上证 180 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2011 年第 1 号)

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇一一年五月

重要提示

上证 180 交易型开放式证券投资基金 (以下简称 "本基金")经中国证监会 2006 年 2 月 22 日证监基金字[2006]30 号文批准募集。本基金基金合同自 2006 年 4 月 13 日正式生效。

基金管理人保证本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。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书中涉及与托管人相关的基金信息已经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 4 月 13 日,有关财务数据截止日为 2011 年 3 月 31 日 (未经审计),净值表现截止日为 2010 年 12 月 31 日 (已经审计)。

一、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、注册地址:上海浦东新区浦东南路 360 号,新上海国际大厦 38 楼

3、设立日期:1998 年 6 月 4 日

4、法定代表人:李勍

5、办公地址:上海浦东新区浦东南路 360 号,新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

6、联系电话:021-38969999

7、联系人:冯颖

(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
上海电气(集团)总公司	20%
上海国际信托有限公司	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。历任全国政协委员,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),现任华安基金管理有限公司监事会主席。

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,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。

章卫进先生,大专学历,会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科员、外经处会计主管,英国 SONOFEC 公司 (长驻伦敦)业务经理,上海有色金属总公司房产公司财务部经理、办公室主任,上海工业投资 (集团)有限公司财务部业务主管、副经理,现任上海工业投资 (集团)有限公司财务部经理。

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,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,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,24 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

现任基金经理:

许之彦先生:理学博士,7 年证券、基金从业经验,CQF (国际数量金融工程师)。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,曾任研究发展部数量策略分析师,2008 年 4 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理,2009 年 9 月起同时担任华安上证 180ETF 及本基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金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风险管理与金融工程部高级金融工程师,2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任华安中国 A 股增强指数基金的基金经理助理,2010 年 6 月起同时担任本基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任华安 A 股增强指数基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

历任基金经理:

刘光华先生,2006 年 4 月 13 日至 2007 年 3 月 14 日担任本基金基金经理。

卢赤斌先生,2006 年 4 月 13 日至 2009 年 10 月 20 日担任本基金基金经理。

刘璎女士,2007 年 3 月 14 日至 2010 年 6 月 26 日担任本基金基金经理。

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
尚志民先生,首席投资官
顾建国先生,财富管理中心总经理
翁启森先生,全球投资部总经理、基金经理
陈俏宇女士,基金经理
汪光成先生,基金经理
杨明先生,首席宏观策略师

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司 (简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004 年 09 月 17 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12 号
联系人:尹东
联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身 "中国人民建设银行"于 1954 年成立,1996 年易名为 "中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行 (股票代码:939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日,中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486 股 (包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2010 年 12 月 31 日,中国建设银行实现净利润 1350.31 亿元,较上年同期增长 26.39%。手续费及佣金净收入 661.32 亿元,较上年同期增长 37.61%。年化平均资产回报率为 1.32%,年化加权平均净资产收益率为 22.61%;净利息收益率为 2.49%。信贷资产质量继续稳定向好,不良贷款较上年末实现 "双降",拨备覆盖率大幅提高至 221.14%。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科设有代表处,设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行 9 家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际,建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机 (ATM)39,874 台,拥有员工 313,867 人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010 年共获得 100 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的 "全球商业银行品牌十强"列第二位,在 "全球银行品牌 500 强"列第 13 位,并被评委 2010 年中国最佳银行;在美国《福布斯》杂志公布的 "Interbrand2010 年度最佳中国品牌价值排行榜"列第三位,银行业第一位;被《亚洲金融》杂志评为 2010 年度 "中国最佳银行";连续三年被香港《资本》杂志评为 "中国杰出零售银行";被中国红十字会总会授予 "中国红十字杰出奉献奖章"。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队,现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理 (主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持 "以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 3 月 31 日,中国建设银行已托管 189 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010 年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度 "国内最佳托管银行" (Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为 "中国最佳次托管银行"。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、申购赎回代办证券公司 (简称:一级交易商):

(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:万建华
电话:(021)38676161
传真:(021)38670161
客户服务电话:95521,400-8888-666
网址:www.gtja.com

(2)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路 171 号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sw2000.com.cn

(3)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:(021)23219000
传真:(021)63410456
联系人:金芸
客服电话:021-962503 或 400-8888-001
网址:www.htsec.com

(4)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:0755-82943511
传真:0755-82943237
联系人:黄健
客服电话:4008888111 或 0755-26951111
网址:www.newone.com.cn

(5)长江证券股份有限公司
注册地址: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:4008888999
传真:027-85481900
联系人:李良
网址:www.95579.com.cn

(6)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
电话:(021)68816000-1876
传真:(021)68815009
客户服务电话: 10108998
网站:www.ebscn.com

(7)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 36 楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87555305
联系人:肖中梅
网址:www.gf.com.cn

(8)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
法定代表人:陈有安 @ 电话:010-66568047
传真:010-66568536
联系人:郭京华
客服电话:800-820-1868
网址:www.chinastock.com.cn

(9)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路 111 号
办公地址:上海市临平北路 19 号
法定代表人:蒋元真
电话:021-62470304
传真:021-65213164
联系人:王伟力
客服电话:800-6200-071
网址:www.962518.com

(10)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层
办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层
法定代表人:王东明
电话:(010)84864818
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
客服电话:010-84588266
网址:www.ecitic.com

(11)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区香港东路 316 号
办公地址:青岛市东海西路 28 号
法定代表人:史洁民
电话:(0532)85022026
传真:(0532)85022026
联系人:丁韶燕
客户服务电话:(0532)96577
网址:www.zxwt.com.cn

(12)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
联系人:魏明
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(13)中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层
办公地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人:李剑阁
电话:(010)65051166
传真:(010)65051156
客户服务电话:(010)65051166
网址:www.cicc.com.cn

(14)南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市大钟亭 8 号
办公地址:江苏省南京市大钟亭 8 号
法定代表人:张华东
电话:025-83367888-4201
传真:025-83320066
联系人:胥春阳
客服电话:400-828-5888
网址:www.njzq.com.cn

(15)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
法定代表人:杨宇翔
电话:4008866338
传真:(0755)82400862
联系人:余江
客户服务电话:4008816168
网址:www.pingan.com

(16)中原证券股份有限公司
注册地址:许昌市南关大街 38 号
办公地址:郑州市经三路 15 号广汇国贸 11 楼
法定代表人:石保上
电话:(0371)65585670
传真:(0371)65585670
客户服务电话:(0371)967218
网址:www.ccnew.com

(17)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
办公地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层
法定代表人:王益民
联系人:盛云
电话:(021)63325888
传真:(021)63326173
客户服务电话:(021)962506、400-8888-506
网址:www.dfzq.com.cn

(18)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 楼
办公地址:上海市东方路 989 号中达广场 17 楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021)50586660-8636
传真:(021)50586660-8611
联系人:龙涛
客服电话:(021)52574550
网址:www.longone.com.cn

(19)华泰证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:樊昊
客户服务电话:(025)95597
网址:www.htsc.com.cn

(20)国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 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:0755-82133952
联系人:林建闽
客服电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(21)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:张雅锋
联系人:覃清芳
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
客户服务电话:全国:400-8888-100 广西:96100
网址:www.ghzq.com.cn

(22)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
法定代表人:王军
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
联系人:罗芳
客户服务中心电话:(021)68761616-8125
网址:www.tebon.com.cn

(23)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:范雪岭
客服电话:95513
网址:www.lhzq.com

(24)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7-8 层
办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7-8 层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87278701
传真:0591-87383610
联系人:张腾
网址:www.gfhfzq.com.cn

(25)信泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市长江路 88 号
法定代表人:钱凯法
电话:025-84784782
传真:025-84784741
联系人:舒萌菲
网址:www.thope.com

(26)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐建设路 2 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
联系电话:(010)88085338
传真号码:(010)62294470
客户服务电话:(0991)96562、(010)62294600
网址:www.ehongyuan.com

(27)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 128 号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
传真号码:0531-81283906
网址:www.qlzq.com.cn

(28)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
客户服务电话:(021)68419974
网址:www.xyzq.com.cn

(29)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至第 21 层
办公地址:深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层
法定代表人:杨明辉
电话:(0755)82026521
传真:(0755)82056539
客户服务电话:4006-008-008
网址:www.cjis.cn

(30)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
法定代表人:凤良志
电话:(0551)2207114
客户服务电话:4008-888-777
网址:www.gyzq.com.cn

(31)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层
办公地址:北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层
法定代表人:王少华
电话:(010)84183389
传真:(010)64482090
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com

(32)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)3577930
传真:(0871)3578827
客户服务电话:(0871)3577930
网址:www.hongtazq.com

(33)中信金通证券有限责任公司
注册地址: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:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 4、19、20 层
法定代表人:刘军
联系电话:(0571)85783715
传真号码:(0571)85783771
客户服务电话:(0571)96598
网址:www.bigsun.com.cn

(34)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
办公地点: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
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(35)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一大街 29 号
法定代表人:张志军
电话:(022)28451650
客户服务电话:400-651-5988
网址:www.ewww.com.cn

(36)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
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
客户服务电话:(0791)6768763
网址:www.scstock.com

(37)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
网址:www.essences.com.cn

(38)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层
办公地址:深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人:魏云鹏
电话:(0755)83516094
传真:(0755)83516199
客户服务电话:(0755)82288968
公司网站:www.cc168.com.cn

(39)西藏同信证券有限责任公司
注册地址:西藏拉萨北京中路 101 号
办公地址:上海市闸北区永和路 118 弄东方环球企业园 24 号
法定代表人:贾绍君
电话:021-36533016
传真:021-36533017
客服热线:400-881-1177
网址:http://www.xzsec.com/

(40)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
法定代表人:吴泳良
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82940511
客户服务电话:(0755)82943750
网址:www.zszq.com.cn

(41)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
法定代表人:吴志明
电话:(020)87322668
传真:(020)87325036
客户服务电话:961303
网址:www.gzs.com.cn

(42)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层
办公地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层
法定代表人:张建军
电话:020-37865070
传真:020-37865030
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

(43)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:游锦辉
电话:(0769)22119351
传真:(0769)22119423
客户服务电话:961130
网址:www.dgzq.com.cn

(44)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
办公地址:北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
法定代表人: 张志刚
电话:(010)88626476
传真:(010)88656290
客户服务电话:400-800-8899
网址: www.cindasc.com

(45)东吴证券有限责任公司
注册地址:苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17-21 层
办公地址:苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17-21 层
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客户服务电话:0512-33396288
网址: www.dwzq.com.cn

(46)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路 1138 号
法定代表人:矫正中
电话:(0431)85096709
传真:(0431)85096795
客户服务电话:(0431)96688
网址:www.nesc.cn

(47)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
办公地址:重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢
法定代表人:王珠林
电话:023-63786488
传真:023-63786001
客户服务电话:40080-96096
网址:www.swsc.com.cn

(48)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市青羊区东城根上街 95 号
办公地址:成都市青羊区东城根上街 95 号 16 楼
法定代表人:雷波
电话:(028)86690125
传真: (028)86690126
客户服务电话:(028)95105111
网址:www.china598.com.cn

(49)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侨国际大厦 22-24 层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层
法定代表人:雷杰
电话:(0731)85832343
传真:(0731)85832342
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

(50)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
电话:(0351)8686703
传真:(0351)8686619
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

(51)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层
办公地址:上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层
法定代表人:陈林
电话:(021)50122107
传真:(021)50122078
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com

2、二级市场交易代办证券公司

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,选择其他符合要求的机构代理发售本基金,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:中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层
法定代表人:陈耀先
联系人:刘永卫
联系电话:021-58872625
传真:021-68870311

(三)律师事务所和经办律师

名称:通力律师事务所
注册地址: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:秦悦民
经办律师:秦悦民、王利民

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:金毅
经办注册会计师:马颖旎、金毅

四、基金的名称

本基金名称:上证 180 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,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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,投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%,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,基金管理人将在十个交易日内进行调整。同时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他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

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。但因特殊情况 (例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。

1、决策依据

(1)法律法规和基金合同的有关规定;

(2)标的指数编制、调整等相关规定,以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略。

2、决策程序

研究开发、投资决策、组合构建、交易、评估、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)研究开发:金融工程小组通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析,进行基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作,定期撰写研究报告,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产品开发小组所开发的指数模拟策略,以及金融工程小组提供的研究报告,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,结合研究报告,基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。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:集中交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:金融工程小组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、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,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程序做出调整,并在基金更新的招募说明书及其更新中公告。

在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,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,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。若本基金标的指数发生变更,则本基金业绩比较基准随之发生变化。

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,采用完全复制策略,跟踪上证 180 指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于 2011 年 4 月 20 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。

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 3 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	6,029,919,781.60	99.20
	其中:股票	6,029,919,781.60	99.20
2	固定收益投资	1,630,388.40	0.03
	其中:债券	1,630,388.40	0.03
	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	44,210,586.79	0.73
6	其他资产	2,576,543.04	0.04
7	合计	6,078,337,299.83	100.00

注:此处股票投资含可退替代款估值增值-30,324.00 元。

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极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股票投资。

2.2 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	31,826,663.18	0.52
B	采掘业	868,426,280.34	14.30
C	制造业	1,546,006,471.63	25.45
C0	食品、饮料	195,869,617.10	3.22
C1	纺织、服装、皮毛	41,920,916.00	0.69
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	97,787,544.43	1.61
C5	电子	32,622,605.28	0.54
C6	金属、非金属	435,263,190.89	7.17
C7	机械、设备、仪表	584,194,440.46	9.62
C8	医药、生物制品	158,348,157.47	2.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	159,005,998.07	2.62
E	建筑业	225,258,507.27	3.71
F	交通运输、仓储业	279,959,356.51	4.61
G	信息技术业	165,504,819.85	2.72
H	批发和零售贸易	111,027,108.95	1.83
I	金融、保险业	2,161,349,173.62	35.58
J	房地产业	318,994,822.69	5.25
K	社会服务业	30,930,794.65	0.51
L	传播与文化产业	13,652,947.32	0.22
M	综合类	118,007,161.52	1.94
	合计	6,029,950,105.60	99.27

3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资前五名与指数投资前十名股票投资明细

3.1 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	19,726,533	277,946,849.97	4.58
2	601318	中国平安	5,106,017	252,543,600.82	4.16
3	600016	民生银行	35,145,523	196,463,473.57	3.23
4	601166	兴业银行	6,505,127	186,762,196.17	3.07
5	601328	交通银行	31,663,346	180,164,438.74	2.97
6	600000	浦发银行	12,790,378	174,204,948.36	2.87
7	600030	中信证券	10,935,507	152,769,032.79	2.52
8	601088	中国神华	5,114,717	148,787,117.53	2.45
9	601398	工商银行	24,995,147	111,728,307.09	1.84
10	600519	贵州茅台	607,890	109,329,016.50	1.80

3.2 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股票投资。

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,630,388.40	0.03
7	其他	-	-
8	合计	1,630,388.40	0.03

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110016	川投转债	13,740	1,630,388.40	0.03

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

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

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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,392,361.54
3	应收股利	1,175,610.13
4	应收利息	8,571.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,576,543.04

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票未出现流通受限情况。

8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票未出现流通受限情况。

十二、基金的业绩

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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的过往业绩不代表未来表现。

(一)基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

(截至时间 2010 年 12 月 31 日)

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
自 2006-4-13(合同生效日)至 2006-12-31	81.63%	1.48%	87.32%	1.53%	-5.69%	-0.05%
2007-1-1 至 2007-12-31	146.39%	2.25%	151.55%	2.28%	-5.16%	-0.03%
2008-1-1 至 2008-12-31	-64.55%	2.96%	-66.34%	3.07%	1.79%	-0.11%
2009-1-1 至 2009-12-31	87.82%	2.03%	91.77%	2.06%	-3.95%	-0.03%
2010-1-1 至 2010-12-31	-15.45%	1.55%	-16.04%	1.56%	0.59%	-0.01%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

(一)基金运作费用

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,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 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

4、证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金分红手续费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相关合同的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(二)基金销售费用

申购、赎回佣金:

投资人在申购或赎回基金份额时,需按照招募说明书第十节第 (六)款的规定,交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请,费用计算公式为:

申购/赎回佣金=申购/赎回份额×申购、赎回佣金比率

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资人申购、赎回确认时收取,用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

(三)不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。基金标的指数使用费由基金管理人承担。

(四)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了基金管理人的有关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的有关资料。
五、相关服务机构	更新了基金份额发售机构的部分信息。 更新了会计师事务所和经办注册会计师相关信息。
十、基金份额的申购与赎回	更新了"(七)申购、赎回清单的内容与格式"中的申购赎回清单。
十一、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
十二、基金的业绩	更新了基金合同生效以来的投资业绩。
二十四、其他应披露事项	披露了自 2010 年 10 月 13 日至 2011 年 4 月 13 日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一一年五月二十七日