国基金管理有限公司策略研究员。历任上海夏商投资咨询有限公司研究员,富国基金管理有限公司研究助理,助理研究员。

王旭辉先生,监事,研究生学历。现任富国基金管理有限公司华东营销中心总经理。历任阜阳市人民政府办公室职员,和县国营一厂厂长,富国基金管理有限公司客户经理、高级客户经理。

陆运天先生,监事,研究生学历。现任富国基金管理有限公司电子商务部电子商务总监助理。历任汇添富基金电子商务经理,富国基金管理有限公司深圳电子商务经理。

3.督察长

范伟男先生,研究生学历。现任富国基金管理有限公司督察长。历任毕马威华振会计师事务所副经理,中国证监会上海监管局主任科员、副科长。

陈戈先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

林松志先生,本科学历,19年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副经理。历任福州进出口商品检验局秘书,办事处负责人,厦门证券分公司业务经理,富国基金管理有限公司监察稽核部稽核员、部门副经理、经理、督察长。

陆文佳女士,研究生学历,13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副经理。历任中国建设银行上海市分支行职员,经理,华安基金管理有限公司上海营销总部副经理、总监助理,市场部总监助理、上海分公司总经理助理,市场部副经理、市场总监、公司营销副总监。

李俊杰先生,研究生学历,高级经济师,13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副经理兼基金运营。历任国家外汇管理局外汇风险敞口管理官员,摩根士丹利利亚公司Barclay Group (MSCI&BAR&BAR&A集团)旗下高级基金经理,巴克莱国际投资管理公司 (Barclays Global Investors) 的大华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员,富国基金管理有限公司量化与海外投资部总经理兼基金运营,总经理助理兼量化与海外投资部总经理兼基金运营。

朱少卿先生,研究生学历,16年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副经理兼基金运营。历任富国基金管理有限公司产品开发主任、基金运营经理、基金运营、研究部副经理兼基金运营,总经理助理兼研究部副经理兼基金运营、总经理助理兼基金运营副经理兼基金运营。

5.本基金基金经理小组

(1)现任基金经理:

1) 王保合先生,博士,曾任富国基金管理有限公司研究员,富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2013年9月起任富国中证红利指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理,2015年4月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证红利指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起任富国中证红利指数分级证券投资基金基金经理,2015年6月起任富国中证红利指数分级证券投资基金基金经理,兼任量化投资总监。具有基金从业资格。

2) 万颢先生,硕士,自 2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量

研究员,2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金LOF基金经理助理,2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理,2015年6月起任富国中证红利指数分级证券投资基金、富国沪深300增强型证券投资基金基金经理及富国中证红利指数分级证券投资基金基金经理,2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,兼任量化投资总监助理。具有基金从业资格。

(2) 历任基金经理: 本基金第一位基金经理为李美女士,任职时间于2011年1月至2012年5月。

6.投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下:公司总经理陈戈先生、主动权益及固定收益投资部总经理李美先生和量化与海外投资部总经理李美女士。

列席人员包括:督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

7.上投人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街66号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜超峰
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:洪渊
(二)主要人员情况
截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1996年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系,规范的管理模式,先进的运营系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为国内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资产、企业年金基金、QDII资产、ODI资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年9月末,中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003 年以来,本基金连续一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球财经》、内资《证券时报》、《上海证券报》等境内权威财经媒体评选的49项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、申购赎回代理销售商(一级交易券商):
(1) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海四川路700号
法定代表人:王开国
联系电话:(021)22321900
联系人:龚莹
客服热线:96553,400-8888-001
公司网站:www.htsec.com
(2) 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙山路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:陈健
联系电话:(021)54033888
传真:(021)54038444
联系人:王序敏
客服热线:(021)962505
公司网站:www.swyw.com
(3) 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33号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街33号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共石
联系电话:(010)66568430
传真:(010)66569390
联系人:田薇
客户服务热线:4008-888-888
公司网站:www.chinastock.com.cn
(4) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路618号
办公地址:上海市浦东新区商城路168号上海银行大厦
法定代表人:万建华
传真:(021)38676666
联系人:李霞
客服热线:400-8888-666
公司网站:www.gtja.com
(5) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:胡月娟
电话:(021)-63325888
传真:(021)-63326729
客户服务热线:96503
公司网站:www.dfzq.com.cn
(6) 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区长途大厦中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路4中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇军
电话:0651-8
联系人:彭静
客服热线:96511-8
公司网站:www.pingan.com
(7) 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系电话:(025)83290979
传真:(025)151963323
联系人:万鸣
客户咨询热线:96597
公司网站:www.htsec.com
(8) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场1楼
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:刘军
联系电话:(021)-200339310
传真:(021)-50498825
联系人:王一菲
开放式基金咨询电话:96531;400-8888-588
公司网站:www.longone.com.cn
(9) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区马场路187-189号广发证券广场4楼(401-4216房)
办公地址:广东省广州市天河北路大都会广场5、18、19、36、38、43和44楼
法定代表人:孙明明
联系人:黄真
传真:(020)87559305
客服电话:96767
公司网站:www.gf.com.cn
(10) 齐鲁证券有限公司
注册地址:济南经七路86号
办公地址:济南经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:王霖
电话:(0531)-68889157
传真:(0531)-68889752
客户服务热线:96565
公司网站:www.qlzq.com.cn
(11) 兴证证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1幢21层
法定代表人:兰荣
电话:(0591)-38067538
联系人:王霖
客服热线:96562
公司网站:www.xyzq.com.cn
(12) 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:北京朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系电话:(010)61838888
联系人:权鹏
客服电话:400-888-8899
公司网站:www.cindasc.com
(13) 华融证券股份有限公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金雄
联系人:张静
联系电话:(0591)-87383623
业务传真:(0591)-87383610
客户服务热线:96326(福建外请专线96091)
公司网站:www.hfzq.com.cn
(16) 太平洋证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:陈国瑞
联系电话:(0351)-8886609
联系人:翟煜
客服热线:400-666-1618
公司网站:www.p1618.com.cn
(17) 国元证券股份有限公司
注册地址:合肥市寿春路179号
办公地址:合肥市寿春路179号
法定代表人:李学涛
联系人:王卓佳
联系电话:(0551)2207035
客服热线:400-8888-777
公司网站:www.gyzq.com.cn
(18) 中国证券股份有限公司

注册地址:郑州郑东新区商务外环路1号
办公地址:郑州郑东新区商务外环路10号
法定代表人:管恒晖
联系人:张宇宏
联系电话:(0371)-65585657
传真:(0371)-65585656
联系人:陈利明
客户咨询电话:9672111(郑州市) 9672111(郑州市外) 400-813-9666
公司网站:www.ccnew.com
(19) 上海证券有限责任公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区墨水街66号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区墨水街66号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
联系电话:0451-82236963
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
公司网站:www.shzq.com.cn
(20) 东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨劲松
联系人:安启雷
电话:(0431)-58500617
客服电话:400-604-0686
公司网站:www.nesec.cn
(21) 长江证券股份有限公司
注册地址:武汉新华路8号长江证券大厦
办公地址:武汉新华路8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽发
电话:(027)65799999
传真:(027)58481900
联系人:李晨
客服热线:95579或4008-888-999
公司网站:www.95579.com
(22) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座39-45层
办公地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人:肖吕林
联系电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:刘慧生
客服热线:95565,400-8888-111
公司网站:www.newone.com.cn
(23) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳福田区金田路418号安联大厦36楼、28层A2单元
办公地址:深圳福田区金田路418号安联大厦36楼、28层A2单元
法定代表人:牛冠生
电话:(0755)82558305
传真:(0755)82558002
联系人:陈剑虹
客户服务热线:400-800-1001
公司网站:www.essence.com.cn
(24) 华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人:李奇安
联系人:李昕雨
电话:0931-4892008
传真:(0931)4896028
客服热线:(0931)96668,4006898888
公司网站:www.hlzqgs.com
二、二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格和上海证券交易会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时发布相关公告。

(二)注册登记机构名称:中国证券投资基金结算有限责任公司
地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场2层
法定代表人:陈茜

联系人:刘凯
联系电话:(021)-588772625
(三)律师事务所和经办律师(基金集团):
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心10楼
负责人:韩朝
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:黎明
联系人:黎明
联系人:黎明

(四)会计师事务所和经办注册会计师
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100号东方广场E座东塔16层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1号环球金融中心60楼
法定代表人:葛明
联系电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

五、基金的类型

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金以标的指数的成份股、备选成份股为主要投资对象,指数化投资比例投资于指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%,如因标的指数成份股调整、基金投资组合调整、赎回清单内现金替代、现金差、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个交易日内进行调整,同时为了更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值95%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金采用固定比例抽样复制的策略,以优化抽样依托国量化投资平台,利用模型确定的风险模型,使用“跟踪误差最小化”的优化方式创制目标组合,从而实现对标的指数的紧密跟踪。

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1.最优投资组合的构建

(1)股票筛选
基于上证综指成份股包含在上海证券交易所上市交易的所有A股和B股股票,本基金在最优投资组合中,将具有股票可投资性、流动性、行业代表性等进行筛选。

(2)最优化构建
结合成份股的特点,综合考虑股票流动性、操作风险等因素,在长期稳定的风险模型的基础上进行最优投资组合,得到目标组合。

(3)调整跟踪
本基金采用最优化抽样复制方法跟踪标的指数,基金所构建的目标组合将根据标的指数的成份股及其权重进行相应的调整,以保证基金跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

【1】定期半年度调整
本基金构建的目标组合为根据最优化抽样方法得到的最优投资组合,将每半年根据上述最优化抽样复制方法对目标组合进行定期调整。

【2】不定期调整
根据上证综指指数编制规则,因指数成份股新发行、增发、送转股等权数变动需要进行成份股调整。本基金将跟踪标的指数的指数及目标组合之间的差异,如果由于标的指数的自身较大变化或者其他原因引起较大大幅度的偏差时,需要及时对基金投资组合进行优化调整目标组合。

本基金基于流动性管理的需要,可以少量投资于新股,期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,目的是保持基金资产的流动性,有效利用资金优势,提高基金资产的投资收益。该部分资产比例不高于基金资产净值的9%。

9.基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数的。本基金的标的指数的为上证综指收益率。本基金的标的指数变化受以下因素影响:

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征
本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,基金资产净值与标的指数的表现及标的指数的所代表的股票市场价格的相关性较高。

【1】基金的风险收益特征