(上接 D13 版)

七、本次发售当事人和中介机构

(一)基金管理人
名称: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
邮政编码:200121
法定代表人:郑安国
电话:(021)38505888
传真:(021)38505777
联系人:熊鹏举
(二)基金托管人
名称:中国银行股份有限公司
住所:北京市复兴门内大街 1 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼
法定代表人:肖钢
客户服务统一咨询电话:95566
网址:www.boc.cn
(三)销售机构
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:丙敏祺
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
公司网站: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
公司网站: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)招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:余晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务热线: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
公司网站: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:俞仁一
电话:021-38676161
传真:021-38676161
联系人:丙敏祺
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
注册地址: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)招商证券股份有限公司
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
(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)国海证券有限公司
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:谢尚得
客户服务热线:4008888123
公司网址:www.xyzq.com.cn
(24)招都证券有限公司
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)万家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(色长途费)
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、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司、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。
(四)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
(五)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
(六)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(往:公司总机)
公司传真:021-22280000(往:传真总机)
签章会计师:徐艳,蒋燕华
业务联系人:蒋燕华

八、网下股票认购清单

本基金募集期间,网下股票认购名单如下表所示。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。

股票代码	股票简称	股票代码	股票简称	股票代码	股票简称
600000	浦发银行	600348	国阳新能	600741	华域汽车
600029	南方航空	600369	西南证券	600748	上实发展
600031	三一重工	600376	首开股份	600759	正和股份
600036	招商银行	600383	金地集团	600773	西藏城投
600048	保利地产	600395	盘江股份	600795	国电电力
600068	葛洲坝	600406	国电南瑞	600812	华北制药
600089	特变电工	600418	江淮汽车	600823	世茂股份
600104	上海汽车	600489	中金黄金	600875	东方电气
600111	包钢稀土	600508	上海能源	600887	伊利股份
600115	东方航空	600518	康美药业	600997	开滦股份
600123	兰花科创	600519	贵州茅台	601099	太平洋
600166	福田汽车	600528	中铁二局	601111	中国国航
600173	卧龙地产	600547	山东黄金	601166	兴业银行
600208	新湖中宝	600550	天威保变	601288	农业银行
600216	浙江医药	600585	海螺水泥	601328	交通银行
600221	海南航空	600655	豫园商城	601390	中国中铁
600252	中恒集团	600660	福耀玻璃	601607	上海医药
600259	广晟有色	600674	川投能源	601699	潞安环能
600266	北京城建	600690	青岛海尔	601717	郑煤机
600325	华发股份	600703	三安光电	601998	中信银行

华宝兴业基金管理有限公司
2011 年 6 月 29 日

(上接 D13 版)

三、基金收益分配原则、执行方式

(一)基金利润的构成
基金利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
(二)基金可供分配利润
基金可供分配利润指从基金上市日截至收益分配基准日基金份额净值增长率与标的指数同期增长率的差额乘以基金上市前一日基金份额净值乘以基金收益分配基准日发售在外的基金份额总额所得到的总额。
基金净值增长率为收益分配基准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拆算,则以基金份额拆算日为初始日重新计算);标的指数同期增长率为收益分配基准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拆算,则以基金份额拆算日为初始日重新计算)。
(三)收益分配原则
1、每一基金份额享有同等分配权;
2、本基金收益分配采用现金方式;
3、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多 12 次;每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。若基金合同生效不满三个月,收益可不分配;
4、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配;
5、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值;
6、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。
(四)基金收益分配数额的确定
1、在收益分配基准日,基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率,并计算基金净值增长率与标的指数净值增长率的差额,当差额超过 1%时,基金管理人有权进行收益分配。
2、计算截至收益分配基准日本基金的可供分配利润,并根据前述原则确定收益分配比例及收益分配数额。
(五)收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截止基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
(六)收益分配方案的确定与公告
基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核后确定,基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。
在分配方案公布后,基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。
基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、标的指数许可使用费;
4、因基金的证券交易或结算而产生的费用;
5、基金合同生效以后的信息披露费用;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金合同生效以后的会计师费和律师费;
8、基金资产的资金汇划费用及开户费用;
9、基金收益分配中发生的费用;
10、基金上市费及年费;
11、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金资产总值中扣除。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。
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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
2、基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1%年费率计提。
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 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
3、标的指数许可使用费
本基金作为指数基金,潜根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.03%的年费率计提。指数使用费每日计算,逐日累计。
计算方法如下:
H=E×0.03%/当年天数
H 为每日应付的指数许可使用费,E 为前一日的基金资产净值。
指数使用费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元(25,000)。
标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。
4、本条第(一)款第 3 至第 11 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。
(三)不列入基金费用的项目
本条第(一)款约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。
(四)基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。
(五)税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
(二)投资范围
本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,指数化投资比例即投资于指数成份股、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、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
(三)投资策略
1、股票资产指数化投资策略
本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
2、债券投资策略
本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性、有效利用基金资产、提高基金资产的投资收益。
3、权证投资策略
本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究,结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
(四)投资组合管理
本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证 180 成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
1、标的指数定期调整
根据标的指数的编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
2、成份股公司信息的日常跟踪与分析
跟踪标的指数成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等),以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。
3、标的指数成份股票临时调整
在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。
4、申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪本基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。
5、跟踪偏离度的监控与管理
每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。
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。
(五)标的指数
本基金的标的指数为上证风格指数系列中的上证 180 成长指数(指数代码为 000028)。
上证 180 风格指数是由中证指数公司编制并发布。它以上证 180 指数为样本空间,共包含 4 只指数,包括上证 180 成长指数、上证 180 价值指数、上证 180 相对成长指数和上证 180 相对价值指数。其中,上证 180 成长指数是从上证 180 指数样本股中,挑选最具代表性的 60 只成长股票形成指数。该指数从风格特征的角度进一步剔画了上证 180 指数,也为投资者提供了新的业绩基准和资产配置工具。
随着市场环境的变化,如果上述标的指数不适用本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,进行适当的程序变更本基金标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中,若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
(六)业绩比较基准
本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的,业绩比较基准随之变更并公告。
(七)风险收益特征
本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。
(八)投资禁止行为与限制
1、禁止用本基金财产从事以下行为
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)法律法律、行政法规有关法律法规规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资标的指数成份股或备选成份股的,基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下,将结合使用其他合理方法进行适当替代。
2、基金投资组合比例限制
(1)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(2)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;
(3)本基金不得违反基金合同的投资比例的约定;
(4)法律法规的其他限制。
3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)基金资产净值的计算方法
1、股票估值方法
(1)上市流通股票的估值
上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;
(2)未上市股票的估值
送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。
首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。
(3)有明确锁定期股票的估值
首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的收盘价估值;非公开发行且处于明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。
2、固定收益证券的估值办法
(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。
(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按有交易的最近交易日所采用的净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。
(3)未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。
(4)近银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。
(5)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量。
(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。
3、权证估值:
(1)配股权证的估值:
因持有股票而享有的配股权,类同权证处理方式的,采用估值技术进行估值。
(2)认沽/认购权证的估值:
从持有确认日起到实出日或行权日止,上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值;因持有股票而享有的配股权,停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。
4、本基金持有的回购以成本列示,按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。
5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。
6、在任何情况下,基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。
7、国家有最新规定的,按国家最新规定进行估值。
(二)基金资产净值的公告方式
基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。
在开始办理基金份额申购或者赎回之后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)基金合同的终止
有下列情形之一的,本基金合同应当终止:
1、基金份额持有人大会决定终止;
2、因重大违法、违规行为,被中国证监会责令终止的;
3、基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;
4、法律法规规定基金合同规定的其他情形。
基金合同终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《证券办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定,行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。
(二)基金财产的清算
1