

# 深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

### (2012 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

本基金经 2011 年 6 月 7 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】886 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 9 月 16 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。

在投资本基金前，投资者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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

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 2012 年 9 月 16 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 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：潘鑫军

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

潘鑫军先生，董事长。国籍：中国，1961 年出生，澳门科技大学工商管理硕士。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长。历任中国工商银行股份有限公司上海分行长宁支行党委书记、行长兼国际机场支行党支部书记，东方证券股份有限公司党委副书记、总裁；党委书记、董事长兼总裁。

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，南洋交大 EMBA。现任新民晚报社总编辑、党委副书记。历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，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。现任哈佛上海中心董事总经理。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。

蔡来兴先生，独立董事，国籍：中国，1942 年出生，上海同济大学学士。现任国务院参事室特约研究员，中国国学中心顾问。曾任上海市委、市政府副秘书长，香港上海实业集团董事长，香港上海实业控股有限公司董事长。第九、十、十一届全国政协委员，经济委员会委员。

杨燕青女士，独立董事，国籍：中国，1971 年出生，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员，《第一财经日报》创刊编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人，《波士堂》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者，《第一财经日报》编委，2002-2003 年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

## 2、监事会成员

涂殷康先生，监事长。国籍：中国，1970 年 1 月出生，上海财经大学硕士研究生。现任东航金控控股有限责任公司总经理助理兼研发中心总经理。曾任职

于中国东方航空公司总经理办公室，历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理，东航金戎控股有限责任公司投资管理部经理。

任瑞良先生，监事。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。

李进安先生，监事。国籍：中国，1968 年出生，金融学博士，中国注册会计师、律师资格。现任东方证券股份有限公司合规总监，上海东方证券资产管理有限公司合规总监。历任君安证券南京业务部总经理，国泰君安证券股份有限公司江苏区总协调人，国泰君安证券股份有限公司南京太平南路营业部总经理，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监。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经理。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

### 3、高管人员

潘鑫军先生，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。

陈灿辉先生，副总经理。国籍：中国，1967 年出生，大学本科，历任中国银行软件开发工程师，招银电脑有限公司证券基金事业部负责人，华夏基金管理有限公司资深高级经理，招商基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理。2008 年 7 月加盟汇添富基金管理有限公司，现任公司副总经理、首席营运官。

雷继明先生，副总经理。国籍：中国，1971 年出生，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011 年 12 月加盟汇添富基金管理有限公司，现任公司副总经理。

#### 4、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，中国科学院数学与系统科学院应用数学专业博士后，六年证券从业经验。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 2 月加入汇添富基金管理有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师，2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

#### 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 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

## （二）主要人员情况

截至 2012 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 146 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2012 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 252 只，其中封闭式 7 只，开放式 245 只。自 2003 年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 31 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、申购赎回代理券商

## 1) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市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：杜庆平

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

网址：www.bhzq.com

客户服务电话：400-6515-988

## 2) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

## 3) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

## 4) 广发证券股份有限公司

法定代表人：林治海

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址：广东省广州天河区大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

开放式基金业务传真：(020) 87555305

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

5) 广州证券有限责任公司

注册地址：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：刘东

开放式基金咨询电话：020-961303

开放式基金业务传真：020-87325036

联系人：林洁茹

联系电话：020-87322668

6) 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：万建华

客户服务热线：4008888666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

7) 国信证券股份有限公司

注册地址：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

法人代表人：何如

基金业务联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

全国统一客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

8) 海通证券股份有限公司

注册地址：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：95553

公司网址：www.htsec.com

9) 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

电话：0871-3577398

传真：0871-3578827

10) 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

开放式基金咨询电话：400-889-5618

联系人：李微

联系电话：010-59355941

传真：010-66553791

网址：www.e5618.com

11) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

## 12) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

## 13) 信达证券股份有限公司

注册（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：高冠江

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](http://www.cindasc.com)

## 14) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

客服电话：95562

业务联系电话：021-38565785

业务联系人：谢高得

传真：021-38565955

兴业证券公司网站（[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)）

## 15) 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：4008-888-888

开放式基金业务传真：010-83574078

联系人：田薇

联系电话：010-66568430

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

16) 招商证券股份有限公司

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

客户服务电话：95565、4008888111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

17) 中航证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：0791-6768681

联系人：戴蕾

客户服务电话：400-8866-567

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。

## (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：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：严峰

电话：（0755）25946013

传真：（0755）25987122

### （三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：吕红、黎明

联系人：黎明

### （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（特殊普通合伙）

首席合伙人：吴港平住所：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、汤骏

业务联系人：汤骏

## 四、基金的名称

本基金名称：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金。

## 五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或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）。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，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。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

### （一）投资策略

本基金主要采取完全复制法，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。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效

跟踪标的指数的目的。

### 1、决策依据

有关法律法规、基金合同和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；基金经理负责决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

### 3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护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：ETF 投资管理小组依托基金管理人整体研究平台，整合内外部信息和研究成果，开展对标的指数的跟踪研究、对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数成份股流动性分析、对基金的跟踪误差及时进行归因分析等工作，并撰写相关研究报告，作为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 ETF 投资管理小组提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上，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 ETF 投资管理小组的研究报告，基金经理以完全复制标的指数的方法构建组合。在跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 风险监控：风险控制人员根据实时风险监控系统，在交易期间对 ETF 的各类风险源进行监控，一旦发现异常立即通知基金经理，基金经理将根据风险的具体情况，确定相应的应急操作方案。

(6) 投资绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，

并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期、对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

(7) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股的流动性状况、基金申购和赎回情况以及组合投资绩效评估的分析结果，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管理体制和程序做出调整，并在更新的招募说明书中公告。

## (二) 投资组合管理

### 1、构建投资组合

制定建仓策略制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取完全复制法确定目标组合，根据指数成份股的流动性和需买入数量建立基金的建仓策略，在基金合同生效之日起 3 个月内，按照建仓策略将不低于 90% 的基金资产投资于标的指数成份股、备选成份股。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在规定期限内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。

### 2、日常投资组合管理

(1) 可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。

(2) 投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用 ETF 投资管理系统适时调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

对比指对比指数与组合的每日及累计的绩效数据，检测跟踪误差及其趋势：分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源，进而决定需要对组合调整的部分及调整方法，并初步制定下一交易日的投资组合调整方案。

(4) 制作并公布申购赎回清单：以 T-1 日基金持有的证券及其比例为基础，

根据上市公司公告，考虑 T 日可能发生的上市公司变动情况，制作 T 日的申购赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理

基金管理人将定期（每月或每半年）进行投资组合管理，主要完成下列事项：

（1）定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案，经投资决策委员会审批后实施；

（2）根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案，经投资决策委员会审批后实施；

（3）根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行每月支付现金的准备。

### 4、投资绩效评估

（1）每日对基金的绩效评估进行，主要是对跟踪偏离度和跟踪误差进行评估；

（2）每月末，金融工程部对本基金的运行情况进行量化评估；

（3）每月末，基金经理根据量化评估报告，重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。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。

## （三）投资限制

### 1、投资组合限制

（1）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

（2）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(3) 在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

(4) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

(5) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。

由于证券期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;

(2) 向他人贷款或提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其

他行为。

对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证 300 指数。

深证 300 指数于 2009 年 11 月 4 日发布，其对深圳 A 股初步筛选后的样本股，根据平均流通市值及平均成交金额进行综合排名，选取排名靠前 300 只股票组成样本。

如果指数编制单位变更或停止深证 300 指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法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 2012 年 7 月 16 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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 投资组合报告

### 1 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	265,341,138.39	98.19
	其中：股票	265,341,138.39	98.19
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	4,296,352.94	1.59
6	其他资产	598,992.86	0.22
7	合计	270,236,484.19	100.00

### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末指数投资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	4,404,775.57	1.65
B	采掘业	13,836,799.99	5.18
C	制造业	155,776,246.45	58.28
C0	食品、饮料	28,297,981.00	10.59
C1	纺织、服装、皮毛	2,832,092.51	1.06
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,148,794.82	0.43
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,693,565.17	6.25
C5	电子	14,615,784.21	5.47
C6	金属、非金属	26,112,860.35	9.77
C7	机械、设备、仪表	46,229,197.70	17.30
C8	医药、生物制品	18,885,958.47	7.07
C99	其他制造业	960,012.22	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,508,455.98	1.69
E	建筑业	3,701,600.15	1.38
F	交通运输、仓储业	2,595,209.75	0.97
G	信息技术业	10,041,811.34	3.76
H	批发和零售贸易	11,769,547.71	4.40
I	金融、保险业	18,078,794.67	6.76
J	房地产业	24,257,474.85	9.08

K	社会服务业	7,682,924.91	2.87
L	传播与文化产业	3,471,116.61	1.30
M	综合类	5,216,380.41	1.95
	合计	265,341,138.39	99.28

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 3 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

### 3.1 报告期末指数投资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	000002	万科A	1,247,806	11,117,951.46	4.16
2	000858	五粮液	258,701	8,475,044.76	3.17
3	000651	格力电器	311,839	6,501,843.15	2.43
4	000157	中联重科	592,854	5,946,325.62	2.22
5	000001	深发展A	379,048	5,746,367.68	2.15
6	002024	苏宁电器	622,748	5,224,855.72	1.95
7	002304	洋河股份	33,598	4,520,610.90	1.69
8	000568	泸州老窖	99,900	4,226,769.00	1.58
9	000063	中兴通讯	269,713	3,765,193.48	1.41
10	000776	广发证券	120,201	3,585,595.83	1.34

### 3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 6 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8 投资组合报告附注

**8.1** 报告期内本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、处罚的情形。

**8.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	539,784.44
2	应收证券清算款	58,609.91
3	应收股利	-
4	应收利息	598.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	598,992.86

### 8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未进行积极投资，不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

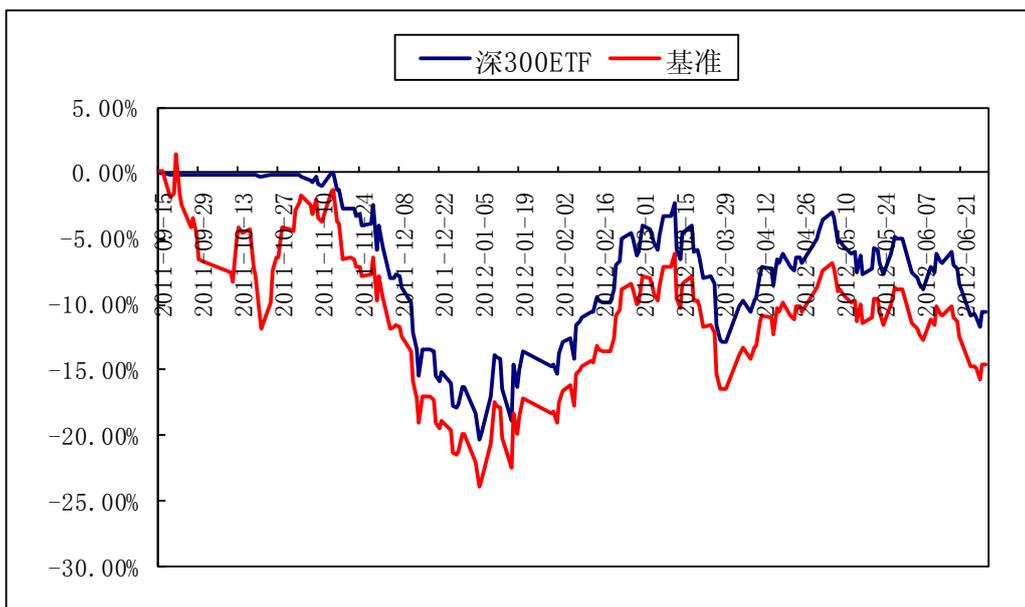
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金份额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)
2011年9月16日（基金合同生效日）至2011	-16.30%	0.98%	-20.05%	1.58%	3.75%	-0.60%

年 12 月 31 日						
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	6.74%	1.48%	6.64%	1.51%	0.10%	-0.03%
2011 年 9 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日	-10.64%	1.32%	-14.75%	1.54%	4.11%	-0.22%

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图



### 十三、基金的费用与税收

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的标的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金上市费及年费；
- 7、基金份额持有人大会费用；

- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的标的指数使用许可费

基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{标的指数使用许可费年费率} \div \text{当年天数}$ ，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数使用许可费年费率为

0.03%。

H 为每日应计提的基金标的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每年人民币 30 万元，即若不足人民币 30 万元则按照人民币 30 万元收取。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费率及计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率或基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率等，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 2 日在至少一种指定媒体上公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

### 一、“重要提示”部分：

更新了招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

### 二、“三、基金管理人”部分：

更新了主要人员情况。

### 三、“四、基金托管人”部分：

- 1、更新了主要人员情况。
- 2、更新了基金托管业务经营情况。
- 3、更新了基金托管人的内部控制制度。

### 四、“五、相关服务机构”部分：

更新了审计基金财产会计师事务所的相关消息。

### 五、“十、基金份额的申购与赎回”部分：

更新了申购赎回清单的内容与格式。

### 六、“十一、基金的投资”部分：

更新了基金投资组合报告。

### 七、“十二、基金的业绩”部分：

更新了基金业绩表现数据。

### 八、“二十四、其他应披露事项”部分：

更新了 2012 年 3 月 17 日至 2012 年 9 月 16 日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理有限公司

2012 年 10 月 31 日