

(上接B037版)

联络人:甘霖
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
客服电话:09518(安徽),4008096518(全国)
公司网站:www.hzq.com
(73)名称:中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心广场20层(266061)

法定代表人:张智河
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客服电话:0532-96577
公司网站:www.zxwt.com.cn
(74)名称:中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
联系人:王潇雨
电话:0571-88078823
客服电话:05648

(75)名称:中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程旭伟
电话:0371-65858670
传真:0371-65858665
公司网站:www.ccnew.com
(76)名称:国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常浩
联系人:黄勇
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
客服电话:400-818-0118
公司网站:www.guodu.com

(77)名称:广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-8888-133
传真:020-38225511
客服电话:020-3766070
公司网站:www.gzsc.com.cn
(78)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82255511
传真:0755-82565355
统一客服电话:4008010001
公司网站:www.essence.com.cn
(79)名称:中航证券有限公司
住所:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:400-896-6667
传真:0791-86770178
公司网站:www.avicsec.com

(80)名称:长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运利
客服电话:95679或4008888999
联系人:李良
电话:027-85799969
传真:027-85491900
客服热线:www.95679.com
(81)名称:瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程京鄂
联系人:牟冲
电话:010-58328112
传真:010-58328748
公司网站:www.ubssecurities.com

(82)名称:中国中投证券有限责任公司
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单元
办公地址: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04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘璇
电话:0755-82032442
传真:0755-82026530
开放式基金咨询电话:95532,400-600-8008
公司网站:www.china-invs.com

(83)名称:宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文三路233号宏源大厦
办公地址:深圳市福田区太平桥大街19号
法定代表人:冯茂
联系人:李巍
电话:010-88065658
传真:010-88085195
客服电话:400-800-562
公司网站:www.hysec.com
(84)名称:齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市市中区经二路86号
办公地址:济南市经七路86号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:吴昊
电话:0631-69889155
传真:0631-69889752
客服电话:95538
公司网站:www.qizq.com.cn

(85)名称:方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-95832343
传真:0731-95832214
客服电话:95571
公司网站:www.foundersc.com

(86)名称:江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人:孙名扬
联系人:张哲北
电话:0451-85863936
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
网站:www.jhzq.com.cn

(87)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:陈敏
电话:021-50122066
传真:021-50122200
客服电话:4008209888
公司网站:www.cnhbstock.com

(88)名称:光大证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:梁波
联系人:吴利晖
业务电话:0755-83007159
客服电话:4000-188-688
公司网站:www.ydscc.com.cn

(89)名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街6号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融大街6号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
联系人:李敬
联系电话:010-59356941
客服电话:40088-96618
公司网站:www.e618.com

(90)名称:华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李海斌
联系人:李海斌
电话:0931-4890100
传真:0931-4890118
客服电话:400-6888888
公司网站:www.hlzqgs.com

(91)名称: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
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(92)名称:长城国瑞证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:王勇
联系人:赵玖
电话:0592-6161642
传真:0592-5161640
客服电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.com

(93)名称:南京证券股份有限公司
住所:江苏省南京市大钟亭9号
法定代表人:张华东
联系人:徐翔
电话:025-83367898-4201
传真:025-83320066
客户服务热线:4008285888
公司网站:www.njzq.com.cn

(94)名称:华融证券股份有限公司
注册地址:广州市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
201

法定代表人:宋德清
联系人:陶颖
电话:010-58568040
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn
(95)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:吴承
联系人:谢顶顺
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn

(96)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:陈健佳
联系人:张健
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn

(97)名称:红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:苏利军
客服电话:400-871-8880
传真:0871-3578827
公司网站:www.hongtastock.com

(98)名称: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
联系人:刘一宏
电话:028-86690070
传真:028-86690126
客服电话:4006600109
公司网站:www.gjzq.com.cn

(99)名称:联讯证券有限责任公司
注册地址:广东省惠州市下埔路14号
法定代表人:徐刚
客服电话:400-8888-929
联系人:丁宁
电话:010-64408820
传真:010-64408252
公司网站:www.lxszq.com.cn

(100)名称: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
法人代表:刘汝军
联系人:孙伟
电话:010-83661149
客服电话:400-898-9898
传真:010-83661094
公司网站:www.xdszq.cn

(101)名称:日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔庆杰
联系人:陈彬彬
电话:010-88068330-730 010-88068330-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88068630
公司网站:www.rbxq.com.cn

(102)名称:湖北证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦
办公地址:湖北省武汉市江宁区唐人家路32号国资大厦B座
法人代表:余磊
联系人:翟耀
电话:027-87618882
客服电话:4008005000
传真:027-87618863
公司网站:www.ttfzq.com

(103)名称:东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址:广东东莞莞城区可园南路一号金源中心30楼
法人代表:张永涛
联系人:李芳
联系电话:0769-22100155
客服电话:0769-961130
传真:0769-22119426
公司网站:www.dgzq.com.cn

(104)名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
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南路550号裕景国际座16层
法定代表人:张庆伟
联系人:余晓峰
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

(105)名称: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J、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J、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:董影杉
电话:0755-33227950
传真:0755-82087078
网站:www.zlfund.cn及www.jlmmw.com
客服热线:4006-788-887

(106)名称: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(0)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞萍
联系人:杨利娟
电话:021-64316642
业务传真:021-64563529
客服热线:021-32109699;029-68918888;4001099918
公司网站:www.cfsc.com.cn

(107)名称:中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:刘军
联系电话:0755-82943755
业务传真:0755-82940511
客服热线:4001022011
公司网站:www.zszq.com

(108)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人:李尚军
联系人:李海荣
电话:010-66561166
业务传真:010-65051166
公司网站:www.citic.com.cn

(109)名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼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
联系人:杨文斌
电话:021-58870011
业务传真:021-68596916
客服热线:4007009665
公司网站:www.ehowbuy.com

(110)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
电话:0571-89918118-8565
业务传真:0571-86800423
客服热线:0571-89208937,4008-773-772
公司网站:www.10jqkd.com

(111)名称:深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)
办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)
法定代表人:纪卓磊
联系人:王婉婷
电话:0755-33376853
业务传真:0755-3306616
客服热线:4006577898
公司网站:www.tenyfund.com

(112)名称:中期资产管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号1103号
法定代表人:路翔
联系人:侯英建
电话:010-65808756
业务传真:010-59393074
客服电话:400-808-0069
公司网站:www.wy-fund.com

(114)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38600735
业务传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

(115)名称:上海天基基金销售有限公司
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7楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-64509988
业务传真:021-64395308

客服热线:4001818188
公司网站:www.1234567.com.cn
(116)名称: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368号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
业务电话:021-60897843
业务传真:0571-26897010
客服热线:4000-766-123
公司网站:www.fund123.cn

(117)名称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:吴阿婷
联系电话:0755-82721106-8642
业务传真:0755-82029065
客服热线:4006920022
公司网站:www.hexun.com

(118)名称:浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:浙江杭州西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)801室
办公地址:浙江杭州西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)801室
法定代表人:陆彬彬
联系人:邓秀男
联系电话:0571-56028620
业务传真:0571-56899710
客服热线:400-007-0065
公司网站:www.jincheng-fund.com

(119)公司名称:东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)
法定代表人:魏庆华
联系人:汤翼飞
联系电话:010-66555316
业务传真:010-66555246
客服热线:4008888893
公司网站:www.dxzq.net.cn

(120)公司名称:北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:丁宁
联系人:赵睿春
联系人:魏静
联系电话:010-57418829
业务传真:010-57569671
客服热线:400-078-5095
公司网站:www.niujiu.net

(121)公司名称:上海久谦财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢109室
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人:赵惠蓉
联系人:徐金华
联系电话:021-69695825
业务传真:021-69682927
客服热线:400-021-9898
公司网站:www.jfcta.com

(122)公司名称:深圳市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:深圳市福田区金融大街35号 国际企业大厦503C9层
法定代表人:杨晓
联系人:张磊
电话:010-58325395
业务传真:010-58325282
客服热线:4008507771
公司网站:https://t.jrj.com

(123)公司名称:大同证券经纪有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人:董祥
联系人:薛建
联系电话:0351-4130322
业务传真:0351-4137986
客服热线:4007121212
公司网站:www.datsbc.com

(124)公司名称:中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、3层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法人代表:王兵
联系人:赵媛
联系电话:010-59539864
业务传真:010-59539806
客服热线:95162,400-8888-160
公司网站:www.cifco.net

(125)公司名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区天玥路10号15层1522室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路30号乐成中心A座23层
法人代表:赵越
联系人:陈娜
联系电话:010-57766019
业务传真:010-57766199
客服热线:400-786-8868-5
公司网站:www.chtfund.com

(126)公司名称:嘉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、北京朝阳区建国路91号金地中心A座6楼
法定代表人:赵学军
电话:021-20289890
传真:021-20280110
网站:www.harvestwm.cn
客服电话:400-021-8850

(127)公司名称:北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁睿
联系人:张福瑞
电话:010-66154828-809
业务传真:010-88067526
客服热线:010-66154828
公司网站:www.5irich.com

(128)名称: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SOHO现代城1609
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城1609
法定代表人:沈伟彬
联系人:程刚
联系电话:010-52855713
业务传真:010-86394285
客服热线:400-6099-200
公司网站:www.yixinfund.com

(129)名称:中经北证(北京)资产管理有限公司
公司简称:中经北证
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人:徐福瑞
联系人:陈莹莹
业务电话:010-83831550
客服热线:010-68989820
公司网站:www.bzfunds.com

(130)名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
公司简称:一路财富
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门内大街2号万通新世界广场A座22层
法定代表人:吴雪涛
联系人:刘栋
电话:010-8312877-8009
业务传真:010-83132099
客服热线:400-001-1566
公司网站:www.yilucaifu.com

(131)名称:中经北证(北京)资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号新华1949产业园东门
法定代表人:徐福瑞
联系人:陈莹莹
业务电话:010-83831550
客服热线:010-68989820
公司网站:www.bzfunds.com

(132)名称: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号第一广场1501-1504
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人:林松
联系人:李智福
联系电话:0592-3122679
业务传真:0592-8000771
客服热线:0592-3122731
公司网站:www.xds.com.cn

(133)名称:北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人:王岩
联系人:胡明会
联系电话:010-59200855
业务传真:010-59200800
客服热线:400-819-9868
公司网站:www.dycfpofund.com

(134)名称:中信建投期货有限公司
注册地址:重庆渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、B名义11-A、B-4、B-9-B-C
办公地址:重庆渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人:彭文德
联系人:刘芸
联系电话:023-86769637
业务传真:023-86769629
客服热线:400-8877-780
公司网站:www.citic108.com.cn

(135)名称:中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。

(一)注册登记机构
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中3号4004-56室
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
法定代表人:王志伟

联系人:李尔华
电话:020-89188970
传真:020-89899175
(三)律师事务所和经办律师
名称:国浩律师(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦7楼
负责人:程荣
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:黄贞、周姗姗
联系人:程荣
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯刚
联系人:洪悦明
电话:021-61418888
传真:021-63365000
经办注册会计师:王明静、吴迪

四、基金名称
广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
五、基金的类型
股票型证券投资基金

本基金投资范围具有良好流动性的金融工具,包括中小板300指数成份股和备选成份股。新股(一级市场初次发行或增发)债券(包括国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于中小板300ETF的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金为中小板300ETF联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金。本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理可能会对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。

(一)资产配置策略
本基金主要投资于中小板300ETF,中小板300价格指数成份股和备选成份股,其中投资于中小板300ETF的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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、货币市场工具以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的5%。
本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)目标ETF投资策略
1.投资组合的构建
基金合同生效后,本基金主要按照标的指数的成份股的基准权重构建股票组合,并在建仓期内将股票组合转换成中小板300ETF,使本基金投资于中小板300ETF的比例不低于基金资产净值的90%。
2.投资组合的调整方式
(1)申购和赎回:中小板300ETF开放申购赎回后,通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。
(2)二级市场交易:中小板300ETF上市交易后,通过券商在二级市场进行中小板300ETF份额的买卖。

在基金的日常投资管理中,本基金将主要通过一级市场用股票组合申购和赎回目标ETF的基金份额,实现指数化投资目标。同时,本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标ETF基金份额。例如,在买入、卖出量小于最小申购、赎回单位时,基金管理人可通过二级市场直接买入、卖出目标ETF基金份额。这两种投资方式的选择,将首先要考虑交易便利性和市场流动性两个方面的问题;其次,在交易制度允许和市场流动性充分的前提下,通过综合考虑交易成本和价格优势,优化得出目标ETF的买入、卖出数量。
当中小板300ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应组合的调整,无须召开基金份额持有人大会。

3.投资组合的调整
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资中小板300ETF的时间和方式。
(1)当净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、中小板300ETF的申购或买入。
(2)当净赎回时,本基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定中小板300ETF的赎回或卖出。
(三)股票投资策略
1.股票组合构建原则
根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2.股票组合构建方法
本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小板指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法,根据中小板300价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如因受成份股停牌、成份股流动性不足或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当变通和调整,以更紧密的跟踪标的指数。
(1)定期调整
本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小板300价格指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2)不定期调整
基金经理将跟踪标的指数变动,基金组合跟踪偏离度情况,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。
针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间内卖出。

(四)债券投资策略
本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,主要投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。
(五)投资决策依据和决策程序
1.投资决策依据
有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金资产的决策依据。
2.投资管理程序
基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数的重大调整的策略;其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数的跟踪维护过程中的组合构建、调整决策,特别是对目标ETF成份股的投资决策。

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。
(1)、研究:数量投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标ETF一、二级市场特性和估值分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。
(2)、投资决策:投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资的日常管理。
(3)、组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理构建以目标ETF为主的投资组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(4)、交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。
(5)、绩效评估:金融工程部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合误差的来源和调整投资策略成功与否,基金经理可以据此总结 and 检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)、组合监控与调整:基金经理将跟踪目标ETF及标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。
(七)在确保基金组合持有人利益的前提下,有权利根据市场环境变化和实际需要对上述投资策略做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

九、业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中小板300价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

十、风险收益特征
本基金为ETF联接基金,风险和收益高于