深证300价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

(上接D13版)

（1）董事会
负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。
（2）监事会
是公司常设的监事机构，对股东会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人员进行监督。
（3）合规审核及风险管理委员会
作为董事会下的专业委员会之一，对公司内部控制制度、监察稽核制度进行检查评估；审查公司财务，对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议；对公司资产与基金资产的经营进行评估。
（4）风险控制委员会
作为总经理下设的专业委员会之一，风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策，制定灾难复原计划及紧急情况处理制度。确保公司风险控制符合标准，就潜在风险与相关部门协调，审阅公司审计报告及监察情况。
（5）督察长
独立行使督察权利；直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。
（6）风险管理部
风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及处置风险措施，组织执行，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，汇总公司业务所有的风险信息，独立识别、评估各类风险，提出风险控制建议，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。
（7）合规审计部
合规审计部负责设计及实施公司合规审计计划，检查公司各项业务的合规情况及监督公司内部规章制度的执行情况，定期向监管机构及公司管理层进行汇报。
（8）业务部门
风险管理是每一个业务部门首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。
3、风险管理和内部风险控制的措施
（1）建立内控体系，完善内控制度
公司建立、健全了内控体系，通过高管人员关于内控的明确分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动独立，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。
（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制
建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。
（3）建立、健全岗位责任制
建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。
（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序
建立了风险评估机制，通过适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。
（5）建立有效的内部监控系统
建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。
（6）使用数量化的风险管理手段
采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。
（7）提供足够的培训
制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况
1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：项俊波
成立时间：2009年1月15日
注册资金：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
电话：010）63201510
传真：010）63201816
联系人：李芳菲
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京，经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“金牌理财”TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《财资》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。
中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。
2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。
3、基金托管业务经营情况
截止2011年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共102只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万菱信竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双益债券型证券投资基金、中海监考灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德优势股票型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、折扣聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金。
（二）基金托管人的内部风险控制制度说明
1、内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作，严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。
2、内部控制组织结构
风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价，托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。
3、内部控制制度及措施
具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。
（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。
当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：
1、电话提示，对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
2、书面警示，对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
3、书面报告，对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、网下现金发售机构
机构名称：交银施罗德基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（邮）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼
法定代表人：钱文挥
成立时间：2005年8月4日
电话：021）61055027
传真：021）61055054
联系人：许野
客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），021）61055000
网址：www.jyfund.com、www.jysld.com、www.bocomschroder.com
2、网下股票发售代理机构
具有基金销售资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司，详见基金份额发售公告。本基金募集期内获得基金代销业务资格的会员单位也可代理本基金的网上现金发售业务。
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：0755）25941405
传真：0755）25987133
联系人：丁志男
（三）驻具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
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
电话：021 81358666
传真：021 81358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明
（四）审计基金财产的会计师事务所
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
联系电话：021）23238888
传真：021）23238800
联系人：金毅
经办注册会计师：薛竞、金毅

六、基金的募集

（一）基金募集的依据
本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可[2011]967号文核准募集发售。
（二）基金类型
股票型基金
（三）基金运作方式
交易型开放式
（四）基金存续期限
不定期
（五）基金发售对象、方式和场所
1、发售对象
个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者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。
2、发售方式
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。
网上现金认购是投资者指通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。
网下现金认购是指投资者通过基金管理人以现金进行认购。
网下股票认购是指通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行认购。
3、发售场所
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。
（六）基金份额的认购
1、基金份额的发售期限

（下转D15版）

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

(上接D13版)

1)已公告的将被调出深证300价值价格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。

四、清算与交割

（一）基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期间形成的利息折算成基金份额归基金份额持有人所有，具体份额以注册登记机构的记录为准；投资者以股票认购的，认购股票由发售代理机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。投资者的认购股票在募集冻结期间产生的权益归投资者所有。
（二）本基金权益登记由本基金的注册登记机构在基金募集结束后完成。
投资者通过发售代理机构办理网下股票认购的，发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人于本基金认购期最后一日日终初步确认各成分股的有效认购数量。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用于认购的相应股票过户至本基金组合证券认购专户，完成验资后划入本基金的证券账户。基金募集期结束后，基金管理人为投资者计算认购份额，并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，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。基金合同生效后，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。

五、基金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（含网下股票认购所募集的股票市值）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，未达到基金备案的条件，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，应予以解冻。
如果基金合同不能生效，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

六、本次募集当事人或中介机构

（一）基金管理人
名称：交银施罗德基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（邮）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼
邮政编码：200120
法定代表人：钱文挥
成立日期：2005年8月4日
电话：021）61055050
传真：021）61055034
联系人：陈超
（二）基金托管人
名称：中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
法定代表人：项俊波
成立时间：2009年1月15日
注册资金：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
电话：010）63201510
传真：010）63201816
联系人：李芳菲
（三）基金份额发售机构
1、网下现金发售机构
机构名称：交银施罗德基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（邮）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼
法定代表人：钱文挥
成立时间：2005年8月4日
电话：021）61055027
传真：021）61055054
联系人：许野
客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），021）61055000
网址：www.jyfund.com、www.jysld.com、www.bocomschroder.com
2、网下股票发售代理机构（排名不分先后）
（1）光大证券股份有限公司
住所：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）22169999
传真：021）22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com
（2）招商证券股份有限公司
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：丙敏棋
客户服务电话：95521，400-8888-666
网址：www.gtja.com
（3）中信建投证券有限责任公司
住所：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：010）85130588
传真：010）65182261
联系人：魏明
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com
（4）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021）23219000
传真：021）23219100
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com
（5）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
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
电话：010）66568430
联系人：田薇
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn
（6）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：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）82943666
传真：0755）82943636
联系人：黄健
客户服务电话：400-8888-111，95565
网址：www.newone.com.cn
（7）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
电话：021）38565785
传真：021）38565955
联系人：谢高得
客户服务电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn
（8）中信证券股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010）60838888
传真：010）60833739
联系人：陈忠
客户服务电话：95558
网址：www.cs.ecitic.com
（9）中银万国证券股份有限公司
住所：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
联系人：李清怡
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.sywg.com
（10）华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市福田区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
电话：0755）82492000
传真：0755）82492962
联系人：盛宗凌
客户服务电话：95513
网址：www.lhzq.com
（11）国都证券有限责任公司
住所：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
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com
（12）中银国际证券有限责任公司
住所：上海市银城中路200号39层
办公地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
客户服务电话：400-620-8888
网址：www.bocichina.com
（13）中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（0507-1510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
电话：0532）85022326
传真：0532）85022605
联系人：吴忠超
客户服务电话：0532）96577
网址：www.zxwt.com.cn
（14）恒泰证券股份有限公司
住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：庞介民
电话：0471）4979037
传真：0471）4961259
联系人：王旭华
客户服务电话：0471）4960762，021）68405273
网址：www.cnht.com.cn
（15）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦16-26楼
法定代表人：何如
电话：0755）82130833
传真：0755）82133952
联系人：齐晓燕
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
（16）中航证券有限公司
住所：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
电话：0791）6768681
传真：0791）6789414
联系人：余雅娜
客户服务电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com
（17）宏信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
电话：0755）82558305
传真：0755）82558355
联系人：陈剑虹
客户服务电话：400-800-1001
网址：www.essence.com.cn
（18）东源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人：冯戎
电话：010）88085858
传真：010）88085195
联系人：李巍
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com
（19）长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：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：027）65799999
传真：027）85481900
联系人：李良
客户服务电话：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com
（20）德邦证券有限责任公司
住所：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
电话：021）68761616
传真：021）68767981
客户服务电话：4008-888-128
网址：www.tebon.com.cn
（21）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
（22）江海证券有限公司
住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
电话：0451）82269280
传真：0451）82287211
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：0755）25941405
传真：0755）25987133
联系人：丁志男
（三）驻具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
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
电话：021 81358666
传真：021 81358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明
（四）审计基金财产的会计师事务所
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
联系电话：021）23238888
传真：021）23238800
联系人：金毅
经办注册会计师：薛竞、金毅

七、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，但是募集期结束前已公告的将被调出深证300价值价格指数的成份股不得用于认购本基金。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。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
000001	深发展A	000562	宏源证券	000783	长江证券
000002	万　科A	000568	泸州老窖	000786	北新建材
000006	深振业A	000572	海马汽车	000800	一汽轿车
000012	南　玻A	000581	威孚高科	000825	太钢不锈
000021	长城开发	000584	友利控股	000828	东莞控股
000022	深赤湾A	000589	黔轮胎A	000830	鲁西化工
000024	招商地产	000597	东北制药	000850	华茂股份
000027	深圳能源	000600	建投能源	000877	天山股份
000036	华联控股	000601	韶能股份	000881	大连国际
000042	深 长 城	000608	阳光股份	000898	鞍钢股份
000059	辽通化工	000616	亿城股份	000900	现代投资
000069	华侨城A	000619	海螺型材	000903	云内动力
000088	盐 田 港	000623	吉林敖东	000910	大亚科技
000089	深圳机场	000625	长安汽车	000911	南宁糖业
000090	深 天 健	000651	格力电器	000926	福星股份
000099	中信海直	000659	珠海中富	000933	神火股份
000100	TCL集团	000667	名流置业	000937	冀中能源
000157	中联重科	000679	大连友谊	000951	中国重汽
000159	国际实业	000680	山推股份	000959	首钢股份
000338	潍柴动力	000690	宝新能源	000963	华东医药
000401	冀东水泥	000698	沈阳化工	000989	九 芝 堂
000402	金 融 街	000707	双环科技	002001	新 和 成
000417	合肥百货	000708	大冶特钢	002028	思源电气
000419	通程控股	000709	河北钢铁	002048	宁波华翔
000422	湖北宜化	000717	韶钢松山	002078	太阳纸业
000425	徐工机械	000726	鲁 泰A	002142	宁波银行
000488	晨鸣纸业	000728	国元证券	002191	劲嘉股份
000501	鄂武商A	000729	燕京啤酒	002202	金风科技
000527	美的电器	000731	四川美丰	002242	九阳股份
000528	柳　工	000748	长城信息	002244	滨江集团
000539	粤电力A	000759	中百集团	002254	烟台氨纶
000541	佛山照明	000761	本钢板材		
000543	皖能电力	000778	新兴铸管		
000550	江铃汽车	000780	平庄能源		

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

(上接D13版)

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。
召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。
（2）通讯方式开会
在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期第2个工作日在公证机构和基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力。
3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
（七）决议形成的条件、表决方式、程序
1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：
（1）一般决议
一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；
（2）特别决议
特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效：更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。
3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。
4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
（八）计票
1、现场开会
（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。
（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。
（3）如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
（4）计票过程应由公证机关予以公证。
2、通讯方式开会
在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。
（九）基金份额持有人大会决议的中国证监会核准或备案后的公告时间、方式
1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。
2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。
3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒体公告。
4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则
本基金收益分配应遵循下列原则：
1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2、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；
3、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；
4、本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例依据以下原则确定：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；
5、本基金收益分配采取现金分红方式；
6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。
在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在指定媒体上公告。
（二）基金收益分配数额的确定
1、在收益评价日，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同期净值增长率的差额，当差额超过1%时，基金管理人有权进行收益分配。
2、根据前述收益分配原则确定收益评价日本基金的收益分配比例及收益分配数额。
（三）收益分配方案
基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
（四）收益分配方案的确定、公告与实施
1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。
2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。在分配方案公布后（依据具体方案的规定），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。
3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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、基金合同生效后的信息披露费用；
4、标的指数使用许可费；
5、基金上市费及年费；
6、基金收