(上接D59版)

注册地址：	郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址：	郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层
法定代表人：	石保上
联系人：	程月艳 耿铭
电话：	0371－65585670
传真：	0371－65585665
客户服务电话：	0371-967218;4008139666
网址：	http://www.ccnew.com/

66.中银国际证券有限责任公司

注册地址：	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：	唐新宇
联系人：	张静
电话：	021-68604866-8309
传真：	021-50372474
客户服务电话：	4006208888,021-61195566
网址：	http://www.bocichina.com

67.红塔证券股份有限公司

注册地址：	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：	刘汝军
联系人：	张同亮
电话：	0471-4913998
传真：	0471-4930707
客户服务电话：	0471-4961259
网址：	http://www.cnht.com.cn/

68.国盛证券有限责任公司

注册地址：	江西省南昌市永叔路15号
办公地址：	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人：	管荣升
联系人：	徐美云
电话：	0791-6285337
传真：	0791-6289395
客户服务电话：	0791-96168
网址：	http://www.gsstock.com/

69.华西证券有限责任公司

注册地址：	四川省成都市陕西街239号
办公地址：	四川省成都市陕西街239号
法定代表人：	杨炯阳
联系人：	金达勇
电话：	0755-83025723
传真：	0755-83025991
客户服务电话：	4008888818
网址：	http://www.hx168.com.cn

70.东源证券股份有限公司

注册地址：	新疆乌鲁木齐建设路2号
办公地址：	北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：	汤世生
联系人：	李巍
电话：	010-88085338
传真：	010-88085240
客户服务电话：	4008000562
网址：	http://www.hysec.com

71.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：	山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：	李玮
联系人：	吴阳
电话：	0531-81283938
传真：	0531-81283900
客户服务电话：	95538
网址：	http://www.qlzq.com.cn/

72.世纪证券有限责任公司

注册地址：	深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址：	深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：	卢长才
联系人：	张婷
电话：	0755-83199511
传真：	0755-83199545
客户服务电话：	0755-83199599
网址：	http://www.csco.com.cn/

73.中航证券有限公司

注册地址：	南昌市抚河北路291号
办公地址：	南昌市抚河北路291号
法定代表人：	杜航
联系人：	余雅娜
电话：	0791-6768763
传真：	0791-6789414
客户服务电话：	400-8866-567
网址：	http://www.avicsec.com/

74.郑材证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区民田路178号华融大厦5.6楼
办公地址：	深圳市福田区民田路178号华融大厦5.6楼
法定代表人：	段文清
联系人：	杨玲
电话：	0755-82707888
传真：	0755-82707850
客户服务电话：	4008802888或致电各地营业部客服电话
网址：	http://www.chinalions.com/

75.南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
联系人：	罗芳
电话：	021-68761616
传真：	021-68767981
客户服务电话：	4008888128
网址：	http://www.tebon.com.cn

76.广发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、8、10层
法定代表人：	黄金琳
联系人：	张腾
电话：	0591-87278701
传真：	0591-87841150
客户服务电话：	96326(福建省外请加拨0591)
网址：	http://www.gfhfzq.com.cn

77.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：	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
电话：	0931-8888088
传真：	0931-4890515
客户服务电话：	0931-4890619 4890618 4890100
网址：	http://www.hlzqgs.com/

78.中国国际金融有限公司

注册地址：	中国北京建国门外大街1号 国贸大厦2座28层
办公地址：	中国北京建国门外大街1号 国贸大厦2座28层
法定代表人：	李剑阁
联系人：	王雪筠
电话：	010-65051166
传真：	010-65051156
客户服务电话：	(010)85679238/85679169;(0755)83195000;(021)63861195;63861196
网址：	http://www.cicc.com.cn/

79.财通证券有限责任公司

注册地址：	杭州市解放路111号
法定代表人：	沈继宁
联系人：	乔骏
电话：	0571-87925129
传真：	0571-87925100
客户服务电话：	96336(上海地区962336)
网址：	http://www.ctsec.com

80.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：	刘弘
联系人：	谢亚凡
电话：	010-5922 6788
传真：	010-5922 6840
客户服务电话：	4008878827
网址：	http://www.ubssecurities.com

81.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
联系人：	杨瑞芳
电话：	0755-82026511
传真：	0755-82026539
客户服务电话：	4006008008
网址：	http://www.cjis.cn/

82.中山证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址：	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：	吴承良
联系人：	李玲
电话：	0755-82943755
传真：	0755-82940511
客户服务电话：	0755-82943750
网址：	http://www.zsszq.com.cn

83.万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：	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：	孔伟杰
联系人：	陈书杉
电话：	010-88086830
传真：	010-66412537
客户服务电话：	010-66413306
网址：	http://www.rxzq.com.cn

84.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：	张宇宏
电话：	0451-82336863
传真：	0451-82287211
客户服务电话：	4006662288
网址：	http://www.jhzq.com.cn

85.大源证券经纪有限公司

注册地址：	青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址：	深圳市民田路新华保险大厦18楼
法定代表人：	裴东平
联系人：	关键
电话：	0755-33331188
传真：	0755-33329815
客户服务电话：	4006543218
网址：	http://www.tyzq.com.cn

86.华宝证券有限责任公司

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
法定代表人：	陈林
联系人：	徐方亮
电话：	021-50122222
传真：	021-50122200
客户服务电话：	4008209898;021-38929908
网址：	http://www.cnhbstock.com

87.厦门证券有限公司

注册地址：	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址：	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人：	傅毅辉
联系人：	卢金文
电话：	0592-5161816
传真：	0592-5161102
客户服务电话：	0592-5163588
网址：	http://www.xmzq.cn

88.发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
联系人：	陈敏
电话：	021-32229888
传真：	021-62878783
客户服务电话：	021-63340678
网址：	http://www.ajzq.com

89.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：	赵宏安
联系人：	王睿
电话：	0755-83007069
传真：	0755-83007167
客户服务电话：	0755-26982993
网址：	http://www.ydsc.com.cn

90.财达证券有限责任公司

注册地址	河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址	河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层?
法定代表人	翟建强
联系人	刘亚静
电话	0311-66006393
传真	0311-66006249
客户服务电话	4006128888
网址	http://www.S10000.com

91.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：	辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：	于宏民
联系人：	谢立军
电话：	0411-39673202
传真：	0411-39673219
客户服务电话：	4008169169
网址：	http://www.dalton.com.cn

(二)注册登记机构

名称：	博时基金管理有限公司(内容同基金管理人)

(三)律师事务所

名称：	国浩律师集团(北京)事务所
注册地址：	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
办公地址：	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
负责人：	王卫东
电话：	010-65171188
传真：	021-65176800
联系人：	黄伟民
经办律师：	黄伟民、陈周

(四)会计师事务所

名称：	普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：	上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人：	杨绍信
电话：	021-23238888
传真：	021-23238800
经办注册会计师：	汪棣、张鸿

四.基金的名称

博时裕富沪深300指数证券投资基金

五.基金的类型

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

六.基金的投资目标

分享中国资本市场的长期增长。

本基金将以对标的指数长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上，并保持年跟踪误差在4%以下。

七.基金的投资方向

本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数、新股（IPO或增发）以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

八.基金的投资策略

1.投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。即调整其股票资产比例为95%以内，现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于5%。

2.业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率。

3.资产配置原则

本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，再进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例，以复制的方法进行组合构建。

4.资产配置策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。

5.股票资产配置策略

本基金股票资产投资以沪深300指数为标的指数，原则上采用复制的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。

6.投资组合调整原则

本基金的股票投资为复制的被动式指数投资，基金所构建的指数化投资组合将根据标的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、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金管理人在基金管理期间有权更换标的指数，标的指数的更换将提前3个月在指定媒体上公告。

九.基金的业绩比较基准

博时裕富沪深300指数基金为指数基金，成立于2003年8月26日，以新华富时中国A200指数为标的指数。

自2008年1月1日起，本基金所跟踪的标的指数变更为沪深300指数。本公司在更换标的指数之后的1个月内，将原有的组合调整为跟踪沪深300指数的新组合。

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数，该指数根据最近一年的日均总市值、日均流通市值、日均流通股份数、日均成交金额和日均成交股份数等指标，然后加权计算选取排名在前300位的股票进行编制。

本基金的业绩比较基准为95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率。

十.基金的风险收益特征

本基金为被动式股票基金，在证券投资基金中属于风险收益水平中等偏高的品种。

十一.基金投资组合报告

博时基金管理公司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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2010年12月31日。

i.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	权益投资	12,526,668,462.51	94.75
	其中:股票	12,526,668,462.51	94.75
2	固定收益投资	-	-
	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	685,117,913.45	5.18
6	其他资产	8,347,417.22	0.06
7	合计	13,220,133,793.18	100.00

ii. 报告期末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	52,390,648.54	0.40
B	采掘业	1,575,485,040.24	11.93
C	制造业	4,378,998,726.62	33.17
C0	食品、饮料	699,110,152.49	5.30
C1	纺织、服装、皮毛	46,333,788.62	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,544,301.04	0.07
C4	石油、化学、塑胶、塑料	307,819,266.44	2.33
C5	电子	65,147,734.32	0.49
C6	金属、非金属	1,156,213,489.39	8.76
C7	机械、设备、仪表	1,559,639,112.34	11.81
C8	医药、生物制品	492,032,621.36	3.73
C99	其他制造业	43,158,260.62	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	344,213,856.54	2.61
E	建筑业	398,300,273.06	3.02
F	交通运输、仓储业	562,676,926.36	4.26
G	信息技术业	380,020,071.18	2.88
H	批发和零售贸易	388,800,259.10	2.95
I	金融、保险业	3,358,001,814.21	25.44
J	房地产业	659,488,166.72	5.00
K	社会服务业	117,512,170.17	0.89
L	传播与文化产业	21,456,716.00	0.16
M	综合类	289,323,793.77	2.19
	合计	12,526,668,462.51	94.89

iii.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	601318	中国平安	8,065,538	452,960,614.08	3.43
2	600036	招商银行	29,769,044	381,341,453.64	2.89
3	601328	交通银行	50,107,044	274,586,601.12	2.08
4	600016	民生银行	51,861,040	260,342,420.80	1.97
5	600000	浦发银行	19,467,913	241,207,442.07	1.83
6	601166	兴业银行	9,636,430	231,756,141.50	1.76
7	600030	中信证券	17,266,379	217,383,711.61	1.65
8	601398	工商银行	46,825,310	198,539,314.40	1.50
9	601088	中国神华	7,908,000	195,406,680.00	1.48
10	000002	万科A	23,120,000	190,046,400.00	1.44

iv.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

v.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

本基金本报告期未未持有债券。

vi.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

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

vii.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

本基金本报告期未未持有权证投资。

viii.投资组合报告附注

①.报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚;

②.基金投资的前十名股票中,没有投资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	1,279,453.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,683.29
5	应收申购款	6,919,280.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,347,417.22

④.报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

⑥.其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二.基金的业绩

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。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。

历史各时间段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;

期 间	①份额净值增长率	②份额净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010年1月1日至12月31日	-11.98%	1.52%	-11.77%	1.50%	-0.21%	0.02%
2009年1月1日至12月31日	88.61%	1.96%	90.72%	1.95%	-2.11%	0.01%
2008年1月1日至12月31日	-63.88%	2.82%	-63.85%	2.89%	-0.03%	-0.07%
2007年1月1日至12月31日	121.58%	2.08%	135.77%	2.17%	-14.19%	-0.09%
2006年1月1日至12月31日	120.74%	1.25%	115.42%	1.31%	5.32%	-0.06%
2005年1月1日至12月31日	-4.09%	1.22%	-9.32%	1.23%	5.23%	-0.01%
2004年1月1日至12月31日	-10.90%	1.02%	-14.70%	0.97%	3.80%	0.05%
2003年8月26日至12月31日	6.60%	0.78%	2.55%	0.76%	4.05%	0.02%
2003年8月26日至2010年12月31日	167.21%	1.77%	145.09%	1.81%	22.12%	-0.04%

十三.基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

i.费用种类

①.基金管理人的管理费;

②.基金托管人的托管费;

③.证券交易费用;

④.基金份额持有人大会费用;

⑤.基金成立后与基金相关的会计师费和律师费;

⑥.基金分红手续费;

⑦.法定信息披露费等按照国家有关规定可以列入的其他费用。

ii.基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

①.基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以前一日的基金资产净值的0.98%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.98%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首日起叁个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

②.基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首日起叁个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

③.其他费用

本章第(一)款中所述费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定,按费用实际支出金额,列入当期基金费用。

iii.不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

iv. 基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可以就调酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费用

对于单笔金额1000万元以下(不含)的申购,申购费率为1.5%。对于单笔金额1000万元以上(含1000万元)的申购,申购费用为每笔1000元。投资人在一天之内如果有多笔申购,所适用的费率按单笔分别计算。本基金的申购费用由申购人承担,不列入基金资产,申购费用于基金的市场推广和销售。

①.对申购金额小于1000万元时:

申购费用=申购金额×申购费率/(1+申购费率),小数点第三位四舍五入。

②.申购金额大于等于1000万元时:

申购费用=1000元。

2.赎回费用

本基金的赎回费率为0.5%:由基金份额赎回人承担,赎回费的25%归基金资产,其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

为进一步降低投资者投资基金产品的成本,自2007年4月19日起调整赎回费率,调整后的赎回费率如下表:

持有基金时间(Y)	赎回费率
Y<2	0.50%
2≤Y<3	0.25%
Y≥3	0

本基金的赎回费用由基金份额赎回人承担,赎回费的25%归基金资产,其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

赎回费用=基金份额资产净值×赎回份额×赎回费率,小数点第三位四舍五入。

3.转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成,其中,申购费补差具体收取情况,视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

4.费率调整

基金管理人可以根据情况调整申购费率,但最高不超过1.5%。基金管理人可以根据情况调低赎回费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在指定媒体上公告。

(三)基金税收

基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律、法规的规定,履行纳税义务。

十四.对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2010年10月11日刊登的本基金原招募说明书(《博时裕富证券投资基金更新招募说明书2010年第2号》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在"二、基金管理人"中,对本公司股东、部门设置、人员结构及投资决策委员会成员进行了更新;

2.在"四、基金托管人"中,对基金托管人的基本情况、主要人员情况及相关业务经营情况进行了更新;

3.在"五、相关服务机构"中,更新了相关服务机构的内容,增加了新增的代销机构;

4.在"基金份额的申购与赎回"中,修改了转换业务的说明;

5.在"八、基金的转换"中,更新了转换业务适用基金的范围,增加了博时宏观回报债券型证券投资基金(代码:050016(A类),051016(B类),050116(C类))、博时行业轮动股票型证券投资基金(代码:050018)和博时转债增强债券型证券投资基金(代码:050019(A类),050119(C类))之间的转换;

6.在"十二、基金的投资"中,更新了本基金截止时间为2010年12月31日的基金投票及其它资产投资组合的数据及列表;

7.在"十三、基金的业绩"中,更新了本基金截止时间为2010年12月31日的基金业绩表现数据及列表;

8.在"二十五、其它应披露的事项"中,根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

博时基金管理有限公司
2011年4月12日

(上接D57版)

法定代表人:陆涛
联系人:金春
联系电话:0755-83025695
客服电话:4008-888-228
公司网站:www.jyzq.com.cn

67.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:北京市建国门外甲6号SK大厦
法定代表人:李剑阁
联系人:王雪筠
联系电话:010-85679265
客服电话:(010)85679238 (010)85679169
公司网站:www.cicc.com.cn

68.银泰证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人:黄冰
联系电话:0755-83706665
客服电话:0755-83710885
公司网站:www.ytzq.net

69.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(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法人代表:王文学
联系人:杨小江
联系电话:0755-82083788
传真:0755-82083408
公司网址:www.cfsc.com.cn
客服电话:021-32109999,029-68918888

70.世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层
法定代表人:卢长才
联系人:张婷
联系电话:0755-83199599
客服电话:0755-83199509
公司网站:www.csco.com.cn

71.华宝证券有限责任公司
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楼
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楼
法定代表人:陈林
联系人:严俊权
联系电话:021-50122222
客服电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com

72.华龙证券有限责任公司
办公地址:兰州市城关区静宁路138号东四楼
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
联系电话:0931-8888088
客服电话:96668(甘肃)
公司网站:www.hlzqgs.com

73.百信证券有限责任公司????
注册地址:内蒙古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号长安兴融中心西座11层
法定代表人:孔伟杰
联系人:张霄宇
联系电话:010-88086830-669
公司网站:www.rxzq.com.cn

74.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:金喆
联系电话:028-86690126
客服电话:4006-600109
公司网站:www.gjzq.com.cn

75.江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
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
客户服务热线:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

76.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号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

77.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:北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人:丁之锁
联系人:梁平
联系电话:010-58568007
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn

78.广发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7-10层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
联系人电话:0591-87383623
客服电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网站:www.gfhfzq.com.cn

79.红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人:刘晓明
联系电话:0871-3577888
公司网站:http://www.hongtastock.com

80.中山证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B栋15层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心29层
法定代表人:吴承良
联系人:李玲
联系电话:0755-82570586
客服电话:0755-82943755
公司网站:http://www.zszq.com

81.中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:李学琦
联系人:范守卫
联系电话:024-23268079
客服电话:4006180315
公司网站:wwww.stockren.com

82.天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:潘鸿
联系电话:010-66045446
客服电话:010-66045678
公司网站:www.txsec.com ,www.txjijin.com

(二)、登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场22层
法定代表人:金颖
联系人:陈龙
电话:021)58876741
传真:021)68870311

(三)、律师事务所和经办律师
名称:广东华瀚律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室
负责人:李兆良
电话:0755)82687860
传真:0755)82687861
经办律师:杨忠、戴瑞冬

(四)、会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:021)23238888
传真:021)23238800
联系人:陈熹
经办会计师:薛竟、陈熹

四、基金名称

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

通过投资于小康ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于小康ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于小康ETF的比例不少于基金资产净值的90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,权证、股指期货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。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。待其他衍生金融产品推出以后,基金管理人可以在控制风险的前提下运用衍生金融产品进行投资。

八、投资策略

本基金为完全被动式指数基金,以小康ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资小康ETF。本基金并不参与小康ETF的管理。

(一)资产配置策略

为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于小康ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(二)目标ETF投资策略

1.投资组合的构建

基金合同生效后,本基金将主要按照标的指数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换购成小康ETF,使本基金投资于小康ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

2.投资组合的投资方式

本基金投资小康ETF的两种方式如下:

①.申购和赎回:小康ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回。

②.二级市场方式:小康ETF上市交易后,在二级市场进行小康ETF基金份额的交易。

本基金将通过《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》允许的方式申购赎回小康ETF份额。目前本基金申购赎回小康ETF份额通过租用小康ETF申购赎回代理券商的交易单元进行。

当小康ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

(三)成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购小康ETF。因此对可投资