上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(更新)招募说明书摘要

(2010年第1号)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

【重要提示】

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")经2009年8月17日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】795号文核准募集。本基金基金合同于2009年9月25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。

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财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

投资有风险,投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、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2010年3月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31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)基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司

住所:上海市交通银行大楼二层(邮)

办公地址:上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼

邮政编码:200120

法定代表人:彭纯

成立时间:2005年8月4日

注册资本:2亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:陈超

电话:(021)61055050

传真:(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称"公司")经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

彭纯先生,董事长,博士学历。历任新疆财经学院讲师、教研室主任、科研处副处长、经济研究所副所长;新疆维吾尔自治区党委政研室副处长、处长;1994年起历任交通银行乌鲁木齐分行副行长、行长、南宁分行行长、广州分行行长、交通银行总行行长助理;现任交通银行执行董事、副行长。

雷贤达先生,副董事长,学士学历,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理(香港)有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长、办公厅主席秘书、基金监管部处长、交银施罗德基金管理有限公司副总经理。

阮红女士,董事,博士学历。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理,现任交通银行投资管理部总经理。经公司股东会2007年第五次会议通过,免去公司董事金大捷先生的职务,选举阮红女士担任公司董事。

吴伟先生,董事,博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长,总行预算财务部副总经理,现任交通银行总行预算财务部总经理。

葛礼达先生,董事,大专。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官,现任施罗德集团亚太地区总裁。

孙邦祥女士,独立董事,博士学历、国务院政府特殊津贴专家、博士生导师。现任北京大学经济学院副院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生,独立董事,博士学历。历任中国人民大学讲师、中国社会科学院财贸所金融研究中心研究员,现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员,北京创业投资协会常务副理事长、秘书长。

陈家乐先生,独立董事,博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授,现任香港科技大学金融学系系主任。

2、基金管理人监事会成员

康定选先生,监事长,EMBA,高级经济师。历任河南巩县农业银行信贷股信贷员、副股长,巩县支行副行长;郑州市农业银行行政区办事处副主任;交通银行郑州分行信贷部副主任、计划信贷处处长、副行长;交通银行南京分行副行长、行长;交通银行上海分行行长。

金玉凤女士,监事,学士学历。历任海通证券有限公司办公室副主任(主持工作)、交通银行信托部主任科员、交通银行基金托管部综合处副处长、交通银行资产托管部客户服务处处长,现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

裴关淑(又女士,监事,CFA、CIPM、FRM,双硕士学位。历任施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、业务延续计划的负责人。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员,负责营运及IT部分。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

3、公司高管人员

彭纯先生,董事长,博士学历。简历同上。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。简历同上。

吴建中先生,督察长,大专学历。历任交通银行宁波分行副行长、行长、交通银行风险资产管理部副总经理、总经理、交通银行宁波分行行长、党委书记。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

谢卫先生,副总经理,经济学博士,高级经济师。历任中央财经大学金融系教员;中国社会科学院财经所助理研究员;中国电力信托投资公司基金部副经理;中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理,富国基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

屈乐伟先生,基金经理。数理系硕士。14年证券投资从业经验。历任广发证券北京业务总部研发部经理、投资部经理;华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理助理。2006年6月加入交银施罗德基金管理有限公司。

何晓彬先生,基金经理助理。经济学博士,FRM。6年基金行业从业经验。历任长城基金管理公司金融工程小组数量分析师。2006年7月加入交银施罗德基金管理有限公司,担任金融工程部总经理助理、数量分析师。

5、投资决策委员会成员

委员:项廷锋(投资总监)

莫泰山(总经理)

华昕(研究总监,基金经理)

周炜炜(投资副总监,基金经理)

崔海峰(权益部副总经理,基金经理)

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

法定代表人:项俊波

成立时间:2009年1月15日

注册资金:2600亿元人民币

存续期间:持续经营

电话:(010)68424199

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"作你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2010年3月25日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共75只,包括上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成动力股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、中万巴黎奇净优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基础股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、申购赎回代理券商(简称"一级交易商")

(1)光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

电话:(021)22169999

传真:(021)22169134

联系人:刘晨

客户服务电话:10108998

网址:www.ebscn.com

(2)国泰君安证券股份有限公司

住所: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层

法定代表人:祝幼一

电话:(021)38676161

传真:(021)38670161

联系人:芮敏祺

客户服务电话:95521,400-8888-666

网址:www.gtja.com

(3)中信建投证券有限责任公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:黎晓宏

电话:(010)65186080

传真:(010)65182261

联系人:魏明

客户服务电话:400-888-8108

网址:www.csc108.com

(4)海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:(021)53594566

传真:(021)53858549

联系人:金芸、杨薇

客户服务电话:400-8888-001,(021)62503

网址:www.htsec.com

(5)广发证券股份有限公司

住所:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼

法定代表人:王志伟

传真:(020)87555305

联系人:肖中梅

客户服务电话:95575或致电各地营业网点

网址:www.gf.com.cn

(6)中国银河证券股份有限公司

住所: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

电话:(010)66568047

联系人:李洋

客户服务电话:400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

(7)招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址: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:黄健

客户服务电话:400-8888-111,95565

网址:www.newone.com.cn

(8)申银万国证券股份有限公司

住所: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

联系人:黄维琳

客户服务电话:(021)962505

网址:www.sw2000.com.cn

(9)兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层

法定代表人:兰荣

电话:(021)38565785

传真:(021)38565783

联系人:杨盛芳

客户服务电话:400-8888-123

网址:www.xyzq.com.cn

(10)华泰联合证券有限责任公司

住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

电话:(0755)82492000

传真:(0755)82492962

联系人:盛宗凌

客户服务电话:95513,400-8888-555

网址:www.lhzq.com

(11)湘财证券有限责任公司

住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:上海浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦五层

法定代表人:陈学荣

电话:(021)68634518

传真:(021)68865680

联系人:钟康莺

客户服务电话:400-888-1551或当地营业部客服电话

网址:www.xcsc.com

(12)华泰证券股份有限公司

住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:(025)84457777-950.248

传真:(025)84579778

联系人:李金龙、张小波

客户服务电话:(025)95597

网址:www.htsc.com.cn

(13)中信金通证券有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:(0571)85776115

传真:(0571)85783771

联系人:俞会亮

客户服务电话:(0571)96598

网址:www.96598.com.cn

(14)中信万通证券有限责任公司

住所:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

客户服务电话:(0532)96577

网址:www.zxwt.com.cn

(15)恒泰证券股份有限公司

住所:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号

法定代表人:刘汝军

传真:(021)68405181

客户服务电话:(0471)4960762,(021)68405273

网址:www.cnht.com.cn

(16)国信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦

法定代表人:何如

电话:(0755)82130833

传真:(0755)82133302

联系人:齐晓燕

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(17)万国证券股份有限公司

住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

电话:(0755)82558305

传真:(0755)82558355

联系人:陈剑虹

客户服务电话:400-800-1001

网址:www.axzq.com.cn

(18)长江证券股份有限公司

住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

电话:(021)63219781

传真:(021)51062920

联系人:李良

客户服务电话:4008-888-999,(027)85808318

网址:www.95579.com

(19)德邦证券有限责任公司

住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人:方加春

电话:(021)68761616

传真:(021)68767981

客户服务电话:4008-888-128

网址:www.tebon.com.cn

(20)齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李玮

客户服务电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

(21)江海证券有限公司

住所:哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

电话:(0451)82269280

传真:(0451)82269290

客户服务电话:400-666-2288

联系人:徐世旺

网址:www.jhzq.com.cn

(22)平安证券有限责任公司

住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

法定代表人:杨宇翔

电话:(0755)22627802

传真:(0755)82433794

联系人:袁月

客户服务电话:95511,400-886-6338

网址:www.pingan.com

(23)中国国际金融有限公司

住所:北京建国门外大街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甲6号SK大厦3层

法定代表人:李剑阁

网址:www.cicc.com.cn

(24)长城证券有限责任公司

住所: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)83516289

传真:(0755)83516199

联系人:匡婷

客户服务电话:(0755)33680000,400-6666-888

网址:www.cc168.com.cn

(25)国金证券股份有限公司

住所: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:王晋勇

电话:(028)86690126

传真:(028)86690126

联系人:金喆

客户服务电话:400-6600-109

网址:www.gjzq.com.cn

(26)西南证券股份有限公司

注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25楼

办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25楼

法定代表人:王珠林

联系人:秦泊国

电话:023-63721712

传真:023-63786215

客户服务电话:400-809-6096

网址:www.swsc.com.cn

(27)国都证券有限责任公司

住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人:王少华

客户服务电话:400-818-8118

网址:www.guodu.com

(28)江南证券有限责任公司

住所: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:姚江涛

电话:(0791)6768763

传真:(0791)6789414

联系人:戴蕾

客户服务电话:(0791)6768763

网址:www.scstock.com

(29)渤海证券股份有限公司

住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人:张志军

联系人:王兆权

客户服务电话:400-651-5988

网址:www.bhzq.com

(30)宏源证券股份有限公司

住所:新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法定代表人:汤世生

电话:(010)88085338

传真:(010)88085240

联系人:李巍

客户服务电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

(31)东方证券股份有限公司

住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

电话:(021)63325888

传真:(021)63326173

联系人:吴宇

客户服务电话:95503

网址:www.dfzq.com.cn

(32)中信证券股份有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人:王东明

电话:(010)84588266

传真:(010)84865560

联系人:陈忠

客户服务电话:(010)84588903

网址:www.cs.ecitic.com

(33)国元证券股份有限公司

住所: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:凤良志

客户服务电话:400-8888-777

网址:www.gyzq.com.cn

(34)东北证券股份有限公司

住所:长春市自由大路1138号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

电话:(0431)85096709

联系人:潘锴

客户服务电话:(0431)96688-0,(0431)85096733

网址:www.nesc.cn

(35)万正证券有限责任公司

住所:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰

联系人:彭博

联系电话:(0731)85832343

传真:(0731)85832342

客户服务电话:95571

网址:www.foundersc.com

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海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的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:金颖

电话:(021)58872625

传真:(021)68870311

联系人:刘永卫

(三)出具法律意见书的律师事务所

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

办公地址: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

联系人:黎明

经办律师:吕红、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有限公司

住所:上海市浦东新区东昌路568号

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:金毅

经办注册会计师:薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称:上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:交易型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下指数化投资比例,即投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例,不低于基金资产净值的95%。此外,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。如因标的指数成份股调整、基金份额申购赎回清单内现金替代、现金差额等因素导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个交易日内进行调整。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种(如股指期货等),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

本基金采用完全复制法,跟踪上证180公司治理指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上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。

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

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、决策和交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会的主要职责是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。

基金经理的主要职责是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。

中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估及组合维护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:金融工程部依托公司整体研究平台,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,以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金融工程部提供的研究报告,定期召开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,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理以完全复制指数成份股权重的方法构建组合。在追求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,以降低买入成本,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)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。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,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变动,结合成份股基本面情况、成份股公司行为、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,采取适当的跟踪技术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程序做出调整,并在基金招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证180公司治理指数。

本基金标的指数变更的、业绩比较基准随之变更并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票基金,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,紧密跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

十一、基金投资组合报告

本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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2010年4月19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。

本投资组合报告期为2010年1月1日至2010年3月31日,所载财务数据未经审计师审计。

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	5,899,660,538.87	99.65
	其中:股票	5,899,660,538.87	99.65
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	20,730,318.93	0.35
6	其他资产	261,741.91	0.00
7	合计	5,920,652,599.71	100.00

注:本表权益投资股票项中,含可退替代款估值增值-394.00元,而5.2.2合计项中不含可退替代款估值增值,因此二者存在上述差异。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)权益投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(2)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	9,452,306.02	0.16
B	采掘业	742,973,882.44	12.56
C	制造业	908,704,438.39	15.36
C0	食品、饮料	26,002,971.84	0.44
C1	纺织、服装、皮毛	39,562,816.05	0.67
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	104,323,633.80	1.76
C5	电子	22,345,310.40	0.38
C6	金属、非金属	355,991,524.23	6.02
C7	机械、设备、仪表	313,219,896.57	5.29
C8	医药、生物制品	47,258,285.50	0.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	314,797,401.40	5.32
E	建筑业	207,283,658.60	3.50
F	交通运输、仓储业	370,113,600.86	6.26
G	信息技术业	212,631,614.67	3.59
H	批发和零售贸易	59,914,863.76	1.01
I	金融、保险业	2,712,719,466.77	45.85
J	房地产业	220,162,342.14	3.72
K	社会服务业	36,073,225.18	0.61
L	传播与文化产业	21,624,662.40	0.37
M	综合类	83,209,470.24	1.41
	合计	5,899,660,932.87	99.72

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

(1)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	600036	招商银行	27,100,134	441,190,181.52	7.46
2	601318	中国平安	6,293,529	317,193,861.60	5.36
3	600016	民生银行	41,242,016	317,151,103.04	5.36
4	600030	中信证券	10,164,812	288,883,957.04	4.88
5	601166	兴业银行	7,670,094	283,179,870.48	4.79
6	600000	浦发银行	11,604,032	264,339,848.96	4.47
7	601088	中国神华	7,227,984	208,888,737.60	3.53
8	601601	中国太保	6,887,653	185,966,631.00	3.14
9	601398	工商银行	32,081,563	159,766,183.74	2.70
10	600837	海通证券	9,015,665	152,364,738.50	2.58

(2)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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期期末未持有债券。

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

本基金本报告期期末未持有债券。

6、本基金本报告期末未持有资产支持证券

7、本基金本报告期末未持有权证

8、投资组合报告附注

(1)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,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)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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	250,000.00
2	应收证券清算款	1,392.20
3	应收股利	-
4	应收利息	4,044.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	6,305.14
9	合计	261,741.91

(4)本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)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;本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

基金业绩截止日为2010年3月31日,所载财务数据未经审计师审计。

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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本报告期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

阶段	净值增长率①①	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	-6.35%	1.34%	-6.58%	1.35%	0.23%	-0.01%
2009年度(2009年9月25日至2009年12月31日)	1.61%	1.31%	14.24%	1.79%	-12.63%	-0.48%
自基金合同生效起至今	-4.85%	1.32%	6.72%	1.60%	-11.57%	-0.28%

2、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

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年9月25日至2010年3月31日)

注:本基金基金合同生效日为2009年9月