上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二〇一〇年十月

重要提示

本基金根据2010年9月1日中国证券监督管理委员会《关于核准上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可【2010】1203 号)和2010年10月15日《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2010】611号)的核准,进行募集。

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。

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,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,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、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。

本基金为股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金初始募集净值1元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它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。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

一、绪言

《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称"本招募说明书")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")及其他有关规定以及《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

本合同、《基金合同》:	《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充;
中国:	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区);
法律法规:	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
《基金法》:	《中华人民共和国证券投资基金法》;
《销售办法》:	《证券投资基金销售管理办法》;
《运作办法》:	《证券投资基金运作管理办法》;
《信息披露办法》:	《证券投资基金信息披露管理办法》;
元:	中国法定货币人民币元;
基金或本基金:	依据《基金合同》所募集的上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金;
招募说明书:	《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新;
托管协议:	基金管理人与基金托管人签订的《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
发售公告:	《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》;
交易型开放式指数证券投资基金:	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金";
联接基金:	指将其绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的本基金,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作的基金;
中国证监会:	中国证券监督管理委员会;
银行监管机构:	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构;
基金管理人:	华安基金管理有限公司;
基金托管人:	中国工商银行股份有限公司;
基金份额持有人:	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者;
发售代理机构:	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构;
发售协调人:	由基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构;
申购赎回代理券商:	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司;
代销机构:	发售代理机构和/或申购赎回代理券商;
直销机构:	华安基金管理有限公司;
销售机构:	直销机构和/或代销机构;
基金销售网点:	直销机构的直销中心和/或代销机构的代销网点;
登记结算业务:	《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、过户、清算和结算业务;
登记结算机构:	中国证券登记结算有限责任公司;
《基金合同》当事人:	受《基金合同》约束,根据《基金合同》享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;
个人投资者:	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人;
机构投资者:	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织;
合格境外机构投资者:	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者;
投资者:	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称;
基金合同生效日:	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日;
募集期:	自基金份额发售之日起不超过3个月的期限;
基金存续期:	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间;
日/天:	公历日;
月:	公历月;
工作日:	上海证券交易所的正常交易日;
开放日:	销售机构办理本基金份额申购、赎回或其他业务的工作日;
T日:	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日;
T+n日:	自T日起第n个工作日(不包含T日);
认购:	在本基金募集期内投资者申请购买本基金基金份额的行为;
发售:	在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为;
申购:	基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人申请购买基金份额的行为;
赎回:	基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人卖出基金份额的行为;
申购、赎回清单:	由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件;
申购对价:	投资者申购基金份额时,按《基金合同》和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;
赎回对价:	基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按《基金合同》和招募说明书规定应交付给该基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;
标的指数:	本基金跟踪的基准指数,是由上海证券交易所发布的上证龙头企业指数及其未来可能发生的变更;
完全复制法:	一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券,并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例,以达到复制指数的目的;
最小申购、赎回单位:	本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍;
组合证券:	本基金标的指数所包含的全部或部分证券;
现金替代:	申购、赎回过程中,投资者按《基金合同》和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金;
现金差额:	最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算;
基金份额参考净值:	指上海证券交易所在交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值,简称IOPV;
预估现金部分:	指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金,由基金管理人计算并公布的现金数额;
基金账户:	基金登记结算机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额余额及其变动情况的账户;
交易账户:	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户;
指定交易:	《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的"全面指定交易";
基金份额折算:	基金管理人根据《基金合同》规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为;
基金利润:	基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;
基金收益评价日:	基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之基准日;
基金累计报酬率:	基金收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);
标的指数同期累计报酬率:	收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);
基金资产总值:	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和;
基金资产净值:	基金资产总值扣除负债后的净资产值;
基金份额净值:	计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值;
基金资产估值:	计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程;
货币市场工具:	现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具;
指定媒体:	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站;
不可抗力:	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:华安基金管理有限公司
2、住所:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
3、法定代表人:李勍
4、设立日期:1998年6月4日
5、批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字【1998】20号
6、联系电话:(021)38969999
7、联系人:冯颖
8、客户服务中心电话:40088-50099
9、网址:www.huaan.com.cn

(二)注册资本和股权结构

1、注册资本:1.5亿元人民币

2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气(集团)总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

(1)董事会

俞妙根先生,大学学历,高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理,上海国际信托投资有限公司副总经理。2006年11月加入华安基金管理有限公司,并主持公司日常经营工作,历任公司代理董事长、副董事长兼总裁、董事长兼总裁,现任华安基金管理有限公司董事长。

冯祖新先生,研究生学历。历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员,上海市经济委员会信息中心副主任、主任,上海市工业投资公司副总经理、总经理,上海工业投资(集团)有限公司副总裁,现任上海工业投资(集团)有限公司总裁、法定代表人、党委副书记。

陈兵先生,研究生学历,高级经济师。历任安徽岳西监察局监察干事,上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理、总行资金财务部总经理助理、个人银行总部管理会计部总经理、财富管理部总经理,现任上海国际信托有限公司副总经理、董事会秘书。

马名驹先生,大学学历,高级会计师。历任上海凤凰自行车股份有限公司副董事长兼总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理,上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理,锦江国际(集团)有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理、上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

董鑑华先生,大学学历,高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科员、副处长、处长,上海市审计局财政审计处处长,现任上海电气(集团)总公司财务总监。

王松先生,研究生学历,高级经济师。历任建设银行总行投资部职员,国泰证券有限公司北京办事处副主任、发行二部副总经理、债券部总经理,国泰君安证券股份有限公司债券业务一部总经理、固定收益证券总部总经理、固定收益证券总部总监、总裁助理,现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

独立董事:

萧灼基先生,研究生学历,教授。现任全国政协委员,政协经济委员会委员,北京大学经济学院教授,博士生导师,北京市、云南省、吉林省、成都市,武汉市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生,研究生学历,教授。历任上海财经大学科研处处长,上海财经大学南德管理学院院长,上海财经大学常务副校长,现任上海国家会计学院院长、党委书记,APEC金融与发展项目执行秘书处秘书长,兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2)监事会

谢伟民先生,研究生学历,副教授。历任上海市城建沪南工务所干部,空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师,上海市计委直属机关党委干事,中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员(副处级)、副处长,中共上海市金融工作党委组织处(宣传处)副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记(正处级)。

陈涵女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长,现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生,研究生学历,高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长,上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长,现任上海电气(集团)总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

徐丹女士,研究生学历,高级会计师,中国注册税务师。历任上海石化总厂计财处会计、财务副科长,中石化上海金山实业公司财务处副处长,上海金山实业投资发展有限公司总会计师兼财务部主任,上海金山区财政局副局长,中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实华经济发展公司财务部经理,现任上海工业投资(集团)有限公司总会计师。

李梅清女士,大专学历,会计师。历任上海新亚(集团)股份有限公司财务部副经理、上海新亚(集团)有限公司财务部副经理,锦江国际(集团)有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理,上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

汪宝山先生,大学学历,经济师。历任建行上海市分行团委书记,直属党委书记,建行宝山宝钢支行副行长,建行上海市分行办公室副主任,国泰证券公司综合管理部总经理,公司专职党委副书记兼行政管理部总经理,公司专职党委副书记兼上海营业总部总经理,国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记,公司党委委员、工会主席,现任国泰君安投资管理股份有限公司董事长、党委书记、国泰君安证券股份有限公司党委委员。

赵敏先生,研究生学历,助理研究员。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理,现任华安基金管理有限公司客户服务与电子商务部总经理。

诸慧女士,研究生学历,经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监助理,现任华安基金管理有限公司集中交易部总经理。

(3)高级管理人员

俞妙根先生,大学学历,高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理,上海国际信托投资有限公司副总经理。2006年11月加入华安基金管理有限公司,并主持公司日常经营工作,历任公司代理董事长、副董事长兼总裁、董事长兼总裁,现任华安基金管理有限公司董事长。

李勍先生,大学学历,高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。历任中国兴南(集团)公司证券投资部副总经理,北京汇正财经顾问有限公司董事总经理,上海证券交易所深圳办事处主任,自2001年开始,长驻香港任职中国投资信息有限公司董事总经理,现任华安基金管理有限公司总裁。

邵杰军先生,研究生学历,15年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理,现任华安基金管理有限公司常务副总裁。

韩勇先生,研究生学历,经济学博士。16年证券、期货、基金从业经验。曾在君安证券有限公司、华夏证券有限公司从事投资银行工作,在中国证券监督管理委员会从事监管工作,现任华安基金管理有限公司副总裁。

李炳旺先生,研究生学历,23年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理,现任华安基金管理有限公司副总裁。

章国富先生,研究生学历,22年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作)、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监,现任华安基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

许之彦先生,理学博士,CQF(国际数量金融工程师),7年证券、基金从业经历,曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作。2005年加入华安基金管理有限公司,现任金融工程部总经理。2008年4月25日起至今担任华安中国A股增强指数基金的基金经理。2009年9月5日起至今担任华安上证180ETF的基金经理。2009年9月29日起至今担任华安上证180ETF联接基金的基金经理。

牛勇先生,复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),6年证券、金融从业经历,曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任金融工程部高级金融工程师。2009年7月3日至2010年9月2日担任华安中国A股增强指数基金的基金经理助理。2010年6月18日起至今担任华安上证180ETF的基金经理。2010年9月2日起至今担任华安中国A股增强指数基金的基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度,投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

李　勍先生,总裁
王国卫先生,首席投资官
孙志方先生,总裁助理
尚志民先生,基金投资部总经理
宋　磊先生,研究发展部总经理
诸　慧女士,集中交易部总经理

上述人员之间不存在亲属关系。

4、业务人员的准备情况

公司目前共有员工245人,主要来自国内外证券公司等金融机构,其中74.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历,具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

(四)基金管理人的职责

根据《基金法》的规定,基金管理人应履行以下职责:

1、依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制半年度和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、中国证监会规定的其他职责。

(五)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生;

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守、滥用职权;
(7)泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(8)除为基金管理人进行基金投资外,直接或间接进行其他股票交易;
(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
(10)其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨,按照诚实信用、勤勉尽责的原则,严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定,不断更新投资理念,规范基金运作。

5、基金经理承诺

(1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取不当利益;
(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(4)除为基金管理人进行基金投资外,不直接或间接进行其他股票交易,也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1)健全性原则

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2)有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内控制度的有效执行。

(3)独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4)相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5)成本效益原则

公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构,以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言,包括以下组成部分:

(1)董事会:董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

(2)监事会:监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

(3)督察长:督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查,直接向公司董事会和中国证监会报告。

(4)合规与风险管理委员会:合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构,以召开例会形式开展工作,向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

(5)合规监察稽核部:合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查,向公司合规与风险管理委员会和总经理报告。

(6)各业务部门:内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内,对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括:控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

(1)控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础,包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来,通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识,致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设,建立了公司内部控制体系。

(2)风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查,发现风险,将风险进行分类、按重要性排序,找出风险分布点,分析其发生的可能性及对目标的影响程度,评估目前的控制程度和风险高低,找出引致风险产生的原因,采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后,确定应进一步采取的对应措施,对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善,并监督各个环节的改进实施。

(下转D14版)

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1、上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可【2010】1203号文批准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是交易型,开放式,股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行"),本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、本基金自2010年10月25日起至2010年11月12日止通过销售机构公开进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。其中,网下现金认购的日期为2010年10月25日至2010年11月12日;通过发售代理机构进行的网下股票认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日,通过基金管理人进行的网下股票认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日;网上现金认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日,如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

6、本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

7、本基金管理人可办理网下现金发售和网下股票发售。

8、本基金的网下现金发售和网下股票发售代理机构为国泰君安证券股份有限公司等。

9、投资者认购本基金时需持有上海证券交易所A股账户(以下简称"A股账户")或上海证券交易所证券投资基金账户(以下简称"基金账户")。

(1)如投资者需新开立证券账户,则应注意:

① 基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回,则应开立A股账户。

② 开户当日无法办理指定交易,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2)如投资者已开立证券账户,则应注意:

① 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

② 当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购前至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

③ 使用专用交易单元的机构投资者无需办理指定交易。

10、本基金认购费用或认购佣金比率不超过认购份额的1%。

11、网上现金认购以基金份额申请。网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份;投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。

网下股票认购以单只股票股数申报,用于认购的股票必须是上证龙头企业指数的成份股和已经公告的备选成份股(具体见本公告)。投资者通过发售代理机构进行网下股票认购的,单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分必须为100股的整数倍;投资者通过基金管理人进行网下股票认购的,单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分必须为100股的整数倍,单笔认购份额必须在100万份以上(含100万份)。投资者可以多次认购,累计认购不设上限。

12、网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购、网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

13、销售网点(指基金管理人和/或代销机构的代销网点)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实接受了认购申请,申请的成功确认应以登记结算机构的确认登记为准。投资者可以在《基金合同》生效后通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

14、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2010年10月20日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.huaan.com.cn)及各地代销机构网站。投资者亦可通过本公司网站了解本公司的详细情况和本基金发售的相关事宜。

15、各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。在发售期间,除本公告所列的发售代理机构外,如增加其他发售代理机构,或已有发售代理机构增加新的代销网点,将及时公告。

16、投资者如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话(40088-50099)、基金托管人中国工商银行客服电话(95588)以及各销售代理机构客户服务电话。

17、本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整。

18、基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,报上海证券交易所,经有关部门认可后,由上海证券交易所公告。本基金上市后,指定交易未在申购赎回代理券商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖,如投资者需进行本基金的申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

19、风险提示

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,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。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

20、本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

1、基金名称

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(基金认购代码:510193)。

2、基金代码及简称

基金代码:510190
简称:龙头ETF

3、基金类型

股票型基金,指数基金。

4、运作方式

交易型,开放式。

5、基金存续期限

不定期。

6、基金份额发售面值

每份基金份额发售面值为1.00元人民币。

7、募集目标

本基金不设募集规模上限。

8、投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

9、募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

10、销售机构

(1)发售协调人:国泰君安证券股份有限公司

(2)网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构:本公司

(3)网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构

国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、湘财证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、江海证券有限公司、厦门证券有限公司、中天证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司等

(4)网上现金发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的90家证券公司:国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、民生证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华西证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、中航证券有限公司、一创业证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、联讯证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、江海证券有限公司、银泰证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司、爱建证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、天风证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、北京高华证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、恒泰长财证券有限责任公司等。

(5)如本次募集期间,新增代销机构,将另行公告。

11、募集时间安排

本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。本基金自2010年10月25日至2010年11月12日进行发售。其中,网下现金认购的日期为2010年10月25日至2010年11月12日;通过发售代理机构进行的网下股票认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日,通过基金管理人进行的网下股票认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日;网上现金认购的日期为2010年11月10日至2010年11月12日,如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

12、基金备案与基金合同生效

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。募集的股票由登记结算机构予以冻结。

本基金募集期届满后,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额(含募集股票市值)不少于2亿元人民币且基金份额持有人不少于200人的条件下,基金管理人依法向中国证监会办理基金备案手续,自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,《基金合同》生效,并于收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

若3个月的基金募集期届满,本基金仍未达到法定备案条件,本基金管理人应承担全部募集费用,并将所募集的资金加计同期银行活期存款利息在基金募集期结束后30天内退还给认购人,同时登记结算机构将已冻结的股票解冻。如基金募集失败,基金管理人、基金托管人不得请求报酬。基金管理人、基金托管人为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

13、认购期利息和股票的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资者所有,份额计算时采用四舍五入的方法,保留到整数位,由此产生的损益计入基金资产。其中,利息转份额以基金管理人的记录为准。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息,计入基金财产,不折算为投资者基金份额。投资者以股票认购的,认购股票由登记结算机构予以冻结,冻结期间的权益归投资者所有。

14、基金认购费用

(1)基金份额的认购费用

认购费用由投资者承担,认购费率不高于1%,认购费率如下表所示:

认购份额	认购费率
50万份以下	1.0%
50万份(含)—100万份	0.5%
100万份以上(含)	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

(2)认购费用和认购佣金的计算方法

① 通过基金管理人进行网下现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购费用和认购金额的计算公式为:

认购费用=认购份额×认购费率
认购金额=认购份额×(1+认购费率)
净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额面值

投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。认购费用由基金管理人在投资者认购确认时收取,投资者需以现金方式交纳认购费用。

例一:某投资者通过基金管理人认购本基金800,000份,认购费率为0.5%,假定认购金额产生的利息为100元,则该投资者的认购金额为:

认购费用=800,000×0.5%=4,000元
认购金额=800,000×(1+0.5%)=804,000元

该投资者所得认购份额为:

净认购份额=800,000+100/1.00=800,100份

即,若该投资者通过基金管理人认购本基金800,000份,则该投资者的认购金额为804,000元,假定该笔认购金额产生的利息为100元,则可得到800,100份基金份额。

② 通过发售代理机构进行网上现金认购、网下现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购佣金和认购金额的计算公式为:

认购佣金=认购份额×佣金比率
认购金额=认购份额×(1+佣金比率)

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取,投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例二:某投资者通过某发售代理机构采用现金方式认购1,000份本基金,假设该发售代理机构确认的佣金比率为1%,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=1,000×1%=10元
认购金额=1,000×(1+1%)=1,010元

即投资者需准备1,010元资金,方可认购到1,000份本基金基金份额。

③ 通过基金管理人或发售代理机构进行网下股票认购的投资者,认购以单只股票股数申请,在发售代理机构允许的条件下,投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金;通过基金管理人进行的网下股票认购,投资者须以现金方式支付认购费用。认购份额和认购费用/佣金的计算公式为:

A、如投资者选择以现金方式支付认购费用/佣金,则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下:

认购费用=固定认购费用,或认购佣金=认购份额×佣金比率

其中,"第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价"及"有效认购数量"由基金管理人确认,具体规定见本基金招募说明书。

例三:股票A和股票B均为上证龙头指数成份股,某投资者持有100,000股股票A和200,000股股票B,通过基金管理人网下股票认购本基金。假设认购期最后一日股票A和股票B的均价分别为15.50元和4.50元,基金管理人确认的有效认购数量为100,000股股票A和200,000股股票B,基金管理人确认的认购费用为1,000元,投资者以现金的方式交纳认购费用,则其可得到的基金份额和需支付的认购费用如下:

认购份额=(100,000×15.50)/1.00+(200,000×4.50)/1.00=2,450,000份
认购费用=1,000元

即投资者可认购到2,450,000份本基金基金份额,并需另行支付1,000元的认购费用。

B、如投资者选择以基金份额方式支付认购佣金,则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下:

认购佣金=认购份额/(1+佣金比率)×佣金比率
净认购份额=认购份额—认购佣金/1.00

其中"第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价"及"有效认购数量"由基金管理人确认,具体规定见本基金招募说明书。

以基金份额方式支付的认购佣金的计算保留到整数位,小数点后部分舍去。

例四:股票A和股票B均为上证龙头指数成份股,某投资者持有10,000股股票A和20,000股股票B,通过某发售代理机构网下股票认购本基金,选择以现金支付认购佣金。假设认购期最后一日股票A和股票B的均价分别为15.50元和4.50元,基金管理人确认的有效认购数量为10,000股股票A和20,000股股票B,发售代理机构确认的佣金比例为1.0%,则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下:

认购份额=(10,000×15.50)/1.00+(20,000×4.50)/1.00=245,000份
认购佣金=245,000×1%=2,450元

即投资者可认购到245,000份本基金基金份额,并需另行支付2,450元的认购佣金。

假设该投资者选择以基金份额的方式交纳认购佣金,则投资者最终可得的净认购份额为:

认购份额=(10,000×15.50)/1.00+(20,000×4.50)/1.00=245,000份
认购佣金=245,000/(1+1%)×1%=2,425份
净认购份额=245,000—2,425=242,575份

二、募集方式及相关规定

1、本基金在募集期内面向个人和机构投资者同期发售,投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。网上现金认购以基金份额申请;网下现金认购以基金份额申请;网下股票认购以单只股票股数申报,用于认购的股票必须是上证龙头企业指数的成份股和已经公告的备选成份股。

2、本公司直销网点接受本基金的网下现金认购和网下股票认购。本公司直销网点接受投资者单笔认购份额在10万份以上(含10万份)的网下现金认购申请;以及投资者单笔认购份额在100万份以上(含100万份)的网下股票认购申请,单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过部分必须为100股的整数倍。

3、发售代理机构的代销网点接受本基金的网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购申请。发售代理机构接受投资者单笔认购份额为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份的网上现金认购申请;单笔认购份额为1,000份或其整数倍的网下现金认购申请;以及单只股票股最低认购申报股数为1,000股,超过部分为100股的整数倍的网下股票认购申请。

4、募集期内投资者可以多次认购,累计认购不设上限。

5、网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请;网下现金认购和网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

三、投资者的开户

投资者认购本基金时需具有上海证券交易所的A股账户或基金账户。

1、如投资人需新开立证券账户,则应注意:

(1)基金账户只能进行基金的二级市场交易,如投资人需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立A股账户。

(2)开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2、如投资人已开立证券账户,则应注意:

(1)如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2)当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购,建议投资人在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(3)使用专用交易单元的机构投资者无需办理指定交易。

四、网上现金认购的程序

1、业务办理时间:2010年11月10日至2010年11月12日上午9:30-11:30和下午13:00-15:00

2、认购手续

(1)开立上海证券交易所的A股账户或基金账户,办理指定交易或转指定交易在本基金的发售代理机构。

(2)在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3)投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托,可多次申报,申报一经确认,认购资金即被冻结。

五、网下现金认购的程序

1、直销机构

(1)本公司接受单笔认购份额在10万份以上(含10万份)以上的个人、机构投资者的网下现金认购。

(2)业务办理时间:2010年10月25日至2010年11月12日的9:00-16:00(周六、周日不受理)。

(3)认购手续

投资者须先开立上海证券交易所的A股账户或基金账户,然后到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

① 个人投资者提供有效身份证件(身份证、军官证、士兵证、中国护照、户口簿等)原件及复印件;

② 机构投资者提供机构营业执照复印件;事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件;业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书,印鉴卡一式三份;

③ 上海证券交易所A股股东代码卡或证券投资基金账户代码卡,个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户时登记的证件一致;

④ 个人投资者提供指定银行账户的证明原件及复印件,机构投资者提供指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件(或指定银行出具的开户证明)。个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的有效身份证件与其开立该指定银行账户时登记的证件一致;

⑤ 投资者填写认购委托单,机构投资者还须加盖单位公章;

注:"指定银行账户"是指:在本直销中心通过网下现金认购本基金的投资者需指定一银行账户作为若认购申请确认失败后认购资金的回款账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。账户证明是指银行存折、借记卡等。

(4)开户后,在办理认购手续前,应将足额资金通过银行系统汇入本公司指定的下列银行账户:

① 中国工商银行账户
账户名称:华安基金管理有限公司申购专户
账号:1001190729013310952
开户银行:中国工商银行上海分行第二营业部

② 中国建设银行账户
账户名称:华安基金管理有限公司申购专户
账号:31001520313056001181
开户银行:中国建设银行上海市浦东分行

③ 交通银行账户
账户名称:华安基金管理有限公司申购专户
账号:310066771018000423968
开户银行:交通银行上海陆家嘴支行

④ 中国工商银行北京账户
账户名称:华安基金管理有限公司北京分公司
账号:0200250129200025850
开户银行:中国工商银行北京复兴门支行

(5)汇款时,投资者必须注意以下事项:

① 投资者应在"汇款人"栏中填写其开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户时登记的名称;

② 投资者汇款时,可提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息,包括在用途栏内注明"用于认购上证龙头ETF";

③ 为了确保投资者资金及时准确的入账,建议投资者将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至华安直销中心并电话确认。华安直销中心联系电话:(021)38969933;传真:(021)33626833。

2、发售代理机构

(1)业务办理时间:2010年10月25日至2010年11月12日上午9:30-11:30和下午13:00-15:00(周六、周日不营业),具体时间以各发售代理机构的规定为准。

(2)认购手续

① 开立上海证券交易所的A股账户或基金账户,办理指定交易或转指定交易。

② 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

③ 投资者填写认购委托单,同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认,认购资金即被冻结。

六、网下股票认购的程序

1、直销机构

(1)业务办理时间:2010年11月10日至2010年11月12日的9:00-16:00。

(2)认购手续

投资者须先开立上海证券交易所的A股账户或基金账户,然后到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

① 个人投资者提供有效身份证件(身份证、军官证、士兵证、中国护照、户口簿等)原件及复印件;

② 机构投资者提供机构营业执照复印件;事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件;业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书,印鉴卡一式三份;

③ 上海证券交易所A股股东代码卡,个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户时登记的证件一致;

④ 个人投资者提供指定银行账户的证明原件及复印件,机构投资者提供指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件(或指定银行出具的开户证明)。个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的有效身份证件与其开立该指定银行账户时登记的证件一致;

⑤ 在A股账户中具备足够的符合要求的上证龙头企业指数成份股和已公告的备选成份股中未限制认购规模的个股。

⑥ 投资者填写认购委托单。申报一经确认,认购股票即被冻结。如登记结算机构办理股票冻结业务时,投资者A股账户中的股票余额不足,则基金管理人有权将投资者的该笔股票认购申请部分或全部确认失败。

注:"指定银行账户"是指:在本公司直销网点通过网下股票认购本基金的投资者需指定一银行账户作为若认购申请确认失败后已缴纳的认购费用的回款账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。账户证明是指银行存折、借记卡等。

2、发售代理机构

(1)业务办理时间:2010年11月10日至2010年11月12日上午9:30-11:30和下午13:00-15:00。具体时间以各发售代理机构的规定为准。

(2)认购手续

① 开立上海证券交易所A股账户,办理指定交易或转指定交易。

② 在A股账户中具备足够的符合要求的上证龙头企业指数成份股和已公告的备选成份股。

③ 投资者填写认购委托单。申报一经确认,认购股票即被冻结。

3、特殊情形

(1)已公告的将被调出上证龙头企业指数的成份股不得用于认购本基金。

(2)限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

(3)临时拒绝个股认购:对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

七、清算与交割

有效认购资金自划入基金募集专户起至基金合同生效日止的利息计入基金资产;投资者以股票认购的,认购股票由登记结算机构予以冻结,冻结期间的权益归投资者所有。本基金《基金合同》生效前,基金募集期间募集的资金存入专门账户,任何人不得动用;网下股票认购所募集的股票由登记结算机构予以冻结。本基金权益登记由登记结算机构在发售结束后完成过户登记。

八、基金资产的验资与《基金合同》生效

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额(含募集股票市值)不少于2亿元人民币,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规和招募说明书的规定可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,《基金合同》生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

基金募集期届满,未达到《基金合同》的生效条件,或基金募集期内发生不可抗力使《基金合同》无法生效,则基金募集失败。如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期限届满后30日内返还基金投资者已缴纳的款项,并加计同期银行存款利息;对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票,登记结算机构应予以解冻。

九、本次募集有关当事人或中介机构

(一)基金管理人

名称:华安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
法定代表人:李勍
电话:(021)38969999
传真:(021)58406138
联系人:冯颖
客户服务热线:40088-50099
网址:www.huaan.com.cn
电子邮件:service@huaan.com.cn

(二)基金托管人

名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系电话:(010)66105799
联系人:蒋松云
网址:www.icbc.com.cn

(三)基金份额发售机构

1、发售协调人和上市推荐人

名称: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:芮敏棋
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

2、网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

(1)华安基金管理有限公司上海业务总部
地址:上海市浦东新区浦东南路360号新上海国际大厦37楼
电话:(021)38969960
传真:(021)68863223
联系人:张剑云

(2)华安基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室
电话:(010)57635999
传真:(010)66214061
联系人:刘彦竹

(3)华安基金管理有限公司广州分公司
地址:广州市天河区天河路228号广晟大厦2202室
电话:(020)38350158
传真:(020)38350259
联系人:王新光

(4)华安基金管理有限公司西安分公司
地址:西安市碑林区南关正街88号长安国际中心A座706室
电话:(029)87651811
传真:(029)87651820
联系人:满黎

(5)华安基金管理有限公司成都分公司
地址:成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L
电话:(028)85268583
传真:(028)85268827
联系人:强智勇

(6)华安基金管理有限公司沈阳分公司
地址:沈阳市沈河区北站路59号财富中心E座2103室
电话:(024)22522733
传真:(024)22521633
联系人:曹瀚

3、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构(排名不分先后)

(1)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
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818
传真:(021)62583439
客户服务电话:800-820-6888
网址:www.gtja.com

(2)中信建投证券有限责任公司
注册地址: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)65183888
传真:(010)65182261
客户服务电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com

(3)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833转2181
传真:(0755)82133302

(下转D16版)