华泰柏瑞基金管理有限公司上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"或"华泰柏瑞上证中小盘ETF"）根据2010年11月3日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于核准上证中小盘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】1535号）和2010年12月9日《关于上证中小盘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】748号）的核准，进行募集。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称"基金管理人"或"管理人"或"本公司"）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、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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券期货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，充分考虑自身的风险承受能力，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、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。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

一 绪言

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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《上证中小盘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》、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。

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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：

基金或本基金：	指上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议：	指《上证中小盘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；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时做出的修订；
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"，简称"ETF"；
联接基金：	指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，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；
华泰柏瑞上证中小盘ETF：	指华泰柏瑞基金管理有限公司管理的上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金；
华泰柏瑞上证中小盘ETF联接：	指华泰柏瑞基金管理有限公司管理的华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金；
上证所《业务细则》：	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》；
《业务规则》：	指《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》；
注册登记业务：	指《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、托管和结算业务；
指定交易：	指《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的"指定交易"；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指华泰柏瑞基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
注册登记机构：	指中国证券登记结算有限责任公司；
投资者：	指个人投资者、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证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《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可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人：	指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第十二部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
发售代理机构：	指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；
发售协调人：	指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：	指符合《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：	指发售代理机构和申购赎回代理券商；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销及基金代销机构的代销网点；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
标的指数：	指中证指数有限公司编制并发布的上证中小盘指数及其未来可能发生的变更；
完全复制法：	指一种跟踪指数的方法。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构建指数组合，达到复制指数的目的；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所的正常交易日；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请以申购对价向基金管理人购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额以取得赎回对价的行为；
基金份额折算：	指建仓结束后，基金管理人根据本基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为；
申购、赎回清单：	指由基金管理人编制的用以公告的申购对价、赎回对价等信息的文件；
最小申购、赎回单位：	指申购份额、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：	指标的指数所包含的全部或部分证券；
申购对价：	指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：	指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
现金替代：	指申购、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：	指最小申购、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；
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；
指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
基金财产估值：	指计算、评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入；
收益评价日：	指基金管理人计算累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之日；
基金累计报酬率：	指收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去100%；
标的指数同期累计报酬率：	指收益评价日标的指数收盘值与基金份额折算日标的指数收盘值之比减去100%。
指定媒体：	指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或其它媒体；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

三 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层

法定代表人：齐亮

成立日期：2004年11月18日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字［2004］178号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：沈炜

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长，2001年至2004年任华泰证券股份有限公司副总裁。

Ravi Mehrotra先生：董事，硕士，曾在印度的美国银行、领先证券和富兰克林邓普顿资产管理公司任职，2006年加入美国国际集团，目前任柏瑞投资亚洲有限公司（原美国国际集团（亚洲）投资有限公司）执行董事。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

陈国杰先生：董事，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司（现为柏瑞投资亚洲有限公司）执行董事等职。

朱小平先生，独立董事，硕士，1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生，独立董事，1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生，独立董事，博士，1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999年任长城证券有限责任公司投资银行部副总经理，1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

2、监事会成员

常小抒先生：监事长，学士，2004-2007年任美国国际集团全球投资公司资深财务分析师，2007年至今任柏瑞投资亚洲有限公司（原美国国际集团亚洲投资公司）亚洲区首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1993-1995年任上海大陆期货公司交易部、市场部经理，1995-1996年任江苏东华期货公司上海业务部副总经理，1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、华泰柏瑞上证红利ETF基金经理助理、华泰柏瑞上证红利ETF基金经理。

3、总经理及其他高级管理人员

陈国杰先生：总经理，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司（现为柏瑞投资亚洲有限公司）执行董事等职，并自华泰柏瑞基金管理有限公司成立至今任公司董事。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

刘宏友先生：副总经理，硕士，1992-2004年历任华泰证券股份有限公司部门副总经理、总经理，2004-2006年任华夏基金管理有限公司上海营销总部副总经理。2006-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

张娅女士：6年证券（基金）从业经验，美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士，MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作，2004年加入本公司，从事投资研究和金融工程工作。2006年11月开始至今担任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利ETF基金的基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部总监。

柳军先生：10年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士。2000年至2001年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001年至2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利ETF基金的基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理陈国杰先生；

成员：副总经理王溯舸先生；研究总监张诤女士；投资部总监汪晖先生；海外投资部总监李文杰先生；研究部副总监郑静女士。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，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、编制季度、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、赎回对价；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回对价；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法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、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏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）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（9）贬损同行，以抬高自己；

（10）以不正当手段谋求业务发展；

（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏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）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）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。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

（6）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、内部控制的主要内容

（1）控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

（5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：王圣明

电话：（010）66594911

传真：（010）66594791

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后行使中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务大众、振兴民族金融业为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行成为国家外汇外贸专业银行，为国家对外经贸发展和国内经济建设作出了重大贡献。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行开始股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为首家在内地和香港发行上市的中国商业银行。中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港、澳门及29个国家为客户提供全面的金融服务。主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资附属机构中银国际控股集团开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险有限公司及其附属和联营公司经营保险业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过全资子公司中银集团投资有限公司从事直接投资和投资管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。按核心资本计算，2009年中国银行在英国《银行家》杂志"世界1000家大银行"排名中列第十一位。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神，稳健经营的理念，客户至上的宗旨和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象，中国银行被The Banker（英国《银行家》）评为"2009年中国年度银行"，被Euromoney（《欧洲货币》）评为"2009年度最佳私人银行"，被Global Finance（《环球金融》）评为"2009年度中国最佳外汇交易银行"，被Trade Finance（《贸易金融》）评选为"中国本土最佳贸易服务银行"，被The Asset（《财资》）评为"中国最佳贸易融资银行"，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为"中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行、中国最佳外汇交易银行"。面对新的历史机遇，中国银行将坚持可持续发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）主要人员情况

肖钢先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自1996年10月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月，1981年毕业于湖南财经学院，1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自2004年8月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000年11月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于1980年11月至2000年11月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978年毕业于南京信息工程大学。2002年6月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生，自2007年11月27日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自2005年9月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983年7月至2005年9月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于1962年11月，获得西南财经大学博士学位。

（三）基金托管部门的情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念；根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人。另外，中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行设有托管业务团队。

（四）证券投资基金托管情况

截止2010年3月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合（二期）、国泰金鹏蓝筹混合、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、金鹰成份优选股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、万家180指数、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、宝盈核心优势混合、国富成长动力股票、泰信蓝筹精选股票、华泰柏瑞货币、国泰区位优势股票、招商行业领先股票、东方核心动力股票、金鹰行业优势股票、泰信债券增强收益、万家稳健增利债券、嘉实回报混合、海富通中证100指数（LOF）、易方达深证100ETF联接、摩根士丹利华鑫强收益债券型、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）等81只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（五）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、发售协调人

1）主协调人：华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号

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

联系人：樊昊

电话：（025）84457777

传真：（025）84579763

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

2、网下现金发售直销机构：

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

法定代表人：齐亮

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：沈炜

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：www.huatai-pb.com

3、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构：

1）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

联系人：李洋

电话：（010）66568587

传真：（010）66568536

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

2）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场18、19、36、38、41、42楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：（020）87555888

传真：（020）87555305

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

3）光大证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：刘晨

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

客服电话：400-888-8788，10108998

公司网址：www.ebscn.com

4）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

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

公司网址：www.qlzq.com.cn

5）山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

电话：（0351）8686703

传真：（0351）8686619

客服电话：400-666-1618

公司网址：www.i618.com.cn

6）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：（021）88157761

传真：（021）88157761

客服电话：（0519）88166222、（021）52574550、（0379）64902266、免费服务热线：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

7）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

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：常喆

联系人：黄静

电话：（010）84183389

传真：（010）84183311

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

8）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：（010）88085858

传真：（010）88085195

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

9）东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区翠园路181号商旅大厦

办公地址：江苏省苏州市工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

客服电话：（0512）33396288

公司网址：www.dwjq.com.cn

10）德邦证券有限责任公司

注册地址：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：姚文平

联系人：罗芳

电话：（021）68761616

传真：（021）68767981

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

11）中航证券有限公司

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

联系人：余雅娜

电话：（0791）6768763

传真：（0791）6789414

客服电话：400-886-6567

公司网址：www.avicsec.com

12）湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

电话：（021）68634518

传真：（021）68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

13）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：（010）63081000

传真：（010）63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

14）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人：李晓安

（下转D6版）

华泰柏瑞基金管理有限公司上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
发售主协调人：华泰证券股份有限公司

重要提示

1、上证中小盘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2010年11月3日《关于核准上证中小盘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】1535号）。

2、本基金是交易型、开放式、指数证券投资基金。

基金简称：中小ETF。认购代码为510223。上市代码为510220。

3、本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称"本公司"），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称"中国银行"），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、本基金募集对象为中华人民共和国境内的自然人、法人及其他组织（法律法规禁止购买证券投资基金者除外），合格境外机构投资人，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人。

5、本基金自2010年12月20日至2011年1月18日进行发售。本基金的投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。其中，网下现金发售的日期为2010年12月20日至2011年1月18日，网上现金发售和网下股票发售的日期均为2011年1月14日至2011年1月18日。

6、本基金的网上现金发售通过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。

8、本基金的网下现金发售和网下股票发售代理机构为华泰证券股份有限公司（以下简称"华泰证券"）等。

9、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。

10、本基金的认购费用或认购佣金不超过认购份额的1%。

11、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。投资人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；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份）。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股的部分须为100股的整数倍。投资人可以多次认购，累计认购不设上限。

12、网上现金认购申请提交后，投资人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不得撤销。

13、销售网点（指代销网点和或直销网点）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。投资人可以在基金合同生效后通过原认购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。投资人欲了解"上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金"的详细情况，请详细阅读2010年12月17日、12月20日、12月21日分别刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15、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.huatai-pb.com）、基金托管人中国银行网站（www.boc.cn）以及各销售代理机构网站。

16、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。

17、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。

18、本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

19、投资人如有任何问题，可拨打本公司客服电话（021-38784638；400-888-0001）、基金托管人中国银行客服电话（95566）以及各销售代理机构客服电话。

20、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

21、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的一级交易商名单，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。基金上市后，指定交易未在一级交易商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人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一级交易商。

22、风险提示

证券投资基金（以下简称"基金"）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：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、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。本基金是交易型指数基金，风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金。本基金资产配置中股票等权益类资产投资占基金净资产的比例范围为95-100%，属于高风险、高收益的开放式基金品种。

投资者应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解本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、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本基金由基金管理人依照《基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在做出投资决策后，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。

本基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

一、本次发售基本情况

（一）基金名称

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（网下现金、网下股票、网上现金认购代码均为：510223；上市代码为510220；简称：中小ETF）。

（二）基金类别：股票型指数证券投资基金。

（三）存续期限：不定期。

（四）份额初始面值：每份基金份额初始面值为1.00元人民币。

（五）发售对象

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。

（六）基金份额发售机构

1、发售协调人

1）主协调人：华泰证券股份有限公司

华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号

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

联系人：樊昊

电话：（025）84457777

传真：（025）84579763

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

2、网下现金发售直销机构：华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

法定代表人：齐亮

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：沈炜

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：www.huatai-pb.com

3、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构：中国银河证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中国国际金融有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、中航证券有限公司、广发证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司等。

4、网上现金发售代理机构：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。

5、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

（七）发售时间安排与基金合同生效

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12月20日至2011年1月18日进行发售。其中，网下现金发售的日期为2010年12月20日至2011年1月18日，网上现金发售和网下股票发售的日期均为2011年1月14日至2011年1月18日。发售期期满后若达到基金备案条件（即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，且基金份额持有人的人数不少于200人，下同），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；若未达到基金备案条件，则本基金将在3个月的募集期内继续发售。

募集期届满时，若本基金达到基金合同规定的备案条件，基金管理人按照有关规定进行验资并办理向中国证监会的备案手续；若募集期届满，本基金仍未达到备案条件，本基金基金合同不能生效，在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。同时将已冻结的股票解冻。

（八）认购费用

1、认购费用由投资人承担，不超过认购份额的1.0%，认购费率如下表所示：

表11.1.1 认购费率

认购份额 M（份）	认购费率
M < 50万	1.0 %
50万≤M < 100万	0.5 %
M≥100万	1000元/次

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。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

2、认购费用计算公式和收取方式

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、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

其中：

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：某投资人到本公司直销网点认购100,000份基金份额，则需准备的资金金额计算如下：

认购费用=100,000×1%=1,000元

认购金额=100,000×（1+1%）=101,000元

即投资人需准备101,000元资金，方可认购到100,000份本基金基金份额。

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人，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人认购确认时收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例二：某投资人到某发售代理机构网点认购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

即投资人需准备1,010元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

3）通过发售代理机构进行网下股票认购的投资人，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。

认购份额和认购佣金的计算公式为：

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：

投资者的认购份额=（第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00

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：某投资人持有上证中小盘指数成份股中股票A和股票B各10,000股和20,000股，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

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

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：

投资者的认购份额=（第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00

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：续例三，假设该投资人选择以基金份额的方式交纳认购佣金，则投资人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、发售方式及相关规定

（一）本基金在发售期内面向个人和机构投资人同时发售。

（二）本公司直销网点接受单笔认购份额在5万份以上（含5万份）的投资人的网下现金认购本基金的申请。

（三）发售代理机构的代销网点接受投资人（不分机构和个人）单笔认购份额为1,000份或其整数倍的网上现金认购、网下现金认购本基金的申请；以及单只股票股数为1,000股以上、超过部分为100股的整数倍的网下股票认购本基金的申请。

（四）发售期内投资人可以重复认购本基金，累计认购不设上限。

三、投资人开户

（一）本基金的投资人的开户

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所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）上海证券交易所的证券账户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。

四、本基金的认购程序

（一）网上现金认购的程序

1、业务办理时间：2011年1月14日至2011年1月18日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00。

2、认购手续：

1）开立上海证券交易所A股账户或基金账户，办理指定交易在发售代理机构。利用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3）投资人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。

（二）网下现金认购的程序

1、直销机构

1）本公司接受认购份额在5万份（含5万份）以上的个人、机构投资人的认购。

2）业务办理时间：2010年12月20日至2011年1月18日的9:30—17:00（周六、周日不营业）。

3）到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

（1）个人投资人提供身份证件原件及复印件；机构投资人提供机构营业执照复印件、业务经办人有效身份证件原件及复印件、基金业务授权委托书；

（2）上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡；

（3）盖银行受理章的汇款凭证回单复印件。

4）在认购期内，将足额认购资金汇入本公司指定的任一直销资金专户：

（1）中国银行账户：

户名：华泰柏瑞基金管理有限公司

账号：044654-8180-12941728025001

开户银行名称：中行上海市中银大厦支行

（2）中国工商银行账户：

户名：华泰柏瑞基金管理有限公司

账号：1001164829013352678

开户银行名称：工行上海分行金茂大厦支行

（3）中国建设银行账户：

户名：华泰柏瑞基金管理有限公司

账号：31001520313050005668

开户银行名称：建行上海浦东分行

（4）招商银行账户：

户名：华泰柏瑞基金管理有限公司

账号：216089281810001

开户银行名称：招商银行上海市分行营业部

（5）中国农业银行账户：

户名：华泰柏瑞基金管理有限公司

账号：03-340300040014026

开户银行名称：农行上海市浦东分行营业部

5）注意事项：

（1）若投资人的认购资金在认购申请当日16:30之前未到本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准；

（2）投资人汇款时，可提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息，包括汇款人和用途栏内容；

（3）为了确保客户资金及时准确的入账，建议投资人将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至本公司直销中心。传真号码：021-50103016。

2、发售代理机构

1）业务办理时间：2010年12月20日至2011年1月18日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00（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）投资人填写认购委托单，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。

（三）网下股票认购的程序

1、业务办理时间：2011年1月14日至2011年1月18日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00。具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2、认购手续：

1）如投资人以上证中小盘指数成份股中的上海证券交易所上市股票认购本基金，需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中小盘指数成份股和已公告的备选成份股。

3）投资人填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

五、清算与交割

（一）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，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。募集股票在冻结期间的权益归投资人所有。

（二）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结构予以冻结。

（三）本基金权益登记由登记结算结构在发售结束后完成过户登记。

六、基金的验资与基金合同生效

基金募集期限届满，本基金具备基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起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。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

募集期届满时，若本基金达到基金合同规定的备案条件，基金管理人按照有关规定进行验资并办理向中国证监会的备案手续；若募集期届满，本基金仍未达到备案条件，本基金基金合同不能生效，在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。同时将已冻结的股票解冻。

七、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

法定代表人：齐亮

电话：021-38601777

传真：021-50103016

联系人：陈培

（二）基金托管人

（下转D6版）