

(上接B18版)

2、第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息
1	诺亚正行(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市金山区石化镇漕浦公路7650号205室 法定代表人:汪静波 电话:(021)38602377 传真:(021)50907777 客服电话:4008213399 网址:www.nofund.com
2	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4楼444室 法定代表人:杨文斌 电话:(021)-58870011 传真:(021)-68969965 网址:www.chowbuy.com
3	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市浦东新区高科路526号3幢220室 法定代表人:张晓伟 电话:(021)-38786785-8201 传真:(021)-58876988 客服电话:400-089-1289 网址:www.erichfund.com
4	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址:深圳市罗湖区深南东路3019号发展银行大厦25层1单元 法定代表人:薛峰 电话:(0755)-33227950 传真:(0755)-82800798 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
5	北京恒京基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街6号 法定代表人:何振杰 电话:(010)-2020088-2288 传真:(010)-63200888-8802 客服电话:4008866661 网址:www.myfund.com
6	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市文二路1号元茂大厦903室 法定代表人:凌顺平 电话:(0571)-88911818-8565 传真:(0571)-56800423 客服电话:4008-773-776 网址:www.zsfund.com
7	杭州数米基金销售有限公司	注册地址:杭州市滨江区闸弄口尚座商务楼东2号 法定代表人:陈柏青 联系人:周晓曼 电话:(0571)-28829700 传真:(0571)-26068533 客服电话:4000-766-123 网址:www.fund123.cn
8	江苏金百利投资咨询有限公司	注册地址:无锡市崇安区解放南路99号 法定代表人:陈晓燕 电话:(0510)-85288777 客服电话:4008-968898 网址:www.jbl.com
9	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙吴路1100号1号楼101室 法定代表人:朱红 电话:(021)-54509988-1071 传真:(021)-64383798 客服电话:4000181888 网址:www.cz567.com.cn
10	万银财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:上海市嘉定区安亭镇昌吉路1000号1号楼101室 法定代表人:孙招弟 联系人:刘刚 电话:(010)-53939293 传真:(010)-53939374 客服电话:4008800069 网址:www.wy-fund.com
11	上海利得基金管理有限公司	注册地址:上海市嘉定区蕴川路4755号1033室 法定代表人:叶志杰 联系人:叶志杰 电话:(021)-50883533 传真:(021)-50883533 客服电话:400-005-0355 网址:www.leadic.com
12	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村东路1号8号院C1701室 法定代表人:凌峰 联系人:凌峰 电话:(010)-82151989 客服电话:400-866-5880 网址:www.jingxincn.com
13	浙江金财财富管理有限公司	注册地址:杭州市教工路18号EAC国际中心A座1区801 法定代表人:高彬 联系人:高盛 电话:(0571)-56028617 传真:(0571)-56099710 客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com

(二)注册登记机构

名称:国泰基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路100号上海环球金融中心39楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道10号上海环球金融中心39楼
法定代表人:陈勇胜
联系人:何峰
传真:(021)-38561800

客户服务热线:400-888-8688,021-38569000

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号19楼
负责人:韩钢

联系电话:(021)-31358666

传真:(021)-31358600

联系人:黎明

经办律师:吕虹、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人:陈军伟

联系人:孙伟

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:魏佳亮

经办注册会计师:汪棣、邱斯洁

(四)基金名称

国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金类型和存续期限

1、基金类型:联接基金

2、基金运作方式:契约型,开放式

3、基金存续期间:不定期

六、投资目标

通过投资于目标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、投资范围

本基金主要投资于目标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指数的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于目标ETF的比例不低于基金净资产值的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净资产值的5%。

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、投资策略

本基金将基于对目标ETF、标的指数成份股、备选成份股,为更好地实现投资目标,本基金将少投资于指数的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的主要是为了使基金在支付赎回金额的情况下,更好地跟踪标的指数。

九、资产配置策略

为实现投资目标,本基金将以不低于基金净资产值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非标的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使基金在支付赎回金额的情况下,更好地跟踪标的指数。

十、投资组合

1、投资组合的构建

(1)投资组合的构建
在正常情况下,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的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过0.4%。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,基金管理人采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、目标ETF的投资策略

通过投资于目标ETF,本基金将主要按照标的指数成份股的权重构建股票组合,在目标ETF开放申赎期间将股票组合换购目标ETF份额,使本基金投资于目标ETF的比例不少于基金净资产值的90%。

3、投资组合的投资方式

本基金将根据目标ETF的两种方式如下:

1)申购和赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回。

2)二级市场交易:目标ETF上市交易后,在一级市场进行目标ETF基金份额的交易。

本基金在一级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求充分投资,降低跟踪误差的目的,在目标ETF暂停申购赎回时,本基金将从二级市场买入小额赎回份额,降低赎回限制的情况下,本基金可在二级市场买卖目标ETF。本基金二级市场的ETF份额投向将不以盈利为目的。

本基金可以通过申购赎回价差套利的模式购买股票并出售,也可以在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据每日申购赎回情况,综合考虑流动性、成本、效率等因素,决定目标ETF的投资方式。通常情况下,本基金以申购赎回为主;当收到申购时,本基金构建股票组合,由申购赎回;当收到赎回时,本基金将目标ETF、卖出基金赎回,对于股票停牌等原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股,基金管理人将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。

4、成份股投资组合

本基金将根据成份股、备选成份股的投资目的是为构建股票组合以申购目标ETF。因此对投资于成份股、备选成份股的资金大小,主要采取现金复制法,即完全按照标的指数成份股及其权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

5、风险收益特征

本基金为混合型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制或跟踪标的指数的表现,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。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事和监事对本报告所载数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确性和完整性承担个别责任及连带责任。

基金经理王东兴先生主持了本次会议。公司独立董事双全先生、章永福先生、张莉女士、叶永康先生参加了本次会议。

十二、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更导致本基金认为标的指数不能继续使用时,本基金将选择其他指标或证券作为其他指标表现,更适当、更适合本基金投资的指标。若变更后的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响,本基金将通过赎回价差套利的模式购买股票并出售,从而达到对基金投资组合的调整。

本基金将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

十三、基金费用

债券投资的目的是为基金资产流动性,有效利用资金资源,提高基金资产的投资收益。

通过对收益率、流动性、风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例,并适时地采用收益曲线方法、市场品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合,力求这些有效的固定收益类证券组合,在一定的风险度下能提供最大的预期收益,或者确定收益水平来承担最小的风险。

十四、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更导致本基金认为标的指数不能继续使用时,本基金将选择其他指标或证券作为其他指标表现,更适当、更适合本基金投资的指标。若变更后的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响,本基金将通过赎回价差套利的模式购买股票并出售,从而达到对基金投资组合的调整。

本基金将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

十五、风险提示

本基金为混合型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制或跟踪标的指数的表现,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。

十六、基金投资组合报告

本基金管理人的董事和监事对本报告所载数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确性和完整性承担个别责任及连带责任。

基金经理王东兴先生主持了本次会议。公司独立董事双全先生、章永福先生、张莉女士、叶永康先生参加了本次会议。

十七、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更导致本基金认为标的指数不能继续使用时,本基金将选择其他指标或证券作为其他指标表现,更适当、更适合本基金投资的指标。若变更后的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响,本基金将通过赎回价差套利的模式购买股票并出售,从而达到对基金投资组合的调整。

本基金将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

十八、风险提示

本基金为混合型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制或跟踪标的指数的表现,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。

十九、基金投资组合报告

本基金管理人的董事和监事对本报告所载数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确性和完整性承担个别责任及连带责任。

基金经理王东兴先生主持了本次会议。公司独立董事双全先生、章永福先生、张莉女士、叶永康先生参加了本次会议。

二十、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更导致本基金认为标的指数不能继续使用时,本基金将选择其他指标或证券作为其他指标表现,更适当、更适合本基金投资的指标。若变更后的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响,本基金将通过赎回价差套利的模式购买股票并出售,从而达到对基金投资组合的调整。

本基金将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

二十一、风险提示

本基金为混合型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制或跟踪标的指数的表现,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。

二十二、基金投资组合报告

本基金管理人的董事和监事对本报告所载数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确性和完整性承担个别责任及连带责任。

基金经理王东兴先生主持了本次会议。公司独立董事双全先生、章永福先生、张莉女士、叶永康先生参加了本次会议。

二十三、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更导致本基金认为标的指数不能继续使用时,本基金将选择其他指标或证券作为其他指标表现,更适当、更适合本基金投资的指标。若变更后的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响,本基金将通过赎回价差套利的模式购买股票并出售,从而达到对基金投资组合的调整。

本基金将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足额数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

二十四、风险提示

本基金为混合型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制或跟踪标的指数的表现,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。

二十五、基金投资组合报告

本基金管理人的董事和监事对本报告所载数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确性和完整性承担个别责任及连带责任。

基金经理王东兴先生主持了本次会议。公司独立董事双全先生、章永福先生、张莉女士、叶永康先生参加了本次会议。

二十六、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为上证180金融指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%