（上接D13版）

4、本基金基金经理

余海燕女士，复旦大学数量经济学硕士，证券从业经历5年。曾在汇丰银行从事信用分析工作。2006年12月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任金融工程分析师，华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理，华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2010年12月至今任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理，投资总监、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

牟旭东先生，国内投资部总经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。

郭鹏飞先生，华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

刘自强先生，华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金经理。

王智慧先生，研究部总经理。

蒋宁女士，华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

（三）基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本系列基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行；

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）内控审计风险管理制度

内控审计风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

内控审计风险管理部负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；协助评价基金财产风险状况；负责公司主要领导离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

四、基金托管人

（一）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

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

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，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，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，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。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，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

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、香港澳门台湾及31个国家和地区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，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

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，诚信为本的传统和严谨细致的作风，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。2010年度，中国银行被被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳贸易融资银行，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

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，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，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截止2011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、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、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、海富通中证100指数（LOF）、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、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、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、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、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、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、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、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、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、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）等107只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，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。

（四）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。

（五）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。

（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

1、 上市推荐人

（1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

服务热线：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

2、 发售协调人

（1）主协调人

1）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：021-54035333

客服电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

2）海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：95553、400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：李笑鸣

公司网址：www.htsec.com

（2）副主协调人

1）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

公司网址：www.ce.ecitic.com

2）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

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.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

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22161789

联系人：刘晨

客户服务热线：10108998、4008888788

公司网址：www.ebscn.com

4）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21层

法定代表人：杨明辉

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

5）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16楼至26楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

国信证券网站：www.guosen.com.cn

6）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州天河北路大都会广场43楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

7）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39—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

8）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

9）华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898、021-38929908

公司网址：http://www.cnhbstock.com

10）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888

传真：021-53519888

网址：www.962518.com

客户服务电话：4008918918、021-962518

3、网下现金发售和网下股票发售直销机构

直销机构：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市世纪大道88号金茂大厦48层

办公地址：上海市世纪大道88号金茂大厦48层

法定代表人：郑安国

直销中心电话：021-38505731

直销中心传真：021-50499663、50499667

网址：www.fsfund.com

4、网下现金和网下股票发售代销机构

（1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路618号

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676161

传真：021-38676161

联系人：芮敏祺

服务热线：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

（2）海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：95553、400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：李笑鸣

公司网址：www.htsec.com

（3）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：021-54035333

客服电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

（4）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

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22161789

联系人：刘晨

客户服务热线：10108998、4008888788

公司网址：www.ebscn.com

（5）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

公司网址：www.ce.ecitic.com

（6）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

（7）华泰证券股份有限公司

住所：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：025-84457777-882

传真：025-84579763

联系人：李金龙、张小波

公司网址： www.htsc.com.cn

客户服务热线：95597

（8）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州天河北路大都会广场43楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

（9）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39—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

（10）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（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

客服电话：95513 公司网站：www.lhzq.com

（11）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

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

（12）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号新源广场2号楼21F-29F

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

客户服务热线：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

（13）中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

客户服务电话：96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

（14）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（15）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

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站：www.cc168.com.cn

（16）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

客服电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

（17）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路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

网址：http://www.dwzq.com.cn

（18）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21层

法定代表人：杨明辉

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

（19）华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898、021-38929908

公司网站：http://www.cnhbstock.com

（20）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥寿春路179号

客户服务热线：4008888777或95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（21）信达证券股份有限公司

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

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

（22）江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

客服电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（23）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

电话：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：4008888123

公司网站：www.xyzq.com.cn

（24）国都证券有限公司

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

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（25）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24层-32层

法定代表人：李工

公司电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

网址：www.hazq.com

客户服务电话：96518、400-80-96518

（26）德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：方加春

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

（27）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号上海证券

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888

传真：021-53519888

网址：www.962518.com

客户服务电话：4008918918、021-962518

（28）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

公司地址：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

全国统一客服热线：400-888-8588

东海证券网站：http://www.longone.com.cn

（29）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

联系电话：0471-4972343

网址：www.cnht.com.cn

（30）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区八卦岭三路平安大厦3楼

办公地址： 深圳市福田区八卦岭三路平安大厦3楼

法定代表人： 叶黎成

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626172

客服电话： 4008816168

公司网址：www.pa18.com

（31）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：戴蕾

联系电话：0791-6768681

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（32）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

联系人：余江

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essences.com.cn

（33）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：许刚

咨询电话：4006208888或各地营业网点咨询电话

传真：021-50372474

（34）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：张佑君

电话：400-8888-108（免长途费）

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

5、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：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万和证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

（二）注册登记机构

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

（三）律师事务所和经办律师

名称：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

联系电话：（86 21）3135 8666

传真： （86 21）3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、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

法定代表人：葛明

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：上海市长乐路989号世纪商贸广场23楼

公司电话：021-22288888（注：公司总机）

公司传真：021-22280000（注：传真总机）

签章会计师：徐艳，蒋燕华

业务联系人：蒋燕华

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

核准文件：中国证监会证监许可［2011］496号

核准日期：2011年4月7日

（一）基金类型：股票型指数基金

（二）基金运作方式：交易型、开放式

（三）标的指数：上证180成长指数

（四）基金存续期间：不定期

（五）基金的面值、认购价格

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元，认购价格为人民币1.00元。

（六）募集方式

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。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

（七）募集对象

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。

（八）募集场所

投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见本基金基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。

（九）募集目标

本基金不设定募集规模上限。

（十）投资者对基金份额的认购

1、认购时间安排

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。

本基金将自2011年7月4日起至2011年7月29日进行发售。本基金的发售方式有三种---网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。网上现金认购的日期为2011年7月27日至2011年7月29日，如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将做出相应调整并及时公告；网下现金认购的日期为2011年7月4日起至2011年7月29日；网下股票认购的日期为2011年7月4日起至2011年7月29日。基金管理人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。

2、认购开户

投资者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）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

1）基金账户只能进行基金的二级市场交易，如投资者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1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（3）使用专用席位的机构投资者则无需办理指定交易。

（十一）认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时可按照下表费率收取认购费用。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，可参照下表费率结构收取一定的佣金。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

认购份额	认购费率
50万份以下	0.8%
50万份（含）-100万份	0.5%
100万份以上（含）	1000元/笔

（十二）网上现金认购

1、认购时间：2011年7月27日至2011年7月29日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00。

2、认购金额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、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收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。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。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金。办理认购手续。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。

5、清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，注册登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十三）网下现金认购

1、认购时间：2011年7月4日起至2011年7月29日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

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

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。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3、认购限额：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；投资者通过基金管理人直销柜台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）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收：T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于T+2日内进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第4个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金管理人预先开设的基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资者所有。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，注册登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4日将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

6、认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十四）网下股票认购

1、认购时间：通过发售代理机构进行网下股票认购的日期为2011年7月4日起至2011年7月29日，通过基金管理人直销进行网下股票认购的日期为2011年7月4日起至2011年7月29日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报。投资者通过基金管理人和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股的部分须为100股的整数倍，用以认购的股票必须是上证180成长指数成份股和已公告的备选成份股。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。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。

4、特殊情形

（1）已公告的将被调出上证180成长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。

5、清算交收

（1）投资者通过发售代理机构办理网下股票认购的，在网下股票认购最后一日，发售代理机构将汇总的股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，网下股票认购最后一日，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。注册登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者账户内相应的股票进行冻结。基金募集期结束，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。注册登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资者申请认购的股票过户到基金的证券账户。

（2）投资者通过基金管理人办理网下股票认购的，注册登记机构根据基金管理人提供的认购数据对投资者账户内相应的股票进行检查并冻结，并将检查冻结股票的情况发回给基金管理人。基金管理人根据注册登记机构的检查冻结投资者股票账户的情况，初步确认各个投资者的有效股票认购数量。基金募集期结束后，基金管理人根据投资者有效股票认购数据计算投资者应以基金份额方式支付的认购费，并从机构投资者的认购份额中扣除。注册登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行机构投资者认购份额的初始登记在机构投资者指定的证券账户上，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资者申请认购的股票过户到基金的证券账户。

6、认购份额的计算公式

（1）i代表投资者提交认购申请的第i只股票，如投资者仅提交了1只股票的申请，则i=1，i≤60。

（2）“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据上海证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整：

①除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

③配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股配股比例）

④送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

⑤除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中，

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

[illegible]

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

②若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据注册登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

（十五）募集资金及利息的处理

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在划入基金募集专户前所产生的利息，归投资者所有；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，认购股票由注册登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。

七、基金合同生效

（一）基金合同备案的条件

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（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于2亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在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，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。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。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

3、对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，注册登记机构应予以解冻。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的交易

（一）基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

1、基金募集金额（含网下股票认购所募集股票市值）不低于2亿元；

2、基金份额持有人不少于1,000人；

3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金份额上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定，包括但不限于：

1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值；

2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍，不足100份的部分可以卖出；

4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元；

5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

（三）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金份额的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备本条第一款规定的上市条件；

2、基金合同终止；

3、基金份额持有人大会决定终止上市；

4、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

（四）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，上海证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值=（申购、赎回清单中必须用现金替代的替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购、赎回清单中的预估现金部分）/最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所

投资者可以在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减申购赎回代理券商的名单，并予以公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），开放时间为上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。投资者应当在开放日办理申购和赎回申请，在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若上海证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

2、申购与赎回的开始时间

本基金在基金上市交易之前可开始办理申购。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过3个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

（三）申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为100万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（四）申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；

3、申购、赎回申请提交后不得撤销；

4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金。

投资者提交赎回申请时，其必须有足够的基金份额余额和现金。

2、申购与赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

3、申购与赎回的清算交收与登记

投资者T日申购、赎回成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人在T+2日办理现金差额的交收。如果注册登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《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》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在指定媒体公告。

（五）申购与赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人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。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

（六）申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、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。

（1）现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，“该证券参考价格”目标确定原则为：

（i）该证券正常交易时，采用最新成交价；

（ii）该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格；

（iii）该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；

（iv）该证券停牌且当日无成交时，采用前收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

[illegible]

（1）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券，或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其T日预计开盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是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，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

T日预估现金部分=T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值-（申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和）

其中，T日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额=T日最小申购、赎回单位的基金资产净值-（申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和）

T日投资者申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2011-6-27
基金名称	上证180成长交易型开放式指数基金
基金管理公司名称	华宝兴业基金管理有限公司
一级市场基金代码	510281

2011年6月24日信息内容

现金差额	¥3,032.00
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	¥1,000,000.000
基金份额净值（单位：元）	¥1.000

2011年6月27日信息内容

预估现金部分（单位：元）	¥3,032.00
现金替代比例上限	50%
是否需要公布IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	1000000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

成分股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额（单位：元）
600000	浦发银行	7400	允许	10%	
600029	南方航空	1400	允许	10%	
600031	三一重工	2000	允许	10%	
600036	招商银行	8100	允许	10%	
600048	保利地产	2400	允许	10%	
600068	葛洲坝	1400	允许	10%	
600089	特变电工	1700	允许	10%	
600104	上海汽车	1200	允许	10%	
600111	包钢稀土	500	允许	10%	
600115	东方航空	1500	允许	10%	
600123	兰花科创	200	允许	10%	
600166	福田汽车	900	允许	10%	
600173	卧龙地产	300	允许	10%	
600208	新湖中宝	1000	允许	10%	
600216	浙江医药	200	必须		6278
600221	海南航空	800	允许	10%	
600252	中恒集团	600	允许	10%	
600259	广晟有色	100	允许	10%	
600266	北京城建	300	允许	10%	
600325	华发股份	400	允许	10%	
600348	国阳新能	800	允许	10%	
600369	西南证券	300	必须		3561
600376	首开股份	500	允许	10%	
600383	金地集团	3000	允许	10%	
600395	盘江股份	200	允许	10%	
600406	国电南瑞	400	允许	10%	
600418	江淮汽车	600	允许	10%	
600489	中金黄金	600	允许	10%	
600508	上海能源	200	允许	10%	
600518	康美药业	1000	允许	10%	
600519	贵州茅台	200	允许	10%	
600528	中铁二局	500	允许	10%	
600547	山东黄金	500	允许	10%	
600550	天威保变	500	允许	10%	
600585	海螺水泥	1300	允许	10%	
600655	豫园商城	800	允许	10%	
600660	福耀玻璃	1000	允许	10%	
600674	川投能源	200	必须		2804
600690	青岛海尔	500	允许	10%	
600703	三安光电	400	允许	10%	
600741	华域汽车	700	允许	10%	
600748	上实发展	300	允许	10%	
600759	正和股份	200	允许	10%	
600773	西藏城投	200	允许	10%	
600795	国电电力	5000	允许	10%	
600812	华北制药	500	允许	10%	
600823	世茂股份	200	允许	10%	
600875	东方电气	400	允许	10%	
600887	伊利股份	1000	允许	10%	
600997	开滦股份	400	允许	10%	
601099	太平洋	300	允许	10%	
601111	中国国航	1100	允许	10%	
601166	兴业银行	4900	允许	10%	
601288	农业银行	10000	允许	10%	
601328	交通银行	13600	允许	10%	
601390	中国中铁	3400	允许	10%	
601607	上海医药	600	允许	10%	
601699	潞安环能	300	允许	10%	
601717	郑煤机	100	允许	10%	
601998	中信银行	1500	禁止		

（下转D15版）