广发纳斯达克100指数证券投资基金招募说明书【更新】摘要

[2013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：二〇一三年三月

【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2013年2月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2012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的审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。

当限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

当标的指数成份股因发生调整、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需调整的权重比例，进行相应调整。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，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就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：

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

（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，如与标的指数或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通过有效管理和控制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，同时降低仓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。基金经理决定日常制的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。

3.投程序

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理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：国际业务部设立专门跟踪研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、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国际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法构建组合。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，同时履行一线监控的职责。

（5）绩效评估：监察稽核部定期和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的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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、或变更指数编制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非因对本基金管理人原因导致本基金无法继续使用标的指数时，基金管理人按照维护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是否会对基金份额持有人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打开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予以公告。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月11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2012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）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	117,135,337.45	84.55
	其中：普通股	114,877,810.87	82.92
	存托凭证	2,257,526.58	1.63
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	11,165,391.87	8.06
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	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	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	7,155,448.28	5.16
8	其他各项资产	3,087,959.45	2.23
9	合计	138,544,137.05	100.00

（二）报告期末在各个国家（地区）证券市场的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	117,135,337.45	86.34
合计	117,135,337.45	86.34

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.上述美国比重包括注册地为开曼群岛、泽西岛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	566,068.17	0.42
工业	2,239,652.44	1.65
非必须消费品	19,496,928.08	14.37
必须消费品	4,536,717.77	3.34
保健	13,323,156.73	9.82
金融	–	–
信息技术	76,021,082.14	56.04
电信服务	951,732.12	0.70
公共事业	–	–
合计	117,135,337.45	86.34

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	5,928	19,860,934.47	14.64
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	52,106	8,754,402.79	6.45
3	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,657	7,388,140.69	5.45
4	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纳斯达克证券交易所	美国	29,835	6,248,429.38	4.61
5	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,804	4,426,227.48	3.26
6	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	10,550	4,112,671.79	3.03
7	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	32,870	4,059,776.17	2.99
8	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	30,806	3,994,609.86	2.94
9	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	13,118	3,082,100.20	2.27
10	EBAY INC	电子湾	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	8,152	2,614,233.98	1.93

（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

本基金本报告期末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

本基金报告期末未持有金融衍生品。

（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	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF	契约型开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt LLC	8,753,834.08	6.45
2	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	2,411,557.79	1.78
3	–	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–	–

（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和处罚。

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	2,777,509.65
3	应收股利	65,030.66
4	应收利息	566.02
5	应收申购款	88,210.41
6	其他应收款	–
7	待摊费用	156,642.71
8	其他	–
9	合计	3,087,959.45

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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时，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

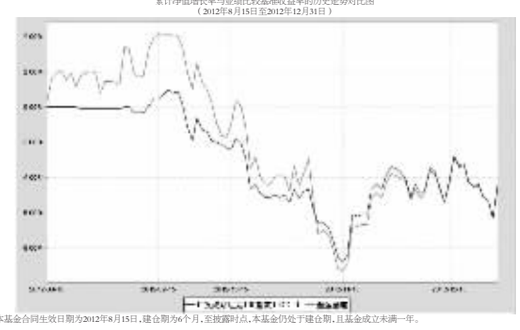
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.24%	0.78%	-5.71%	1.00%	2.47%	-0.22%
自基金合同生效起至今	-4.5%	0.67%	-4.37%	0.92%	-0.13%	-0.25%

（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历史走势对比图

（2012年8月15日至2012年12月31日）



注：本基金合同生效日期为2012年8月15日，建仓期为6个月，至披露时点，本基金仍处于建仓期，且基金成立未满一年。

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：1.2亿元人民币

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风险投资有限公司，分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、16%和18.33%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。历任广发证券董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长、广东发展银行行长助理、广东发展银行信托投资部总经理、广东发展银行人事教育部总经理、广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉，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、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兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

肖晓燕，董事，女，硕士，现任广发证券副总裁、财务总监兼财务部总经理，曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俭，董事，男，管理学硕士，高级经济师，现任珠海光通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书，兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏佳信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司等公司董事，兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿：董事，女，工商管理硕士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长、香江集团有限公司董事长兼总裁，深圳市金海马实业股份有限公司董事长，南方香江集团有限公司董事长，香江控股股份有限公司董事长，兼任广发证券监事，广发银行股份有限公司监事，全国妇联常委，中国产业发展促进会副会长，广东省政协常委，广东省工商联副主席，广东省女企业家协会会长，深圳市政协常委，香江社会救助基金会主席。

许冬瑾：董事，女，工商管理硕士，主管药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理，曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云：独立董事，男，法学博士、教授，博士生导师，现任复旦大学教授，曾任复旦大学法律系副主任，复旦大学法学院副院长。

姚海鑫：独立董事，男，经济学博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学发展规划处处长，曾任辽宁大学工商管理学院副院长、辽宁大学工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、辽宁大学计财处处长、学科建设处处长。

罗海平：独立董事，男，经济学博士，现任阳光财产保险股份有限公司总裁，曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理、太平保险湖北分公司总经理、太平保险公司湖北省国际部总经理兼纪委书记、民安保险（中国）有限公司副总裁。

2.监事会成员

余利平：监事会主席，女，经济学博士，兼任广发国际资产管理有限公司董事，曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

倪志军：监事，男，管理学硕士，现任广州科技风险投资有限公司董事长，兼任广州生产力促进中心副主任、广州市科达实业发展公司总经理，曾任广州市统计局投资处处长、工业处处长、社会科技处处长。

刘文红：监事，女，经济学硕士，现任广发基金管理有限公司电商及客服部副总经理，曾任广发证券研究发展中心研究员。

3.总经理及其他高级管理人员

林传辉：总经理，男，大学本科学历，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，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、投资银行部常务副总经理。

肖雯：副总经理，女，企业管理硕士、高级经济师，兼任广发基金管理有限公司量化投资部总经理，中国证券监督管理委员会第四届创业板发行审核委员会兼职委员，曾任上海证巨集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方：副总经理，男，经济学硕士，经济师，兼任广发基金管理有限公司投资总监、广发聚丰股票型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事，曾任广发证券投资自营部副经理、中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员、广发基金管理有限公司投资管理部总经理、广发基金管理有限公司总经理助理。

段西军：督察长，男，博士，曾在广东省佛山市財贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

4.基金经理

邱炜：男，中国籍，统计学博士，持有证券业执业资格证书，2007年5月至2008年7月在摩根大通集团（纽约）任高级分析师兼助理副总裁，2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员，2011年4月26日起任广发标普全球农业指数基金的基金经理，2012年3月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。

5.本基金投资决策集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

王席：公司总经理林传辉；成员：公司副总经理肖雯、公司副总经理易阳方、投资总监、投资管理部总经理陈仕德、研究发展部总经理许雪梅、固定收益部总经理张平。

第十一部分　基金托管人

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：人民币贰万柒佰玖拾亿肆仟柒佰贰拾贰万柒仟壹佰玖拾元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24号

托管投资资格业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐怀歌

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人，另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金（本金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系，在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

三、证券投资基金托管情况

截至2012年12月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成竞走封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹰瑞和混合、国泰金鹿混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通债券、海富通货币、海富通精选成长混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实债券、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实策略增长混合、嘉实主题精选混合、嘉实领先成长混合、嘉实精选股票、嘉实企业债券、嘉实多利债券、嘉实多利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极收益股票、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞盛世精选股票、华泰柏瑞盛利精选股票、南方高增长股票(LOF)、国富成力股票、国富成长动力股票、国富成长动力股票、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票、摩根士丹利华鑫融收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时史密斯回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证300指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳成子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信普信中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300此长交易型开放式指数、国泰中小板300此长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城核心价值股票型、景顺长城内需增长股票型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚国期轮动股票型、富兰克林国海新兴股票型、诺安红利股票、诺安优势股票、平安大华策略先锋混合型、华安兴业中证国债50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景信保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华安兴业货币、长盛同鑫一号保本混合