

(上接A39版)

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系电话：(021) 23219000

传真电话：(021) 23219000

联系人：李笑鸣

联系电话：95653

公司网站：www.hhtsec.com

(26) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系电话：(021) 33389888

联系电话：(021) 33388224

联系人：黄莹

客服电话：95623或4008895523

公司网站：www.swhysc.com

(27) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉新华路特8号长江证券大厦

法人代表：杨泽华

联系电话：(027) 65799999

联系电话：027-85481900

联系人：李良

客服电话：96579或4008-888-999

公司网站：www.96579.com

(28) 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35楼、28层A02单

元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单

元

法人代表：牛冠兴

联系电话：(0755) 82568305

传真电话：(0755) 82568002

联系人：陈剑虹

客服电话：400-800-1001

公司网站：www.essence.com.cn

(29) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A

栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A

栋11楼

法人代表：林俊波

联系电话：021-68634510-8620

传真电话：(021) 68965680

联系人：赵小朋

客服电话：400-898-1561

公司网站：www.xcscc.com

(30) 国元证券有限责任公司

注册地址：合肥市寿春路179号

办公地址：合肥市寿春路179号

法人代表：蔡咏

联系电话：(0651) 62207935

联系电话：(0651) 62207935

联系人：李黎

客服电话：95678

公司网站：www.gyzq.com.cn

(31) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区滨水西道8号

法人代表：杜广平

联系电话：022-28451991

传真电话：022-28451892

联系人：蔡鑫

客服电话：400-651-5988

公司网站：www.bhzc.com

(32) 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

法人代表：吴万善

联系电话：0755-82569143

传真电话：0755-82492962

联系人：孔晓君

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

(33) 山西证券股份有限公司

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

法人代表：侯巍

联系电话：0351-8686659

联系电话：0351-8686659

联系人：郭晨

客服电话：400-666-1618、95673

公司网站：www.i618.com

(34) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20

层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20

层

法人代表：杨宝森

联系电话：0532-85022326

传真电话：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：95648

公司网站：www.citicsd.com

(35) 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

法人代表：张志刚

联系电话：010-63080985

联系电话：01063080978

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

公司网站：www.cindasc.com

(36) 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、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层

法人代表：潘鑫军

联系电话：021-63325888

传真电话：021-63326729

联系人：胡月娟

客服电话：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

(37) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法人代表：雷杰

联系电话：(010) 57389062

联系电话：(010) 57390058

联系人：徐锦福

客服电话：95671

公司网站：www.foundersc.com

(38) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1506号

办公地址：上海市静安区新闻路1506号

法人代表：薛峰

联系电话：021-22169999

联系电话：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：95658

公司网站：www.ebscn.com

(39) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法人代表：龚德雄

联系电话：(021) 53519888

联系电话：(021) 53519888

联系人：张瑾

客服电话：(021) 962618

公司网站：www.962618.com

(40) 大同证券经纪有限责任公司

注册地址：上海市城区迎宾路15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市市长治路111号山西世贸中心A座12、13层

法人代表：董泽

联系电话：0351-4130322

联系电话：0351-4130322

联系人：薛津

客服电话：0207121212

公司网站：www.dtsbc.com.cn

(41) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号平安国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路4018号平安国际交易广场8楼

法人代表：杨宇翔

联系电话：95511-8

联系电话：95511-8

联系人：吴昊

客服电话：95511-8

公司网站：www.pingan.com

(42) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F

法人代表：张燕峰

联系电话：(0755) 83709350

联系电话：(0755) 83704850

联系人：卢圣宇

客服电话：95663

公司网站：www.gzhzq.com.cn

(43) 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

法人代表：菅明军

联系电话：0371-69098882

传真电话：0371-65658599

联系人：程月艳

客服电话：0371-967218、400-813-9666

公司网站：www.cnew.com

(44) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门内大街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内大街3号国华投资大厦9层10层

法人代表：常浩

联系电话：(010) 84183333

联系电话：(010) 84183311-3389

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

(45) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成

国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成

国际大厦20楼2005室

法人代表：许建平

联系电话：010-88085858

联系电话：010-88085858

联系人：李巍

客服电话：4008-000-562

公司网站：www.hysec.com

(46) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法人代表：李伟

联系电话：0531-68889155

联系电话：0531-68889185

联系人：吴阳

客服电话：95638

公司网站：www.qqlzq.com.cn

(47) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：海口市深南大道4001号时代金融中心17层

法人代表：陆涛

联系电话：0755-83025022

联系电话：0755-83025625

联系人：马贤清

客服电话：400-8888-228

公司网站：www.jyzq.com

(48) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法人代表：姚文平

联系电话：021-68761616

联系电话：021-68767818

联系人：朱磊

客服电话：400 8888 128

公司网站：http://www.tebon.com.cn

(49) 华福证券有限责任公司

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

法人代表：黄真

联系电话：0591-87383600

联系电话：0591-87383610

联系人：张荣锐

客服电话：96326(福建省外请先拨0591)

公司网站：www.hfzq.com.cn

(50) 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

法人代表：李奇

联系电话：0931-4890208

联系电话：0931-4890628

联系人：李昕田

客服电话：(0931) 96668、4006898888

公司网站：www.hlzqsc.com

(51) 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甲6号SK大厦3层

法人代表：李剑阁

联系电话：010-69051166

联系电话：010-69051166

联系人：陶晖

客服电话：010-69051166

公司网站：http://www.cicc.com.cn

(52) 湘财证券有限责任公司

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

法人代表：程宜宏

联系电话：(010) 58328888

联系电话：(010)58328112

联系人：牟冲

客服电话：4008878827

公司网站：www.hhssecurities.com

(53) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法人代表：孙名扬

联系电话：0451-58563719

联系电话：0451-82287211

联系人：刘爽

客服电话：400-666-2288

公司网站：www.jhaz.com

(54) 大通证券股份有限公司

注册地址：大连市中山区人民路24号

办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层

法人代表：张智河

联系电话：0411-39673202

联系电话：0411-39673219

联系人：谢立军

客服电话：4008-169-169

公司网站：www.datong.com.cn

(55) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区东直门22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼

法人代表：王莉

联系电话：400-920-0022

联系电话：400-920-0022

联系人：于畅

客服电话：400-920-0022

公司网站：www.licaike.hexun.com

(56) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇康桥路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8楼

法人代表：汪静波

联系电话：021-3960-0672

联系电话：021-3960-2300

联系人：张姚杰

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(57) 深圳众禄基金控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、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1、J单

元

法人代表：薛峰

联系电话：0755-33227950

联系电话：0755-82080798

联系人：汤慕妮

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jmmw.

(58) 上海天天基金销售有限公司

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9楼

法人代表：其实

联系电话：021-54509988

联系电话：021-64385308

联系人：潘世友

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

(59) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区南汇新桥1118号鄂尔多斯大厦903-906室

法人代表：杨文斌

联系电话：(021) 58870011

联系电话：(021) 68596916

联系人：张茹

客服电话：4007009665

公司网站：www.ehowbuy.com

(60) 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2-西路1218号1楼202室

办公地址：杭州市滨江区江南大道368号恒生大厦12楼

法人代表：陈柏青

电话：60898740

联系电话：0571-26689713

联系人：张裕

客服电话：4000766123

公司网站：www.fund123.cn

(61) 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565号裕景国际B座16层

法人代表：张凯伟

联系电话：021-58788678-8201、13565790204

联系电话：021-58787698

联系人：沈雯雯

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.eichfund.com

(62) 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900室

办公地址：浙江省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

联系电话：0571-86800423

联系人：吴强

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

(63) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外大街北里2号民建大厦6层

法人代表：闫振杰

联系电话：(010) 62020088

联系电话：(010) 62020088

联系人：宋丽勇

客服电话：4008886661

公司网站：www.mylfund.com

(64) 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

法人代表：赵序军

联系电话：021-20289890

联系电话：021-20280110

联系人：张倩

客服电话：400-021-8860

公司网站：www.harvestwm.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

代理销售本基金，并及时公告。

2、场内代销机构

本基金的场内代销机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会

员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站。

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街17号

办公地址：北京西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：(010) 59378839

传真：(010) 59378907

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：廖海

(四) 审计基金财产的会计师事务所

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号东方广场东塔楼安永大

楼16层

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：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

股票型

本基金为增强型股票指数基金，力求对中证500指数进行有效跟

踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，

力争实现超越目标指数的投资收益，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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股

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，但须符

合中国证监会的相关规定。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的

90%，投资于中证500指数的成份股和备选成份股的资产不低于股票资产

的90%；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。

八、基金的投资策略

本基金以“指数化投资为主、主动型投资为辅”，在复制目标指数的

基础上，一定程度上调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指

数。

1、标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为中证500指数。中证500指数是中

证指数有限公司为反映市场上不同规模特征股票的整体表现，以沪深

300 指数为基准，构建的包括大、中、小盘、大中盘、中小盘和大小

盘指数在内的规模指数体系中的中间成分股。中证500指数全称“中

国中小盘500指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含

了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中

小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中市值公司的整体状况。

如果中证500指数被停止编制及发布，或中证500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中证500指

数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的

指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人法

律权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资

对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择

确定新的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人将于变更后在

中国证监会指定的媒体上公告。

2、指数化投资为主，主动性投资为辅：

本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数

中的基准权重为基础，利用富国定量投资策略在有限范围内进行超配或

低配调整，一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另

一方面在跟踪跟踪的同时力求超越跟踪。

富国研发的定量投资策略借鉴国内一流定量分析的应用经验，利用

多因子Alpha模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低

化的基础上优化投资组合。

(1) 多因子Alpha模型——股票超额回报预测

富国多因子Alpha模型对于中国股票市场的长期研究为基础，一定

程度上结合前瞻性市场判断，用精确的多个因子捕捉市场有效性暂时

缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现捕捉个股的超额回报。概

括来讲，本基金Alpha模型的因子可归为以下几类：价值(value)、动量

(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)。

这些类别综合了来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师及监

管政策等各方面信息。富国多因子Alpha模型利用富国长期积累并不断

扩展的数据库，科学客观地综合了大数据的各类信息。基金经理根据市

场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调

整各因子类别的权重组合及权重。

(2) 风险估值模型——有效控制风险预算

指数化资产配置跟踪误差最小，主动性投资策略需要适度风险预算的

支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研

发的风险估值模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合

进行监控与评估。其中，跟踪误差为个股、监控指标，跟踪偏离度为组

合监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比

较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差超

过7.75%。

(3) 交易成本模型——控制成本并保护业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效

应，在控制成本最低的基础上减少交易造成的负业绩影响。

(4) 投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。

其选股范围将以成份股为主，并不包括非成份股中与成份股相关性强、

流动性好、基本面信息充足的股票。

3、对目标指数的跟踪调整：

(1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份

股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数公司每年年审核一次中证

500指数成份股。本基金将按照中证50