诺安中证100指数证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

(一)诺安中证100指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会2009年8月28日证监基金字【2009】864号文核准公开募集,本基金的基金合同于2009年10月27日正式生效。

(二)基金管理人保证本《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。

(三)投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于申购本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场系统性风险、上市公司风险、利率风险、流动性风险、管理风险、本基金特有风险、跟踪误差风险及其他风险等。

本基金属于股票型指数基金,可获取资本市场平均收益率,其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)已经基金托管人复核,所载内容截止日为2010年4月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年3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

公司名称:诺安基金管理有限公司

住所:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层

法定代表人:秦维舟

设立日期:2003年12月9日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2003】132号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.5亿元人民币

存续期限:持续经营

电话:0755-83026688

传真:0755-83026677

联系人:魏红

股权结构:

股东单位	出资额(万元)	出资比例
中国对外经济贸易信托投资有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
北京中关村科学城建设股份有限公司	3000	20%
合　计	15000	100%

(二)证券投资基金管理情况

截至2010年4月底,本基金管理人共管理十只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金。

(三)主要人员情况

1. 董事会成员

秦维舟先生,董事长,工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理、香港昌维发展有限公司总经理、香港先锋投资有限公司总经理、中国新纪元有限公司副总裁、诺安基金管理有限公司副董事长。

杨目理先生,副董事长,工商管理硕士。历任中国中化集团资产管理部总经理助理、中国对外经济贸易信托有限公司总经理助理、副总经理、总经理。

江彪先生,董事,经济学硕士,高级经济师。历任海南科技工业公司总经理、深圳金图实业股份有限公司董事长、中国新纪元有限公司董事长、北京中关村科学城建设股份有限公司总裁。

欧阳文安先生,独立董事,工程师。历任中共北京市委副秘书长兼办公厅主任、中共北京市石景山区委书记、中共北京市委常委、秘书长、北京国际电气工程公司董事长、北京国际电力开发投资公司董事长。

朱秉刚先生,独立董事,教授级高级经济师。历任石油部计划司副司长、中国石油天然气集团公司计划局局长、中国石油天然气集团公司咨询中心副主任。

陆南屏先生,独立董事。历任新华社香港分社办公厅综合处处长、办公厅副主任、国际问题研究中心办公室主任、国家外汇管理局办公室主任、政策法规司司长、副局长。

2. 监事会成员

窦虔,经济学硕士,历任中国机械进出口总公司部门经理、联合证券投行部项目经理、中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵星明先生,监事,金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长、深圳证券交易所理事会秘书长、君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生,监事。历任浙江证券深圳营业部交易主管、国泰君安证券公司部门主管、诺安基金管理有限公司中央交易室主管。

3. 经理层成员

奥成文先生,总经理,经济学硕士,经济师。曾任中国通用技术(集团)控股有限责任公司资产经营部副经理、中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002年10月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作,任公司督察长、现任公司总经理。

杨文先生,副总经理,企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员、中融基金管理公司市场部经理。2003年8月加入诺安基金管理有限公司,历任市场部总监、发展战略部总监、现任公司副总经理。

杨谷先生,副总经理,经济学硕士,CFA。1998年至2001年任平安证券公司综合研究所研究员;2001年至2003年任西北证券公司资产管理部研究员。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理。

陈勇先生,督察长,经济学硕士。曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理、民生证券公司证券投资总部副总经理。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、研究部总监,现任公司督察长。

4. 基金经理

王坚先生,清华大学会计学专业,CFA,具有基金从业资格。曾任长城证券研究所研究员、太平资产管理公司投资经理。2008年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2009年10月起任诺安中证100指数证券投资基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员的姓名及职务

投资决策委员会由五名成员构成。委员会主席由公司总经理奥成文先生担任,委员包括:杨谷先生,副总经理、投资总监、基金经理;王鹏先生,投资副总监、基金经理;林健标先生,基金经理;王创峰先生,研究部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

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55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2010年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工125人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2010年3月,托管证券投资基金152只,其中封闭式9只,开放式143只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初,中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力,被英国《金球托管人》和香港《投资理财》杂志"2009年度中国最佳托管银行",本届《投资理财》杂志首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项,中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获"年度最佳托管银行家"称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得22项国内外大奖。

三、相关服务机构

1. 诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、北京、上海、广州开设四个直销网点对投资者办理开户和申购、赎回等业务:

①深圳直销中心

办公地址:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层

邮政编码:518048

电话:0755-83026688

传真:0755-83026677

联系人:张逸凡

②北京分公司

办公地址:北京市朝阳区光华路甲14号901室

邮政编码:100020

电话:010-65863688

传真:010-51309999

联系人:孟佳

③上海分公司

办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔2208室

邮政编码:200120

电话:021-68824795

传真:021-68824617

联系人:屈慧华

④广州分公司

办公地址:广州市天河区黄埔大道西76号富力盈隆广场3908

邮政编码:510623

电话:020-38393680

传真:020-38393680

联系人:莫昕

2. 基金代销机构

①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55号

法定代表人:姜建清

电话:010-66107900

传真:010-66107914

联系人:田耕

客户服务热线:95588

网址:www.icbc.com.cn

②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:郭树清

电话:010-66275654

联系人:王琳

客户服务热线:95533

网址:www.ccb.com

③交通银行股份有限公司

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:蒋超良

电话:021-58781234

传真:021-58408842

联系人:曹榕

客户服务热线:95559

网址:www.bankcomm.com

④招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

电话:0755-83198888

传真:0755-83195109

联系人:兰奇

客户服务热线:95555

网址:www.cmbchina.com

⑤深圳发展银行股份有限公司

注册地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:法兰克纽曼

电话:0755-82088888

传真:0755-82080714

联系人:周勤

客户服务热线:95501

网址:www.sdb.com.cn

⑥北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街丙17号首层

法定代表人:闫冰竹

联系人:王曦

联系电话:010-66223584

客户服务热线:010-96169(北京)022-96269(天津)021-53599688(上海)029-85766888(西安)0755-23957088(深圳)0571-86590900(杭州)

网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑦平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

电话:40066-99999 0755-961202

传真:0755-25879453

客户服务热线:40066-99999 或 0755-961202

网址:www.18ebank.com

⑧宁波银行股份有限公司

住所及办公地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

电话:021-63586189

传真:021-63586215

联系人:钱颖旺

客户服务热线:96528、962528(上海地区)

网址: www.nbcb.com.cn

⑨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

联系人:汤嘉惠、倪苏云

电话:021-61618888

传真:021-63604199

客户服务电话:95528

网址:www.spdb.com.cn

⑩温州银行股份有限公司

住所及办公地址:温州市车站大道华海广场1号楼

法定代表人:夏瑞洲

电话:0577-88990082

传真:0577-88995217

联系人:林波

客户服务热线:0577-96699

网址:www.wzbank.cn

⑪杭州银行股份有限公司

注册地址:中国·杭州凤起路432号

办公地址:中国·杭州凤起路432号

法定代表人:马时雍

客户服务电话:0571-96523、400-8888-508

网址:www.hzbank.com.cn

⑫兴业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)

办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)

法定代表人:吴建

联系人:李慧

电话:010-85238670

传真:010-85238680

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

⑬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

法定代表人:董文标

电话:010-58351666

传真:010-83914283

联系人:李群

客户服务热线:95568

网址:www.cmbc.com.cn

⑭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

法定代表人:孔丹

联系人:秦莉

电话:010-65546655-108

传真:010-65542373

客户服务电话:95558

网址: bank.ecitic.com

⑮江苏银行股份有限公司

注册地址:南京市洪武北路55号

办公地址:南京市洪武北路55号

法定代表人:黄志伟

联系人:田春慧

电话:025-58588167

传真:025-58588164

客户服务电话:400-86-96098、96098

网址:www.jsbchina.cn

⑯招商君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-213

传真:021-62569400

联系人:丙敏祺

客户服务热线:4008-888-666

网址:www.gtja.com

⑰申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路239号2楼

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54038844

联系人:孙洪喜

客户服务电话:021-962505

网址:www.sywg.com.cn

⑱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35号国际企业大厦C座2-6层

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层

法定代表人:顾伟国

电话:010-66568047

传真:010-66568116

联系人:李洋

客户服务热线:400-8888-888

网址:www.chinastock.com.cn

⑲中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

开放式基金咨询电话:4008888108

开放式基金业务传真:010-65182261

联系人:权唐

网址: www.csc108.com

⑳广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖中梅

客户服务热线:95575或致电各地营业网点

开放式基金业务传真:020-87555305

网址:www.gf.com.cn

㉑中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人:王东明

电话:010-84683893

传真:010-84865560

联系人:陈忠

客户服务热线:010-84588888

网址:www.cs.ecitic.com

㉒光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联络人:戴荻

联系电话:010-68084591

传真:010-68084986

客户服务热线:400-698-9898

网址:www.xsdzq.cn

㉓东北证券股份有限公司

注册地址:吉林省长春市自由大路1138号

办公地址:吉林省长春市自由大路1138号证券大厦

法定代表人:矫正中

联系人:潘锦

电话:0431-85096709

客户服务热线:0431-96688-0 或 0431-85096733

网址:www.nesc.cn

㉔齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经十路20518号

办公地址:山东省济南市经十路20518号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

开放式基金咨询电话:0531-81283906

开放式基金业务传真:0531-81283900

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

㉕发源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

法定代表人:冯戎

基金业务对外联系人:李茂俊

基金业务对外联系人电话:010-62294608-6240

基金业务对外联系人传真:010-62296854

客户服务热线:0991-4008000562

网址:www.hysec.com

㉖山西证券股份有限公司

注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心A座26—30层

法定代表人:侯巍

联系人:张治国

联系电话:0351-8686703

传真:0351-8686619

客户服务电话:400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

㉗国联证券股份有限公司

注册地址:无锡市县前东街168号

办公地址:无锡市县前东街168号6楼、7楼

法定代表人:雷建辉

电话:0510-82831662

传真:0510-82830162

联系人:袁丽萍

客户服务电话:400-888-5288、0510-82588168

网址:www.glsc.com.cn

㉘新商证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市杭大路1号

办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6/7楼

法定代表人:吴承根

电话:0571-87902080

联系人:吴颖

客户服务电话:967777

网址:www.stocke.com.cn

㉙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

法定代表人:孙名扬

联系人:徐世旺

电话:0451-82336863

传真:0451-82287211

客户服务电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

㉚建银投资证券有限责任公司

注册地址:上海市南京西路758号23楼

办公地址:上海市南京西路758号

法定代表人:郭林

客户服务电话:021-63340678

网址:www.ajzq.com

㉛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23层

办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人:陈林

电话:021-501222222

联系人:楼斯佳

客户服务电话:400-820-9898

网址:www.cnhhstock.com

㉜中国民族证券有限责任公司

注册地址:北京市丰台区北路81号

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

邮政编码:100140

负 责 人:赵大建

客户服务电话:400-889-5618

网址:www.e5618.com

㉝财通证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市解放路111号

办公地址:浙江省杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人:沈继宁

客户服务电话:0571-96336

网址:www.ctsec.com

㉞信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客户服务电话:400-800-8899

网址:www.cindasc.com

㉟国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

全国统一客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

㊱平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层

法定代表人:杨宇翔

电话:400-8866-338

联系人:周璐

客户服务电话:4008816168

开放式基金业务传真:0755-82400862

网址:www.pingan.com.cn

㊲友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35层

法定代表人:牛冠兴

开放式基金咨询电话:4008001001

开放式基金业务传真:0755-82558355

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82558305

网址:www.essence.com.cn

㊳招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82960141

联系人:黄健

客户服务电话:95565 或 400-8888-111

网址:www.newone.com.cn

㊴中国建银投资证券有限责任公司

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18-21层

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18-21层

法定代表人:杨明辉

客户服务电话:4006-008-008

网址:www.cjis.cn

㊵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1号金源中心30楼

办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:游锦辉

电话:0769-22119426

联系人:张建平

客户服务电话:961130

网址:www.dgzq.com.cn

㊶长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦14/16/17层

办公地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦14/16/17层

法定代表人:黄耀华

电话:0755-83516289

联系人:匡婷

客户服务电话:400-6666-888

网址:www.cgws.com

㊷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:孔伯杰

联系人:张利军 陈书杉

客户服务电话:0471-6292465

网址:www.rxzq.com.cn

㊸江南证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市抚河北路291号江西教育出版社六楼

办公地址:江西省南昌市抚河北路291号江西教育出版社六楼

法定代表人:姚江涛

电话:0791-6768763

传真:0791-6789414

联系人:余雅娜

客户服务电话:400-8866-567

网址:www.scstock.com

㊹华泰联合证券有限责任公司(原联合证券有限责任公司)

注册地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、24、25层

办公地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

电话:0755-82492000

传真:0755-82492062

联系人:盛宗凌

客户服务电话:400-8888-555

网址:www.lhzq.com

㊺广发华福证券有限责任公司

注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人:黄金琳

客户服务电话:0591-96326

网址:http:/www.gfhfzq.com.cn

㊻华融证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区月坛北街26号

办公地址:北京市西城区月坛北街26号恒华国际商务中心9层

法定代表人:丁之锁

客户服务电话:01058568162

网址:http:/www.hrsec.com.cn

㊼大通证券股份有限公司

注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号

办公地址:大连市中山区延安路1号保嘉大厦15-16层

法定代表人:于宏民

客户服务电话:0411-82595188

网址:http:/ www.estock.com.cn

㊽大相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19 号富凯大厦B 座701

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人: 林义相

联系人:葵晓丽

联系电话:010-66045529

传真:010-66045500

客户服务电话:010-66045678

网址:www.txsec.com、www.txjijin.com

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。

3.注册登记机构

名称:诺安基金管理有限公司

住所:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层

法定代表人:秦维舟

电话:0755-83026688

传真:0755-83026677

4.出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:颜合律师事务所

住所:北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室

法定代表人负责人:付朝晖

电话:010-65178866

传真:010-65180276

经办律师:虞荣方

5.审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称:利安达会计师事务所有限责任公司

住所:北京朝阳区八里庄西里100号住邦2000一号楼东区2008室

法定代表人:黄锦辉

电话:010-85866870

传真:010-85866877

联系人:门燕

经办注册会计师:门燕、陈静

四、基金的名称

诺安中证100指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式基金

六、基金的投资目标

本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。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0.35%,年跟踪误差不超过4%。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数成份股、备选成份股、新股(如首次公开发行或增发)、债券,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。

本基金投资于股票组合的比例为基金资产净值的90%-95%,其中投资于相关标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

此外,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资理念

与主动式投资相比较,被动式投资有着运营成本较低、投资透明化等优点,本基金秉承被动式投资理念,以跟踪中证100指数为投资原则,通过投资于同时具备较强市值代表性、较高流动性以及大盘蓝筹等特征的中证100指数成份股,力求获得该指数所代表的中国证券市场的平均收益,使投资者可以分享中国经济的长期增长。

九、基金的投资策略

本基金采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。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可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法,按照成份股在基准指数中证100指数中的基准权重构建股票投资组合。

当发生下列特殊情况时:

①因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依指数权重购买某成份股;

②预期标的指数的成份股即将调整;

③存在其他影响指数复制的因素。

基金经理可以根据市场情况,结合经验判断,对本基金投资组合进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

2、股票投资组合调整

①因基准指数成份股变动进行的调整

①定期调整

本基金股票指数化投资组合将根据基准指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法,以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

②不定期调整

当上市公司发生增发、配股、公司合并等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

当指数成份股权重发生变动时,对因股票停牌而无法交易的股票,本基金将用现金进行正向或逆向替代,待股票复牌后进行相应调整。

成份股在基准指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

②其他因素引起的调整

①新股因素

本基金将根据市场情况,决定是否参加首次公开发行(或增发)的新股市值配售与认购,由此得到的非基准指数成份股将在其规定持有期之后的30个交易日以内卖出;

②投资比例限制因素

根据法律法规中针对基金投资比例的限制规定,当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过法律法规的规定限制时,本基金将对投资组合进行相应调整,以保证基金投资行为的合法合规性;

③申购、赎回因素

本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整,以保证基金正常运行从而有效跟踪标的指数;

④法律法规因素

对于基金管理人、托管人和与其有控股关系的股东发行或者承销的基准指数成份股,法律法规禁止投资而本基金无法获得豁免的,将用技术方法对其进行替换。

3、现金管理

现金管理是指数基金投资管理的一个重要环节,主要由三方面内容组成:现金流预测、现金持有比例管理以及现金资产收益管理。

十、标的指数和业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证100指数。

中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股,综合反映了沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。其流动性高,可投资性强,适合作为本基金的标的指数。

如果中证指数有限公司变更或停止中证100指数的编制及发布、或中证100指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中证100指数不宜继续作为标的指数,或市场有其他更适合投资的指数,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后,变更本基金的标的指数,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

2、业绩比较基准

中证100指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在履行适当程序后,变更业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

十一、风险收益特征

本基金为股票型指数基金,可获取资本市场平均收益率,其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。

十二、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2010年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	1,623,874,181.43	96.07
	其中:股票	1,623,874,181.43	96.07
2	固定收益类投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	61,505,822.64	3.64
	其他资产	4,881,221.21	0.29
	合计	1,690,261,225.28	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,493,675.72	0.63
B	采掘业	202,497,173.05	12.09
C	制造业	314,062,880.31	18.76
C0	食品、饮料	60,413,235.30	3.61
C1	纺织、服装、皮毛	8,104,239.51	0.48
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,062,283.15	0.78
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	103,135,967.68	6.16
C7	机械、设备、仪表	124,940,067.93	7.46
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	4,407,086.74	0.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	62,833,398.99	3.75
E	建筑业	43,654,286.89	2.61
F	交通运输、仓储业	76,908,118.09	4.59
G	信息技术业	45,011,196.74	2.69
H	批发和零售贸易	23,757,361.98	1.42
I	金融、保险业	741,595,646.77	44.29
J	房地产业	81,639,390.34	4.88
K	社会服务业	11,227,073.55	0.67
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	10,140,699.00	0.61
	合计	1,623,820,901.43	96.98

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	53,280.00	0.00
C0	食品、饮料	17,500.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	20,800.00	0.00
C6	金属、非金属	14,980.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	53,280.00	0.00

(三)报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	5,545,128	90,274,683.84	5.39
2	601328	交通银行	8,092,669	67,007,299.32	4.00
3	600016	民生银行	8,383,659	64,470,337.71	3.85
4	601318	中国平安	1,276,576	64,339,430.40	3.84
5	600030	中信证券	2,056,425	58,443,598.50	3.49
6	601166	兴业银行	1,564,030	57,743,987.60	3.45
7	600000	浦发银行	2,348,071	53,489,057.38	3.19
8	601088	中国神华	1,458,012	42,136,546.80	2.52
9	000002	万 科A	4,324,350	41,081,325.00	2.45
10	601939	建设银行	6,811,570	38,621,601.90	2.31

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300060	苏州恒久	1,000	20,800.00	0.00
2	002385	大北农	500	17,500.00	0.00
3	002378	章源钨业	500	14,980.00	0.00

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期期末未持有债券。

(五)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

本基金本报告期期末未持有债券。

(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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

(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五名权证投资明细

本基金本报告期期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	636,847.70
2	应收证券清算款	3,723,300.00
3	应收股利	-
4	应收利息	15,206.57
5	应收申购款	505,866.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,881,221.21

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

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300060	苏州恒久	20,800.00	0.00	新发流通受限
2	002385	大北农	17,500.00	0.00	新发流通受限

十三、基金的业绩

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。

(一)本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2009.10.27~2009.12.31	0.10%	1.06%	3.52%	1.65%	-3.42%	-0.59%
2010.1.1~2010.3.31	-7.99%