广发纳斯达克100指数证券投资基金招募说明书【更新】摘要

[2016年1号]

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
时间:二〇一六年三月

【重要提示】

本基金于2012年4月26日经中国证监会证监许可[2012]568号文核准。本基金基金合同于2012年8月15日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

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,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。本基金投资于美国证券市场,基金净值会因为美国证券市场波动、汇率变动等因素产生波动。

本摘要根据本基金合同和本基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。投资有风险,投资人拟认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》与《基金合同》,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险,基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年2月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日。

第一部分 基金的名称

广发纳斯达克100指数证券投资基金

第二部分 基金的类型

契约型开放式

第三部分 基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。

第四部分 基金的投资范围

本基金投资范围为美国证券市场中的纳斯达克100指数成份股、备选成份股、以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金(ETF)、新股(一级市场初次发行或增发)等,其中,对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%,对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金(ETF)的投资比例不高于基金资产净值的10%,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%。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的,基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可相应调整本基金的投资比例规定,不需经基金份额持有人大会审议。

第五部分 基金的投资策略

一、基金的投资策略

(一)资产配置策略

本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。

本基金对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%,对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金(ETF)的投资比例不高于基金资产净值的10%,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%。

(二)权益类投资策略

1.股票组合构建原则

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克100指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。

2.股票组合构建方法

本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果以可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,使基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近标的指数的收益率。

3.股票组合调整

(1)定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的纳斯达克100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

1)与指数相关的调整

当标的指数成份股权增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据指数公司发布的调整决定及其调整日期,进行相应调整。

2)申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3)其他调整

对于标的指数成份股,若因其出现停牌限制,存在严重的流动性困难,或者财务风险较大,或者面临重大的不利的司法诉讼,或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

4.投资组合绩效评估

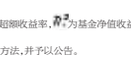
本基金对投资组合进行监控与评估时,以跟踪偏离度为核心监控指标,跟踪误差为辅助监控指标,对投资组合的日常调整以最小化跟踪偏离度为原则,以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

(1)核心监控指标:跟踪偏离度

第n日跟踪偏离度为第n日基金份额净值增长率减去第n日基金业绩比较基准增长率后的绝对值。

(2)辅助监控指标:跟踪误差

跟踪误差一般考察的是一段交易时间内投资组合日收益率与比较基准日收益率的偏离情况,计算公式如下:



其中:R_t为基金跟踪误差,R_{pt}为基金份额净值增长率,R_{bt}为基金净值收益率,R_t为基准收益率,T为历史天数。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并以公告。

(三)固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

(四)衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品,如与标的指数成标的指数成份股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具,本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略,对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险,以及利用金融衍生产品的杠杆作用,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低合位频繁调整带来的交易成本。

二、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财产的决策依据。

2.投资管理体制

本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重大调整的应对决策、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跟踪操作过程中的组合构建、调整决策。

3.投资程序

研究支持、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组合的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究支持:国际业务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,并展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、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顾问业务部提供的研究报告,定期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,进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方式构建组合。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:中央交易部负责具体的交易执行,即时履行一线监控的职责。

(5)绩效评估:监察稽核部定期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,跟踪误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此总结和检讨投资策略,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结果等,对投资组合进行调整,实现跟踪标的目标。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并予以公告。

第六部分 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为纳斯达克100指数(NASDAQ-100 Index)。

当指数编制单位停止标的指数的编制发布,或变更标指数标方法使标的指数不宜继续作为标的指数,或取消对本基金使用标的指数的授权等情况本基金管理人和托管人将根本基金无法继续以标的指数为基准,经双方协商,并在履行基金合同规定的程序,在不损害基金份额持有人合法权益的原则,依据具体情况分析拟采用的标的指数变更方案基本会对基金份额持有人利益产生实质性不利影响,经与基金托管人协商一致后决定是否采用该开基基金份额持有人大会的方式决定标的指数变更事宜,如决定不召开基金份额持有人大会,则应及时报中国证监会备案并公告。

第七部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

第八部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	198,434,733.53	70.87
	其中:普通股	198,386,564.51	69.43
	存托凭证	4,049,169.02	1.45
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	11,577,692.30	4.13
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中:远期	-	-
	期货	0.00	0.00
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,577,464.24	9.85
8	其他各项资产	42,401,232.17	15.14
9	合计	279,991,022.24	100.00

(二)报告期末在各个国家(地区)证券市场投资股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	198,434,733.53	80.79
合计	198,434,733.53	80.79

注:1.国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。
2.上述类国比重包括正股地为开曼群岛、百慕大和英国在美国上市的ADR。

(三)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	2,961,181.26	1.20
非必须消费品	41,009,647.08	16.70
必须消费品	13,560,774.56	5.52
保健	29,189,836.24	11.88
金融	-	-
信息技术	109,544,726.01	44.60
电信服务	2,178,568.38	0.89
公共事业	-	-
合计	198,434,733.53	80.79

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	32,259.00	22,049,553.48	8.98
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	46,219.00	16,651,084.71	6.78
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,712.00	11,932,857.63	4.85
4	ALPHABET INC-CLC	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,999.00	9,850,798.47	4.01
5	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	13,137.00	8,928,170.25	3.64
6	ALPHABET INC-CLA	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,686.00	8,517,816.55	3.47
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	27,306.00	6,108,251.92	2.49
8	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	8,319.00	5,479,451.70	2.23
9	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	29,371.00	5,179,097.37	2.11
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	14,129.00	5,177,343.84	2.11

(五)报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期未持有债券。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-mini Mar16	0.00	0.00
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

(九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	11,577,692.30	4.71
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

(十)投资组合报告附注

1.根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责处罚。

2.报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	8,026,213.11
3	应收股利	90,476.04
4	应收利息	1,056.46
5	应收申购款	2,242,491.56
6	其他应收款	32,040,995.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,401,232.17

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

第九部分 基金的业绩

本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准(GIPS)。

1.在业绩表述中采用统一的货币;

2.按照GIPS的相关规定和标准进行计算;

3.如果GIPS的标准与国内现行要求不符,同时公布不同标准下的计算结果,并说明其差异;

4.对外披露时,需要注明业绩计算标准是符合GIPS要求的。

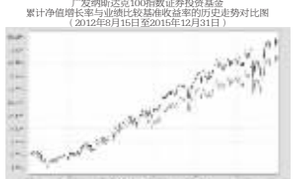
(二)基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(1)本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012.8.15-2012.12.31	-4.5%	0.67%	-4.37%	0.92%	-0.13%	-0.25%
2013.1.1-2013.12.31	29.53%	0.74%	31.04%	0.76%	-1.51%	-0.02%
2014.1.1-2014.12.31	16.14%	0.84%	22.46%	0.97%	-6.32%	-0.03%
2015.01.01-2015.12.31	17.19%	1.16%	14.70%	1.17%	2.49%	-0.01%
2012.8.15-2015.12.31	68.36%	0.91%	70.50%	0.96%	-1.14%	-0.04%

(2)本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

广发纳斯达克100指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的比较对比图
(2012年8月15日至2015年12月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定

第十部分 基金管理人

一、概况

1.名称:广发基金管理有限公司

2.住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室

3.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

4.法定代表人:王志伟

5.设立时间:2003年8月5日

6.电话:020-83936666

全国统一客服热线:95105828

7.联系人:段西军

8.注册资本:12.288亿元人民币

9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券"),烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司,分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师,兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省第十届政协委员,广东省第十届政协委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授,历任广东省第十届政协委员,广发证券董事长兼党委书记,广东发展银行党组成员兼银行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行营业部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

秋传军:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会副东局长兼研究与政策发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理,基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可相应调整本基金的投资比例规定,不需经基金份额持有人大会审议。

第十二部分 境外托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰千柒佰玖拾壹亿肆千柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人:王水民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称,为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在瑞内,外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2015年12月31日,中国银行已托管418只证券投资基金,其中境内基金390只,QDII基金28只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

第十二部分 境外托管人

名称:[中国银行(香港)有限公司]

住所:[香港花园道1号中银大厦]

办公地址:[香港花园道1号中银大厦]

法定代表人:[岳毅总裁]

成立时间:[1964年10月16日]

组织形式:[股份有限公司]

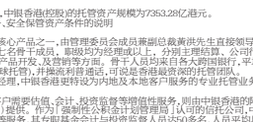
存续期间:[持续经营]

联系人:[吴晓仪 副总经理 托管业务主管]

联系电话:[852-3962-3753]

中国银行(香港)有限公司,("中银香港")早于1964年成立,并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司,是一家在香港注册持牌银行。其控股公司—中银香港(控股)有限公司,于2001年2月在香港注册成立,并于2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市,2002年12月23日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至2014年12月月底,中银香港(控股)有限公司的总资产超过21,893亿港元,资本总额超过1,815亿港元。总资本比率为17.51%,中银香港的财务实力及双A级信用评级,可以赢美不少大型全球托管银行,中银香港(控股)最新信评如下(截至2014年12月31日):



中银香港(作为香港第二大银行集团,亦为三家本地发钞银行之一,拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一,目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于海外国内合资业务机构性客户包括券商QDII及其理财产品等),亦素有经验,于行业处于领先地位。自进入2006年被委任为国内首只银行类QDII产品之境外托管人,及于2007年被委任为国内首只券商QDII集成计划之境外托管行等,其业务专长及全方位的配备,令中银香港成为目前本地唯一的中资全面托管业务全球托管银行,亦是唯一荣获《亚洲投资人杂志》颁发奖项的中资托管行(2012年服务提供者奖项)最佳跨境托管亚洲银行奖),连在2013年荣获《银行家》(The Banker)选为《香港区最佳银行奖》以及财资杂志(The Asset)颁发资产服务奖项之《最佳QFII托管银行奖》。

截至2014年12月31日止,中银香港(控股)托管资产规模为7353.28亿港元。

(一)托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

1.主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一,由管理委员会成员兼副总裁黄洪先生直接领导,针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现拥有十七名骨干成员,其成员经验丰富,其中六人具有硕士以上、分别主修法律、财务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、及营销等方面。骨干人员均来自各大跨国银行,平均具备15年以上的专业托管工作经验包括本地托管及全球托管),并拥有并普通话,可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理,中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队,以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外,若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务,则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司("中银保诚")提供。作为"强制性公积金计划管理局"认可的信托公司,中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务,其专职估值会计与投资监督人员达50多名,人员平均具备10年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视,有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外,其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提升,力求以最高水平服务各机构性客户。

(二)安全保管资产条件

在安全保管资产方面,为了消楚区分托管客户资产与银行拥有的资产,中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除某些特别情况外或法例要求外,所有交易均通过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户,并存放于该托管人或存管机构内,以确保客户权益。至于在跨地市场进行证券交易所需之跨国汇款,除非市场/存托机构/次托管行等另有要求,否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项,以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为"Custody & Securities System"或简称CSS,是中银香港聘用一支科技专家,并结合银行内部的专才,针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS整个系统构建在环球平台上,以IBM PS系列AIX运行,系统需要用两台服务器,主要用作数据存储及交易记录系统软件,另外自附有备用服务器配合。此外,一台窗口服务器已安装NPS(Network File System,for Unix)模块,负责与AIX服务器沟通。

新系统除了采用先端科技开发,并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势,不单符合SWIFT-15022之要求,兼容Ile transfer等不同的数据传输,亦拥有庞大的容量(原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场交卖高峰期均运作如常,反观部分主要银行的系统则频频超过15小时)。

至于基金创值,会计核算以及投资监督服务,则采用自行研发的FAMEX系统进行处理,系统可相家多种货币、多种成本定价法及多种会计核算法,以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括:多种货币;多种外类;实时更新;支持庞大数据量;简易操作,方便用户。系统所支持的核算方法包括:权重平均(Weighted Average);后入先出(LIFO);先入先出(FIFO);其它方法可经与客户商讨后实施。系统所支持的估值方法有:以市场价格标明(Marking to Market);成本法;成本或市场价的较低者;入价与出价(Bid and other);分期摊法(Amortization);含息成息总(Clean/dirty);及其它根据证券类别的例外估值等。

第十三部分 相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务。

(1)广州分公司

地址:广州市南珠区琶洲大道东3号南塔17楼

直销中心电话:020-89899073 020-89899042

传真:020-89899069 020-89899070

(2)北京分公司

地址:北京市武区武武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层

传真:010-68083068

传真:010-68083078

(3)上海分公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室

传真:021-68885310

传真:021-68885200

(4)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn

本公司网址:www.gffunds.com.cn

客服电话:95105828(免长途费)或020-83936999

客服传真:020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2.代销机构

(1)名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

联系人:赵奕军

电话:010-66107900

传真:010-66107914

客服电话:95588

公司网站:www.icbc.com.cn

(2)名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

电话:020-87555888

传真:020-87557985

客服电话:95575或致电各地营业网点

公司网站:www.gf.com.cn

(3)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

(4)名称:中国农业银行股份有限公司

住所:北京市建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

客服电话:95599

公司网站:www.abchina.com

(5)名称:中国银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:田国立

客服电话:95566

传真:010-66594946

公司网站:www.boc.cn

(6)名称:交通银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路188号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:牛锦明

联系人:曹晖

电话:021-58781234

传真:021-58408483

客户服务电话:95559

公司网站:www.bankcomm.com

(7)名称:招商银行股份有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:缪荣宁

客服电话:95555

公司网站:www.cmbchina.com

(8)名称:上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

电话:021-61618888

传真:021-63604199

联系人:倪苏云,虞合云

客服电话:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

(9)名称:兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路154号

办公地址:上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人:高建平

联系人:刘玲

电话:021-52629999

客服电话:95561,或拨打当地咨询电话

公司网站:www.cib.com.cn

(10)名称:上海银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路168号

法定代表人:宁黎明

联系人:张洋

电话:021-68475888;

传真:021-68476111

客服电话:021-962888

公司网站:www.bankofshanghai.com

(11)名称:中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

联系人:董云巍

电话:010-58560666

传真:010-57092611

客服电话:95568

公司网站:www.cmbc.com.cn

(12)名称:中国光大银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人:唐双宁

联系人:薛军朋

电话:010-63098777

客服电话:95595(全国)

公司网站:www.cebbank.com

(13)名称:中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:常振明

联系人:廉路盛

联系电话:010-65557048

业务传真:010-65550827

客服热线:95558

公司网站:www.bank.ecitic.com

(14)名称:北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

联系人:谢小华

电话:010-66226587

传真:010-66226945

客户服务电话:95526

公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(15)名称:青岛银行股份有限公司

注册地址:山东省青岛市市南区香港中路68号

法定代表人:郭少泉

联系人:滕宾

联系电话:0532-85709787

传真:0532-85709799

客服电话:(青岛)96588,(全国)400-66-96588

公司网站:www.qdcbc.com

(16)名称:浙商银行股份有限公司

注册地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号

办公地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号

法定代表人:张达洋

联系人:毛寅海

联系电话:0571-87659546

传真:0571-87659188

客服电话:95527

公司网站:www.czbank.com

(17)名称:渤海银行股份有限公司

住所:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人:李伏安

联系人:王宏

电话:022-58316666

传真:022-58316569

客户服务热线:4008888811

公司网站:www.cbhb.com.cn

(18)名称:哈尔滨银行股份有限公司

注册地址:哈尔滨市道里区尚志大街160号

办公地址:哈尔滨市道里区尚志大街160号

法定代表人:郭志文

联系人:王超

电话:0451-87779007

传真:0451-87779218

客服电话:95537

公司网站:www.hrbb.com.cn

(19)名称:东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址:东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址:东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人:何沛文

联系人:何沛文

电话:0769-22866255

传真:0769-22866262

客服电话:961122

公司网站:www.drcbank.com

(20)名称:北京农村商业银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街乙5号

办公地址:北京市西城区金融大街乙5号金融街中心B座

法定代表人:乔瑞

联系人:王薇娜

联系电话:010-63229475

传真:010-63229763

客服电话:010-96198

公司网站:www.bjrcb.com

(21)名称:南京银行股份有限公司

注册地址:江苏省南京市江下区鱼嘴路50号

办公地址:南京市中山路288号3楼个人业务部

法人代表:林复

联络人:曹俊

联系电话:025-86775337

客服电话:96400,40088-96400

网址:www.ncbcom.cn

(22)名称:河北银行股份有限公司

注册地址:石家庄市平安北大街28号

办公地址:石家庄市平安北大街28号

法定代表人:乔志强

联系人:王凯

电话:0311-88627522

传真:0311-88627027

客服电话:400-612-9999

网址:www.hebbank.com

(23)名称:江苏吴江农村商业银行股份有限公司

注册地址:苏州市吴江区中山南路1777号

办公地址:苏州市吴江区中山南路1777号

法人代表:陆玉根

联络人:王敏

联系电话:0512-63969841

客服电话:4008996068,0512-96068

传真:0512-63969962

网址:www.wjrcb.com

(24)名称:广东顺德农村商业银行股份有限公司

注册地址:广东顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路2号

办公地址:广东顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路2号

法定代表人:吴海恒

联系人:何浩华

电话:0757-22388928

传真:0757-22388235

客服电话:0757-22223388

网址:www.zdebank.com

(25)名称:包商银行股份有限公司

注册地址:内蒙古包头市钢铁大街6号

办公地址:内蒙古包头市钢铁大街6号

法人代表:李镇西

联络人:刘芳

联系电话:0472-5189051

客服电话:内蒙古地区:0472-96016

北京地区:010-96016

宁波地区:0574-967210

深圳地区:0755-967210

成都地区:028-65568555

传真:0472-5189057

网址:www.bcb.com.cn

(26)名称:杭州银行股份有限公司

注册地址:杭州市庆春路46号

办公地址:中国杭州市庆春路46号

法人代表:吴