汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2010年第2号)

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

汇添富上证综合指数证券投资基金(以下简称"本基金")经2009年5月8日中国证券监督管理委员会证监许可[2009]371号文核准募集。本基金基金合同于2009年7月1日正式生效。

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。

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资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资人拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,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,由于基金投资者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,等等。本基金是股票型基金,属证券投资基金中的较高风险收益品种。投资者应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的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

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。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按照《基金法》,基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2010年7月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人简况

名称:汇添富基金管理有限公司

住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼

法定代表人:桂水发

成立时间:2005年2月3日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字[2005]5号

注册资本:人民币1亿元

联系人:李文

联系电话:021-28932888

股东名称及其出资比例:

东方证券股份有限公司 47%

文汇新民联合报业集团 26.5%

东航金戎控股有限责任公司 26.5%

(二)主要人员情况

1.董事会成员

桂水发先生,董事长:国籍:中国,1965年出生,香港大学工商管理硕士,上海财经大学经济学学士。现任东方证券股份有限公司副总裁。曾在上海财经大学审计监察处任职、历任上海证券交易所上市部高级经理、北京办事处总经理、市场部总监等。

肖顺喜先生,董事:国籍:中国,1963年出生,复旦大学EMBA。现任东航金戎控股有限责任公司总经理、东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股(香港)有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理、东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生,董事,国籍:中国,1953年出生,高级编审,湘洋交大EMBA。现任文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理。历任上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编,上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长,上海文艺出版总社党委书记、副社长、总社总编辑等。

林利军先生,董事,总经理。国籍:中国,1973年出生,美国哈佛大学商学院工商管理硕士,复旦大学世界经济系硕士,历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理,曾任职于中国证监会创业板筹备工作组,哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团(State Street Global Advisor),从事投资和风险管理工作。

韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生,独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院资深访问学者。现为独立金融咨询顾问。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长、美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁、渣打银行台湾分行总裁、深圳发展银行行长。

华民先生,独立董事。国籍:中国,1950年出生,复旦大学经济学博士,教授,博士生导师。现任复旦大学经济学院学术委员会主任,复旦大学世界经济研究所所长,兼任世界经济系主任。上海市人民政府决策咨询专家,中国世界经济学会副会长,"国家中长期科技发展规划战略研究"咨询专家,上海市国际友人协会副会长等。

周瑞金先生,独立董事。国籍:中国,1939年出生,复旦大学新闻系毕业。现任中国生产力学会副会长,上海生产力学会会长,中国社会科学院研究生院博士生导师,复旦大学新闻学院、北京广播学院兼职教授。1992年获国务院表彰为有突出贡献的专家学者,终身享受政府特殊津贴。历任《解放日报》记者、编辑、评论部主任、副总编辑,党委书记兼副总编辑,《人民日报》社副总编辑兼华东分社社长。

2.监事会成员

任瑞良先生,监事长。国籍:中国,1963年出生,大学学历,中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

涂殷康先生,监事。国籍:中国,1970年出生,上海财经大学硕士研究生。现任东航金戎控股有限责任公司研发中心总经理,历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理等。

李进安先生,监事。国籍:中国,1968年出生,南京农业大学博士,中国注册会计师。现任东方证券股份有限公司合规总监。历任国泰君安证券股份有限公司南京大学南路营业部总经理,总裁办公室、BPR办公室常务副主任,东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王静女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理有限公司行政支持部总经理。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部、东航金戎控股有限责任公司研究发展部。

林旋女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理有限公司稽核监察部高级稽核监察经理。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

3.高管人员

桂水发先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

林利军先生,总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

李文先生,督察长。国籍:中国,1967年出生,厦门大学管理学博士,高级经济师,中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监督处科员,中国人民银行杏林支行副行长,中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理,金融机构监管二处副处长,东方证券股份有限公司稽核总部总经理,资金财务管理总部总经理等。

张晖先生,副总经理。国籍:中国,1971年出生,经济学硕士,历任申银万国研究所高级分析师、富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理。2005年4月加盟汇添富基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主席。

于东升先生,副总经理。国籍:中国,1971年出生,经济学博士,历任南方证券西安营业部总经理、计划财务管理总部副总经理,湘财证券华东管理总部总经理,市场总监,泰达荷银基金公司总经理助理、市场业务总监。2008年8月加盟汇添富基金管理有限公司,现任公司副总经理、首席市场官。

4.基金经理

何仁科先生,国籍:中国,1976年出生,华中科技大学数量经济学硕士,九年证券从业经验。曾任东方证券股份有限公司研究所高级经理。2004年12月加入汇添富基金管理有限公司,现任产品创新部总监、汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。

吴振翔先生,国籍:中国,1977年出生,中国科学技术大学管理学博士,四年证券从业经验。曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月19日加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员,2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。

5.投资决策委员会

主席:林利军先生(总经理)

副主席:张晖先生(副总经理)

成员:韩贤旺先生(研究总监)

6.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6月末,中国工商银行资产托管部共有员工121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6月,托管证券投资基金165只,其中封闭式9只,开放式156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,先后被美国《全球托管人》和香港《财资》评选为"2009年度中国最佳托管银行",本届《财资》评选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23项国内外大奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.汇添富基金管理有限公司直销中心

住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼

法定代表人:桂水发

电话:021-28932823

传真:021-28932803

联系人:丛菲

客户服务电话:400-888-9918(免长途话费)

网址:www.99fund.com

2.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:010-66106912

传真:010-66107914

联系人:田耕

客户服务电话: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

客户服务电话: 95533

公司网址:www.ccb.com

(3)中国银行股份有限公司

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:肖钢

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(4)中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

客户服务电话:95599

网址: www.95599.cn

(5)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(6)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

开放式基金咨询电话:95555

开放式基金业务传真:0755-83195049

联系人:邓炯鹏

网址:www.cmbchina.com

(7)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、虞谷云

客户服务电话:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

(8)中国光大银行股份有限公司

注册地址: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

电话:010-68098778

传真:010-68560312

联系人:李伟

客户服务电话:95595(全国)

网址:www.cebbank.com

(9)深圳发展银行股份有限公司

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

联系人:周勤

联系电话:0755-82088888

传真电话:0755-82080714

客服电话:95501

公司网址:www.sdb.com.cn

(10)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

联系电话:010-58351666

传真:010-83914283

联系人:董云巍、吴海鹏

客户服务电话:95568

公司网站:www.cmbc.com.cn

(11)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

客户服务电话:95558(全国)

网址:www.ecitic.com

(12)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: 张萍

电话:021-68475888

传真:021-68476111

客户服务电话:021-962888

网址:www.bankofshanghai.com.cn

(13)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

电话:0591-87839338

传真:0591-87841932

联系人:曾鸣

客户服务电话:95561

公司网址:www.cib.com.cn

(14)广东发展银行股份有限公司

注册地址:广州市农林下路83号

法定代表人:董建岳

客户服务热线:400-830-8003

网址:www.gdb.com.cn

(15)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号北京银行大厦首层

法定代表人:闫冰竹

联系人:王曦

电话:010-66223584

传真:010-66226073

客服电话:010-96169

网址:www.bankofbeijing.com.cn

(16)渤海银行股份有限公司

注册地址:天津市河西区马场道201-205号

办公地址:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人: 刘宝凤

开放式基金咨询电话:400-888-8811

联系人:王宏

联系电话:022-58316666

传真:022-58316259

网址:www.cbhb.com.cn

(17)华夏银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街22号

办公地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人: 吴建

联系人:郑鹏

传真:010-85238680

客户服务热线:95577

华夏银行公司网站: www.hxb.com.cn

(18)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

办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:萧立君

联系人:蔡宇洲

电话:0755-25859591

传真:0755-25878316

客服热线:40066-99999

网址:www.18ebank.com

(19)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

(20)东方证券股份有限公司

住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

电话:021-63325888

传真:021-63326173

联系人:吴宇

客服热线:95503

网址:www.dfzq.com.cn

(21)安信证券股份有限公司

住所: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:深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人: 牛冠兴

开放式基金咨询电话:0755-82558305

开放式基金业务传真:0755-82558355

统一客服电话:4008001001

联系人:陈剑虹

网址:http://www.essence.com.cn

(22)爱建证券有限责任公司

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20-25楼

法定代表人:郭林

电话:021-32229888

传真:021-62878783

联系人:陈敏

客户服务电话:021-63340678

网址:www.ajzq.com

(23)渤海证券股份有限公司

注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:王春峰

联系人:王兆权

电话:022-28451861

传真:022-28451892

客户服务电话: 400-651-5988

网址:www.bhzq.com

(24)财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼

法定代表人:周晖

客户服务电话:0731-84403319

传真:0731-84403349

联系人:郭磊

公司网址:www.cfzq.com

(25)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务热线:4008-888-999或027-85808318

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(26)德邦证券有限责任公司

注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人:方加春

开放式基金咨询电话:4008888128

开放式基金业务传真:021-68767981

联系人:叶蕾

联系电话:021-68761616*8019

网站:www.tebon.com.cn

(27)第一创业证券有限责任公司

住所:深圳市罗湖区罗岗路12号中民时代广场B座25层

办公地址:深圳市罗湖区罗岗路12号中民时代广场B座25层

法定代表人:刘学民

开放式基金咨询电话:4008881888

开放式基金业务传真:0755-82485081

联系人:魏颖

客户服务电话:0755-25832852

网址:www.fcsc.cn

(28)东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路1138号

公司网址:www.xzsec.com

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系人: 潘锦

电话:0431-85096709

客户服务电话:4006000686

网址:www.nesc.cn

(29)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼

法定代表人:朱科敏

联系人:李涛

电话:021-50586660-8966

传真:021-50819897

客户服务电话:400-888-8588、021-52574550、0519-88166222、0379-64902266

公司网址:www.longone.com.cn

(30)东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人:吴永敏

联系人:方晓丹

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

客服电话:0512-33396288

网址:http://dwzq.com.cn

(31)光大证券股份有限公司

住所: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

电话:021-22169999

传真:021-22169134

联系人:刘晓、李芳芳

客服热线:4008888788、10108998

网址:www.ebscn.com

(32)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:广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

联系人:黄岚

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)87555417

公司网站:广发证券网 www.gf.com.cn

(33)广发华福证券有限责任公司

住所: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:黄金琳

联系人:张腾

电话:0591-87383623

传真:0591-87383610

客户服务电话:96326(福建省外加拨0591)

(34)广州证券有限责任公司

住所:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼

办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼

法定代表人:吴志明

电话:020-87322668

传真:020-87325036

联系人:林洁茹

客户服务电话:020-961303

公司网址:www.gzs.com.cn

(35)国都证券有限责任公司

住所: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:王少华

联系人:黄静

客户服务电话:010-84183333

客户服务电话:400-818-8118

网址:www.guodu.com

(36)国金证券股份有限公司

注所:成都市东城根上街95号

办公地址:成都市等城根上街95号

法定代表人:冉云

联系人:金喆

客户服务电话:400-660-0109

网址:www.gjzq.com.cn

(37)国泰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

客户服务热线:4008888666

网址:www.gtja.com

(38)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

办公地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

开放式基金咨询电话:全国:95578

开放式基金业务传真:0551—2272100

联系人:陈琳琳

网址:www.gyzq.com.cn

(39)国信证券股份有限公司

住所: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

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

联系人:齐晓燕

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(40)海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021- 23219100

联系人:金芸、李笑鸣

客服电话:400-8888-001、021-95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.htsec.com

(41)恒泰证券股份有限公司

住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人:鞠瑾

联系人:张同亮

客户服务电话:021-68405273

公司网址:www.cnht.com.cn

(42)宏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

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

联系人:李巍

电话:010-88085858

传真:010-88085344

客户服务电话:4008-000-562

公司网址:www.hysec.com

(43)华安证券有限责任公司

注册地址:安徽省合肥市长江中路357号

办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦

法定代表人:李工

电话:0551-5161666

传真:0551-5161600

联系人:甘霖

电话:0551-5161821

客户服务电话:0551-96518/4008096518

网址:www.hazq.com

(44)华宝证券经纪有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

客户服务电话:400-820-9898

网址:www.cnhbstock.com

(45)华龙证券有限责任公司

住所:甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人:李晓安

联系人:李昕田

客服电话:0931-4890100、4890619、4890618

公司网址:www.hlzqgs.com

(46)华泰证券股份有限公司

住所: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

客户服务电话:95597

联系人:程高峰、万鸣

网址:www.htsc.com.cn

(47)华泰联合证券有限责任公司

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

联系人:盛宗凌

电话: 0755-82492000

开放式基金咨询电话:400-8888-555、95513

公司网址:www.lhzq.com

(48)江海证券有限公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区畅业路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区畅业路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:徐世旺

电话:0451-82336863

传真:0451-82287211

客户服务热线:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

(49)平安证券有限责任公司

住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

全国免费业务咨询电话:4008816168

开放式基金业务传真:0755-82400862

联系人:周璐 (zhoulu002@pingan.com.cn,0755-22626172)

网址:http://www.pingan.com

(50)齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路128号

办公地址:山东省济南市经十路17703号

法定代表人:李玮

电话:0531-82093938

传真:0531-81283900

联系人:吴阳

客户服务热线:95538

网址: www.qlzq.com.cn

(51)日信证券有限责任公司

住所:呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层

法定代表人:孔伯杰

联系人:张利军 陈韦杉

联系电话:(010)88086830

网址:www.rxzq.com.cn

(52)瑞银证券有限责任公司

住所: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:刘弘

电话:010-5922 6788

传真:010-5922 6840

联系人:谢亚凡

客户服务电话:400-887-8827

网址:www.ubssecurities.com

(53)山西证券股份有限公司

住所:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人:侯巍

电话:0351-8686703

传真:0351-8686619

联系人:张治国

客户服务电话:400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

(54)上海证券有限责任公司

注册地址:上海西藏中路336号

法定代表人:郁忠民

联系人:张瑾

客户服务电话:(021)962518

公司网站:www.962518.com

(55)申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54038844

联系人:邓寒冰

客户服务热线:962505

网址:www.sywg.com.cn

(56)天相投资顾问有限责任公司

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

联系电话:010-66045446

客服电话:010-66045678

传真:010-66045500

联系人:潘剑

天相投顾网址:www.txsec.com

天相基金网网址:www.jsjjjin.com

(57)西藏证券经纪有限责任公司

注册地址:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市辉河路118号

法定代表人:贾绍君

电话:021-65546079

传真:021- 65546079

联系人:刘宇

客服电话:400-88111-77或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.xzsec.com

(58)湘财证券有限责任公司

注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人:林俊波

联系人:钟康莹

电话:021-68634518

传真:021-68865680

客服电话:400-888-1551

公司网址:www.xcsc.com

(59)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

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(60)厦门证券有限公司

地址:厦门市莲前西路2号

客户服务电话:0592-5163588

公司网址:www.xmzq.cn

(61)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-38565785

联系人:谢高得

客服电话:4008888123

公司网站:www.xyzq.com.cn

(62)万联证券有限责任公司

注册地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人:张建军

开放式基金咨询电话:400-8888-133

开放式基金业务传真:020-22373718-1013

业务联系人:罗创斌

联系电话:020-37865070

网址:www.wlzq.com.cn

(63)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层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:林生迎

客户服务热线:95565、4008888111

公司网址:www.newone.com.cn

(64)英大证券有限责任公司

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:赵文安

联系人:王睿

电话:0755-83007069

传真:0755-83007167

客服电话:0755-26982993

网址:www.ydsc.com.cn

(65)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

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:顾伟国

开放式基金咨询电话:4008-888-8888

开放式基金业务传真:010-66568536

联系人: 田薇

联系电话:010-66568430

网址:www.chinastock.com.cn

(66)中国民族证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人:赵大建

电话:010-59355941

传真:010-66553791

联系人:李薇

客服电话:400-889-5618

网址:www.e5618.com

(67)中国建银投资证券有限责任公司

住所: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层至20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栋第18层至20层

法定代表人:杨明辉

电话:0755-82026521

传真:0755-82026539

联系人:刘权

网址:www.cjis.cn

(68)中信证券股份有限公司

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人:王东明

电话:010-84588888

传真:010-84865560

联系人:陈忠

公司网址:www.ecitic.com

(69)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

联系人:权唐

电话: 010-85130588

传真: 010-65182261

客户服务电话:400-8888-108

公司网址:www.csc108.com

(70)中信金通证券有限责任公司

注册地址:杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85776115

联系人:俞会荣

开放式基金咨询电话:0571-96598

开放式基金业务传真:0571-85783771

公司网址:www.bigsun.com.cn

(71)中银国际证券有限责任公司

住所:上海市浦东新区区银城中路中银大厦39层

法定代表人:平岳

联系人:张静、金坚

电话:021-68604866

传真:021-50372474

客户服务电话:021-68604866

公司网址:www.bocichina.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。

(二)注册登记机构

名称:汇添富基金管理有限公司

住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼

法定代表人:桂水发

电话:021-28932871

传真:021-28932876

联系人:王小练

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东东方昆仑律师事务所上海分所

住所:上海市延安西路728号华敏·翰尊国际大楼13楼F座

负责人:陈冉

电话:021-62113098

传真:021-62112108

经办律师:田卫红、汪年俊

联系人:田卫红

(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

法定代表人:葛明

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

邮政编码:100738

公司电话:010-58153000

公司传真:010-85188298

签章会计师:徐艳、方侃

业务联系人:方侃

四、基金的名称

本基金名称:汇添富上证综合指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股(如一级市场初次发行或增发)等,其中股票资产占基金资产的比例为90%-95%,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%,投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于80%(但因法律法规限制原因导致本基金不能投资相关股票而致使本基金不能达到上述比例的情形除外)。今后如果法律法规允许,本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的100%。

如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具,如股指期货、ETF等,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为3个月,3个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

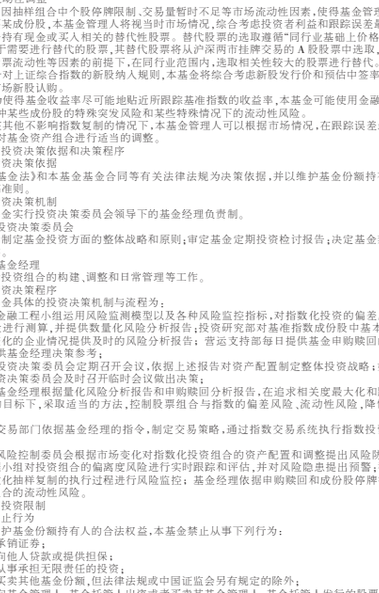
(一)资产配置

本基金采用自上而下的两层资产配置策略,首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例,再进一步以抽样复制基准指数的方法,确定抽样组合中各股票的配置比例。本基金股票资产比例原则上将不低于基金资产净值的90%,在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下,管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后,及时将股票配置比例调整至合理水平。

如果法律法规允许,本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的100%,此事项无须经基金份额持有人大会同意。

(二)抽样股票组合构建

本基金原则上采用抽样复制基准指数的方法,在综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证指数的相关性等因素的基础上,采用"重点抽样 + 分层抽样"的方法,选择上海交易所上市交易的部分股票构建基金的抽样股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股配置比例。



(1)股票预筛选

由于上证指数包含在上海证券交易所上市交易的所有A股和B股股票,本基金在抽样复制时,将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

(2)重点抽样

将预筛选出来的股票,按总市值从大到小排序,逐个累加总市值,累计总市值在前80%的股票,按照其在上证综合指数的比例进入抽样组合。

(3)分层抽样

对于累计总市值在后20%的股票,按照行业分类在每个行业中进行抽样选取行业优化组合。

(4)确定最终抽样组合

对于"重点抽样 + 分层抽样"方法得到的股票,将被用来构建本基金的最终股票抽样组合。

针对当前上证综合指数个股集中度较高的特点,本基金采取了"重点抽样 + 分层抽样"的方法对基准指数进行抽样复制。为了能够更好的跟踪上证综合指数,如果今后由于基准指数成份股结构的变化,其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪,本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告,并阐明变更抽样复制方法的原因。

(三)股票组合调整

(1)组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

在重点抽样调整时,如果已选股票位于累计总市值前85%则优先保留,原样本外股票如果位于累计总市值前75%则优先进入;在进行抽样组合调整时,如果已选股票在行业中所属类中流动性排名没有显著变化,则优先保留。

(2)投资组合调整方法

①对基准指数的跟踪调整

A.定期季度调整

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合,将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

B.不定期调整

根据指数编制规则,当上证综合指数成份股因新股发行、增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

②限制性调整

A.大额赎回调整

由于本基金开放式基金的特点,当发生大额赎回超过现金保有量时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。

B.流动性调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素,使得基金管理人无法顺利购买某成份股,本基金管理人将视当时市场情况,综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循"同行业基础上价格相关性"原则,对于需要进行替代的股票,其替代股票将从沪深两市挂牌交易的A股股票