



Disclosure 信息披露

2015年12月19日 星期六

qzsb@stcn.com (0755)83501750

B70

(上接B69版)

36	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区星阳街5号 办公地址:苏州工业园区星阳街5号 法定代表人:吴永光 联系人:方晓丹 电话:0512-65811316 传真:0512-65888021 客服电话:400861555 网址:www.dwzq.com.cn
37	广州证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江新城4号广州国际金融中心主楼1912-20楼 办公地址:广州市天河区珠江新城4号广州国际金融中心主楼1912-20楼 法定代表人:王峰 联系人:王峰 电话:020-88836999 客服电话:020-961303 公司网站:www.gzs.com.cn
38	华林证券有限责任公司	注册地址:广西柳州白莲圩平安路88号 办公地址:柳州白莲圩平安路88号 法定代表人:陈永刚 联系人:陈永刚 电话:0772-8279786 客服电话:40081-1888-3888 公司网站:www.chinabond.com
39	南京证券股份有限公司	注册地址:南京市玄武区大钟亭8号 办公地址:南京市玄武区大钟亭8号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:025-52310550 客服电话:400828588 公司网站:www.njzq.com.cn
40	华安证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路199号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路199号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0551-65161821 客服电话:40081-400065518 公司网站:www.haung.com
41	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:倪昆 联系人:倪昆 电话:0871-6357946 公司网站:htzq.com.cn
42	银华证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区竹子林路紫竹七道18号光大银行大厦1812室 办公地址:深圳市福田区竹子林路紫竹七道18号光大银行大厦1812室 法定代表人:王峰 联系人:王峰 电话:0755-83666666 客服电话:4008-505-505 公司网站:www.yinhua.com
44	华宝证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 法定代表人:陈永刚 联系人:陈永刚 电话:021-68777905 客服电话:400820898 公司网站:www.wabao.com.cn
45	山西证券股份有限公司	注册地址:山西省太原市南内西街69号山西国际信托中心东塔楼 办公地址:山西省太原市南内西街69号山西国际信托中心东塔楼 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0351-8686669 客服电话:400-606-1616 公司网站:www.sx1.com.cn
47	华融证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0755-23838750 公司网站:www.hrsec.com.cn
48	中汇证券有限责任公司	注册地址:浙江省杭州市拱墅区 办公地址:浙江省杭州市拱墅区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0571-8735610 客服电话:400-606-1616 公司网站:www.zhonghui.com.cn
50	中原证券股份有限公司	注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号 办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号 法定代表人:王峰 联系人:王峰 电话:0371-85551111 客服电话:40081-36666 公司网站:www.zysec.com.cn
51	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市江北区桥北苑8号 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:023-63786633 传真:023-63786212 客服电话:4008-096-096 网址:www.swsc.com.cn
53	德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市普陀区江宁路510号 办公地址:上海市普陀区江宁路510号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-6870578 客服电话:4008888128 网址:www.tebon.com.cn
54	中航证券有限公司	注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号金融大厦1404室 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号金融大厦1404室 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0311-6481833 传真:0311-6481844 客服电话:400-886-567 网址:www.avicsec.com.cn
55	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:李永 联系人:李永 电话:0551-2614400 客服电话:4008888128 网址:www.guoyuan.com.cn
57	中国国际金融股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-65051166 客服电话:400-910-1166 公司网站:www.cicc.com.cn
58	大同证券有限责任公司	注册地址:大同市城区迎宾街15号 办公地址:大同市城区迎宾街15号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0351-4192803 客服电话:400712122 网址:www.dts.com.cn
59	方正证券股份有限公司	注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华融国际大厦22-24层 办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华融国际大厦22-24层 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0731-85888888 客服电话:4008-600-600 公司网站:www.fundse.com.cn
60	财富证券股份有限公司	注册地址:杭州钱江世纪城14号 办公地址:杭州钱江世纪城14号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0571-87157119 客服电话:40081-36666 公司网站:www.cfzq.com.cn
62	西部证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层 办公地址:陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:029-87209166 客服电话:40081-36666 公司网站:www.westsec.com.cn
63	融时代证券股份有限公司	注册地址:北京市海淀区三里河路99号院1号楼15层1501 办公地址:北京市海淀区三里河路99号院1号楼15层1501 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-83561146 客服电话:4008989898 公司网站:www.rsdq.com.cn
64	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 办公地址:北京市西城区金融大街7号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-58328373 客服电话:400-887-8827 公司网站:www.ubs.com.cn
66	万联证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江新城11号 办公地址:广州市天河区珠江新城11号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:020-38256511 客服电话:400-888-133 公司网站:www.wlzq.com.cn
68	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:李永 联系人:李永 电话:028-86600577 传真:028-86600112 客服电话:4006010019 网址:www.gjzq.com.cn
68	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楼 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:400-48-3316 公司网站:www.cfzq.com.cn
69	恒泰证券股份有限公司	注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方国际大厦14层 办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方国际大厦14层 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0471-3953168 公司网站:www.htzq.com.cn
70	华龙证券股份有限公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦A座 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦A座 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0931-4809028 客服电话:4008-98-8888 公司网站:www.hlzq.com.cn

71	华泰证券股份有限公司	注册地址:南京市江东中路228号 办公地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:025-83333333 客服电话:40081-36666 公司网站:www.htzq.com.cn
72	日信证券有限责任公司	注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华大街1号 办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华大街1号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0471-8276766 客服电话:40081-36666 公司网站:www.rxzq.com.cn
73	美东证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦22-23层 办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦22-23层 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0755-83007159 客服电话:40081-36666 公司网站:www.meidong.com.cn
74	中天证券有限责任公司	注册地址:沈阳市浑南区浑南中路22号 办公地址:沈阳市浑南区浑南中路22号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:024-2380810 客服电话:40081315 公司网站:www.ztc.com.cn
75	五矿证券有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路4029号安联大厦47层01单元 办公地址:深圳市福田区金田路4029号安联大厦47层01单元 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0755-82545500 客服电话:40081-40028 网址:www.wkzq.com.cn
76	大通证券股份有限公司	注册地址:辽宁省大连市中山区金马路29号 办公地址:辽宁省大连市中山区金马路29号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0411-39671230 客服电话:4008-169-169 网址:www.dnton.com.cn
77	天相投资顾问有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街19号 办公地址:北京市西城区金融大街19号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-66418888 客服电话:40081-36666 公司网站:www.txsec.com.cn
78	联讯证券股份有限公司	注册地址:广东省惠州市惠城区江北北三路 办公地址:广东省惠州市惠城区江北北三路 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0752-2119301 客服电话:0752-2119309 公司网站:www.lxsec.com.cn
79	东吴证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街25号 办公地址:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-66418888 客服电话:40081-36666 公司网站:www.rdwzq.com.cn
80	开泰证券股份有限公司	注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0451-8686866 客服电话:40081-36666 公司网站:www.ktzq.com.cn
81	中邮证券有限责任公司	注册地址:北京市东城区珠市口东大街17号 办公地址:北京市东城区珠市口东大街17号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-6707788-494 客服电话:40081-36666 公司网站:www.cnpsc.com.cn
82	中国民族证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区北大街27号 办公地址:北京市西城区北大街27号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-50355941 客服电话:40081-36666 公司网站:www.mzsc.com.cn
83	太平洋证券股份有限公司	注册地址:云南省昆明市北京路399号 办公地址:云南省昆明市北京路399号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0871-6357946 客服电话:400-665-9999 网址:www.tpyzq.com
84	宏信证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市武侯区人民南路一段18号 办公地址:四川省成都市武侯区人民南路一段18号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:028-86199382 客服电话:4008366366 公司网站:www.hxzq.com.cn
85	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号 办公地址:天津市经济技术开发区第二大街42号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:022-28554400 客服电话:40081-36666 公司网站:www.bhsc.com.cn
86	天风证券股份有限公司	注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园22号 办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园22号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:027-87406022 客服电话:40081-36666 公司网站:www.tfzq.com.cn
87	诺亚正行 上海金融销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号242室 办公地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号242室 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah.com.cn
88	深圳众成金融服务有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路100号 办公地址:深圳市福田区福华一路100号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:4006-788-887 网址:www.zfzq.com.cn
89	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:40081-36666 公司网站:www.hymf.com.cn
90	杭州数米基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市西湖区 办公地址:浙江省杭州市西湖区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0571-87157119 客服电话:400-606-1616 公司网站:www.fund123.cn
91	上海长量基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号 办公地址:上海市浦东新区高翔路526号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:400-820-2899 网址:www.eicfund.com
92	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-20688888 客服电话:400-820-2899 网址:www.ttfc.com.cn
93	北京展恒基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-59601366 客服电话:40081-36666 公司网站:www.zhenheng.com.cn
94	浙江阿利顺基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市西湖区 办公地址:浙江省杭州市西湖区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0571-88911818-8653 客服电话:40081-36666 公司网站:www.alishun.com.cn
95	中期资产管理有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-65807865 客服电话:40081-36666 公司网站:www.cifund.com.cn
96	万银财富 北京 基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:400-459-8888 客服电话:40081-36666 公司网站:www.wyfund.com.cn
97	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-59601366 客服电话:40081-36666 公司网站:www.hexun.com.cn
98	宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:40081-36666 客服电话:40081-36666 公司网站:www.yixinfund.com.cn
99	浙江金诚财富管理有限公司	注册地址:浙江省杭州市 办公地址:浙江省杭州市 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0571-88911818-8653 客服电话:40081-36666 公司网站:www.jincheng.com.cn
100	泛华基金销售有限公司	注册地址:四川省成都市 办公地址:四川省成都市 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:028-86199382 客服电话:40081-36666 公司网站:www.fanhuafund.com.cn
101	嘉实基金管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:40081-36666 公司网站:www.jsfund.com.cn
102	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区 办公地址:深圳市福田区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-83563699 客服电话:40081-36666 公司网站:www.xinland.com.cn
103	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区 办公地址:北京市经济技术开发区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-59601366 客服电话:40081-36666 公司网站:www.hengtian.com.cn
104	北京铁桥基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:40081-36666 客服电话:40081-36666 公司网站:www.tieqiao.com.cn
105	深圳众成金融服务有限公司	注册地址:深圳市福田区 办公地址:深圳市福田区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:4006-788-887 客服电话:40081-36666 公司网站:www.zfzq.com.cn
106	深圳前海众成金融服务有限公司	注册地址:深圳市福田区 办公地址:深圳市福田区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:4006-788-887 客服电话:40081-36666 公司网站:www.zfzq.com.cn
107	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:40081-36666 公司网站:www.hymf.com.cn
108	北京创盈投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:400-6262-818 客服电话:40081-36666 公司网站:www.chuangying.com.cn
109	海银基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区 办公地址:上海市浦东新区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:40081-36666 公司网站:www.haibin.com.cn
110	上海聚泰资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区 办公地址:上海市浦东新区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-38507777 客服电话:40081-36666 公司网站:www.jutai.com.cn
111	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-67009888-6028 客服电话:40081-36666 公司网站:www.zcfund.com.cn
112	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区 办公地址:上海市虹口区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:400867266 网址:www.lidifund.com
113	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市虹口区 办公地址:上海市虹口区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-33329999 客服电话:400-820-2819 网址:www.hupai.com.cn
114	厦门同鑫股权投资有限公司	注册地址:厦门市思明区 办公地址:厦门市思明区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0592-3122679 客服电话:40081-36666 公司网站:www.tongxin.com.cn
115	泰和证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-61047808 客服电话:40081-36666 公司网站:www.tah.com.cn
116	中国建银投资有限责任公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-61047808 客服电话:40081-36666 公司网站:www.cib.com.cn
117	上海融金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区 办公地址:上海市浦东新区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:021-20659555 客服电话:40081-36666 公司网站:www.rongjin.com.cn
118	中投北证 北京 资产管理有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-83815510 客服电话:40081-36666 公司网站:www.ztbz.com.cn
119	中信期货有限公司	注册地址:北京市朝阳区 办公地址:北京市朝阳区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-59601366 客服电话:40081-36666 公司网站:www.citics.com.cn
120	北京元通基金销售有限公司	注册地址:北京市东城区 办公地址:北京市东城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-61047808 客服电话:40081-36666 公司网站:www.yuantong.com.cn
121	北京新鑫元基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区 办公地址:北京市西城区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:010-83815510 客服电话:40081-36666 公司网站:www.xinxinyuan.com.cn
122	珠海盈米基金销售有限公司	注册地址:珠海市横琴新区 办公地址:珠海市横琴新区 法定代表人:李永 联系人:李永 电话:0756-8696999 客服电话:40081-36666 公司网站:www.yingmi.com.cn
123	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的公告	

3.2 登记机构	南方基金管理有限公司
3.3 出具法律意见书的律师事务所	通所律师事务所
3.4 审计基金资产的会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
3.5 基金管理人	南方基金管理有限公司
3.6 基金托管人	中国工商银行股份有限公司
3.7 基金销售机构	南方基金管理有限公司
3.8 基金名称	南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
3.9 基金类型	股票型
3.10 基金的投资目标	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。
3.11 基金的投资范围	本基金主要投资于目标ETF基金份额,标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未赎回的目标ETF份额可计入在内),本基金每个交易日日终扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或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%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
3.12 基金的投资策略	如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金资产投资于目标ETF基金份额的相关规定和约定,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则,具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会。
3.13 基金的风险收益特征	本基金属于以目标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目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。
3.14 基金的风险收益特征	(一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.15 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.16 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.17 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.18 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.19 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.20 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.21 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.22 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.23 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.24 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.25 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.26 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.27 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.28 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.29 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.30 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.31 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.32 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.33 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.34 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.35 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.36 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.37 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.38 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.39 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.40 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.41 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取复制法,即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)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
3.42 基金的风险收益特征	(四)投资组合比例限制 本基金资产投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金资产净值的90%的资产投资于目标ETF。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对期货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
3.43 基金的风险收益特征	本基金管理人将对股指期货及其他金融衍生品的运用进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
3.44 基金的风险收益特征	2. 资产配置策略 (一)资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将不低于基金资产净值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、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。
3.45 基金的风险收益特征	(二)目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下: (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)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标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,无需召开基金份额持有人大会。
3.46 基金的风险收益特征	(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目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金