中海上证380指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：中海基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

1、本基金的募集申请已于2011年9月20日获中国证监会证监许可【2011】1507号文核准。

2、基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

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。

3、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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

4、投资有风险，投资者认购/或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

5、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》”）等相关法律法规和《中海上证380指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了中海上证380指数证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。本基金根据本招募说明书所载明的资料申请募集。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。本基金投资者自依《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金《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。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

《基金合同》	《中海上证380指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国（又为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的中海上证380指数证券投资基金
《招募说明书》	《中海上证380指数证券投资基金招募说明书》，即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的会计与审计、基金的信息披露、风险揭示、《基金合同》的终止与基金财产的清算、《基金合同》的内容摘要、《托管协议》的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新
《托管协议》	基金管理人与基金托管人签订的《中海上证380指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
《发售公告》	《中海上证380指数证券投资基金基金份额发售公告》
《业务规则》	《中海基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	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
基金销售业务	基金销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理基金销售业务的代理机构
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等
基金注册登记机构	中海基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	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的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	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开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律法规规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不超过3个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
申购	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T日	自T日起第n个工作日（不包含T日）
T+n日	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	《基金合同》生效后，基金投资者根据《基金合同》和《招募说明书》及基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过3个月的时间开始办理
赎回	《基金合同》生效后，基金份额持有人根据《基金合同》和《招募说明书》及基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额的10%时的情形
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、定期定额投资及转托管等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为
基金转换	基金份额持有人按照《基金合同》和基金管理人届时有效公告规定的条件，向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的某一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记业务的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构在投资者指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日提交基金申购申请的一种投资方式
基金利润	基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额
基金资产总值	基金所拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊（以下简称“指定报刊”）和互联网网站（以下简称“网站”）
不可抗力	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

邮政编码：200120

成立日期：2004年3月18日

法定代表人：黄鹏

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字【2004】24号

组织形式：有限责任公司（外外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

存续期间：持续经营

联系人：兰峻

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	41.591%
国联证券股份有限公司	33.409%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

陈浩鸣先生，董事长。中央财经大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁。历任海洋石油开发工程设计公司经济师、中国海洋石油总公司财务部保险处主管、资产处处长、中海石油投资控股有限公司总经理，中海信托股份有限公司总经理、中海基金管理有限公司总经理。

成赤先生，董事。中国人民大学硕士。现任中国海洋石油总公司资金管理部总经理。历任中国海洋石油总公司计划资金部副资处处长、中国海洋石油有限公司资金融资部副总监。

胡旭鹏先生，董事。华东政法大学硕士。现任中海信托股份有限公司副总裁兼首席风险官。历任蚌埠市人民检察院助理检察员，上海浦东发展银行总行资产保全部法务专员，中海信托股份有限公司法务主管、风险管理部代经理、风险管理部经理、合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司副总裁。历任国联证券交易员、投资经理、投资部副总经理，国联投资管理有限公司投资部总经理、中海基金管理有限公司投资总监（朝间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司总裁助理兼证券投资部总经理。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司副总裁兼资产管理部总经理。历任国联证券股份有限公司（原无锡证券）上海海伦路证券营业部交易员、证券投资部投资主管、上海邯郸路证券营业部副总经理、总经理、无锡县前东街证券营业部总经理、无锡人民东路证券营业部总经理、财富管理中心总经理、无锡华夏南路证券营业部总经理。

TAY SOO MENG（邵郑明）先生，董事。新加坡国籍，新加坡国立大学学士。现任爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。历任新加坡Coopers & Lybrand审计师，法国兴业资产管理集团行政及财务部门主管、董事兼营运总监（亚太区，日本除外）、董事总经理兼营运总监（亚太区，日本除外）、董事总经理兼新加坡执行长。

李维森先生，独立董事。澳大利亚悉尼大学博士。现任复旦大学经济学院经济学教授、博士生导师、副院长。历任山东社会科学院《东岳论丛》编辑部编辑、澳大利亚麦角理大学经济学讲师。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所硕士。现任国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。曾任中关村证券公司总裁助理。

WEIDONG WANG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任北京德恒律师事务所合伙人。历任Sidley Austin（德德律师事务所）芝加哥总部律师、北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授。

2、监事会成员

朱恩慈女士，监事长。本科，会计师。现任中海信托股份有限公司运营总监兼信托事务管理总部总经理、托管部部门经理。曾任职于中信上海信托投资公司财务部。

Denis LEFRANC（钱云飞）先生，监事。法国国籍。学士。现任爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司亚洲副执行总监。历任法国期货市场监管委员会审计师，法国兴业银行法律顾问、资本市场及资产管理法务部门副主管，法国兴业资产管理集团法遵主管及法律顾问，华宝兴业基金管理有限公司常务副总裁，法国兴业资产管理集团亚太区执行长，东方汇理资产管理香港有限公司北亚区副执行长。

王红女士，职工监事。研究生毕业。现任中海基金管理有限公司总经理助理兼北京分公司总经理。历任辽宁省针棉毛织品进出口公司储运科科员、北京中盛纸业有限公司总经理助理、北京大地投资有限公司总经理助理兼市场营销部经理、湘财证券有限责任公司北京办事处主任。2007年1月进入本公司工作，历任北京管理总部副总经理、北京分公司总经理。2009年1月至今任本公司总经理助理兼北京分公司总经理。

3、高级管理人员

黄鹏先生，总经理。复旦大学金融学专业硕士。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员。2007年10月进入本公司工作，曾任董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理，2011年10月至今任本公司总经理。

宋宇先生，副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，曾任本公司督察长。2010年12月至今任本公司副总经理（朝间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理）。

朱冰峰先生，督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。历任长江律师事务所律师、华虹（集团）有限公司法律顾问、锦天城律师事务所律师、上海证监局副处级职务。2009年10月进入本公司工作，曾任总经理助理。2010年12月至今任本公司督察长。

4、基金经理

陈明星先生，拟任基金经理，中国科学技术大学金融学专业硕士。历任安徽省公路运输管理局职员、中科大上海研究发展中心有限公司项目经理、平安资产管理有限公司分析师。2007年10月进入本公司工作，曾任金融工程分析师兼基金经理助理，现任金融工程总监。2010年3月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理。

5、投决委员会成员

黄鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司总经理。

吕晓峰先生，委员。现任中海基金管理有限公司投研中心总经理、投资总监、基金经理。

骆泽斌先生，委员。现任中海基金管理有限公司研究总监、基金经理。

陈明星先生，委员。现任中海基金管理有限公司金融工程总监、基金经理。

江小霞先生，委员。现任中海基金管理有限公司固定收益小组负责人、基金经理。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司基金经理。

6、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，办理或委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、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、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、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、报表和其他相关资料。

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、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、《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、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《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滥权或违规经营；

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、基金的商业秘密和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。

（五）基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎勤勉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、《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。

（六）基金管理人的风险管理和内部控制制度

1、内部控制体系概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

2、风险管理的理念和文化

①以最大程度保护基金份额持有人利益为己任。

②风险管理是业务发展的保障。

③最高管理层承担最终责任。

④分工明确、相互制约的组织结构是前提。

⑤制度建设是基础。

⑥制度执行监督是保障。

3、内部控制遵循的原则：

①融全性原则。内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、公司自有资产、其他资产的运作分离。

④相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

⑤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。

4、风险管理和内部控制的组织体系

①董事会应充分重视风险控制。通过批准公司的风险控制战略、制度和工作计划，确保公司已具有了管理其面临的所有风险所需的必要系统、运作制度和控制环境，并通过审计与合规委员会和督察长对公司经营管理层的风险控制工作发挥更权威的监督作用。董事会通过控制公司治理结构风险、制定内部管理制度、完善有关议事规则及充分发挥独立董事的作用达到对风险的最终控制。

②风险控制委员会为公司非常设议事机构，负责对公司业务风险控制进行决策和协调，是公司日常风险控制工作的最高决策机构。其具体职责主要有：审议基金财产风险状况评价分析报告，审定公司的业务授权方案的合法性、合规性，负责协调处理突发性重大事件并界定相关人员的责任，审议公司其他各项资产管理业务的风险状况评价分析报告。

③督察长负责对公司和基金的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告。

④监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵规守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

⑤公司各职能部门是公司内部风险控制措施的具体执行单位，应在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及风险控制规定，并督导部门员工严格执行。

5、监督机构的合规检查作用

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵规守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

①控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

②公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

③公司健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

④公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

（下转D10版）

中海上证380指数证券投资基金份额发售公告

基金管理人：中海基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

一、中海上证380指数证券投资基金（以下简称“本基金”）募集已获中国证监会证监许可【2011】1507号文（关于核准中海上证380指数证券投资基金募集的批复）核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或保证。

二、本基金是契约型开放式股票型证券投资基金。

三、本基金管理人为中海基金管理有限公司（以下简称“本公司”）；基金托管人为中国工商银行股份有限公司；注册登记机构为本公司。

四、本基金的募集对象为个人投资者、机构投资者、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开放式证券投资基金的其他投资者。

五、本基金份额的基金代码为：399011。

六、本基金募集期限自2012年2月6日起至2012年3月2日，通过本公司的直销机构和指定的代销机构网点公开发售。

七、本公司已经开通网上开户和网上认购，详细情况请浏览公司网站（www.zhfund.com）相关内容。

八、投资者欲购买本基金，须开立本公司的基金账户和销售机构要求的交易账户（交易账户类型可以是指定银行卡、资金账户、存款账户等，以销售机构要求为准）。除法律法规另有规定外，一个投资者只能开设和使用一个基金账户。

九、募集期内，销售机构可同时办理基金账户和交易账户的开户及认购申请手续。已经开立本公司基金账户和销售机构要求的交易账户的投资者无须再开立基金账户和交易账户，可直接认购本基金。本基金合同生效后，本公司将统一为所有新开立基金账户的投资者寄送开户确认书及基金账户卡。

十、通过本公司网站和代销机构首次认购单笔最低金额为人民币1000元；通过本公司直销柜台首次认购单笔最低金额为人民币100,000元，追加认购单笔最低金额为人民币10,000元。投资者在募集期内可以多次认购基金份额。募集期间不设置投资者单个基金账户最高认购金额限制。

十一、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构接受了认购申请，申请的成功与否应以注册登记机构的确认结果为准。投资者在发售期内可以多次认购基金份额，已经正式受理的认购申请不得撤销。认购期间单个投资者累计认购规模没有限制。

十二、投资者认购款项在基金募集期间产生的利息折合成基金份额记入投资者账户，认购利息折算的基金份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。具体份额数以注册登记机构的记录为准。

十三、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在2012年2月1日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上的本基金《基金合同》摘要和《招募说明书》。

十四、本基金的《基金合同》、《招募说明书》、《托管协议》及本公告将同时发布在本公司网站（www.zhfund.com）上。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格并了解本基金发售的相关事宜。

十五、代销机构代销本基金的城市名称、认购网点等具体事项详见各代销机构在各销售城市当地的相关业务公告，或拨打本公司客服电话（400-888-9788或021-38789788）。

十六、在募集期间，除本公告所列的代销机构外，如增加其他代销机构，或已有代销机构增加新的代销网点，将及时公告。请留意近期本公司及各代销机构的公告，或拨打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

十七、投资者可拨打本公司客户服务电话（400-888-9788或021-38789788）以及各代销机构客户服务电话咨询购买事宜。

十八、本基金是股票型基金，投资于上证380指数成份股和备选成份股的资产为基金资产净值的90%-95%。权证投资为基金资产净值的0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%-10%。

十九、本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本基金《基金合同》和《招募说明书》等法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者做出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

二十、基金管理人可综合各种情况对发行安排做适当调整。

一、本次发售基本情况

（一）基金名称

中海上证380指数证券投资基金（基金代码：399011）

（二）基金类型

股票型证券投资基金

（三）基金存续期限

不定期

（四）募集目标

本基金不设募集规模上限，在本基金的募集达到备案条件的前提下，基金管理人可视募集情况提前结束募集。

（五）基金份额初始面值

每份基金份额初始面值为1.00元人民币

（六）募集对象

个人投资者、机构投资者、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开放式证券投资基金的其他投资者。

（七）基金份额发售机构

1、直销机构：

①中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

法定代表人：黄鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：曾智男

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或021-38789788

公司网址：www.zhfund.com

②中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F211B单元

办公地址：北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F211B单元

负责人：王红

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：邹意

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

公司网站：www.zhfund.com

2、代销银行

中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司。

3、代销券商

国联证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、第一创业证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司。

上述排名不分先后。

如本次发售期间新增代销机构或代销机构新增营业网点将另行公告。

（八）募集时间安排与基金合同生效

本基金募集期自2012年2月6日起至2012年3月2日，期间向募集对象同时发售。

基金管理人可综合各种情况对募集期限作适当调整，但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。

基金募集期限届满具备下列条件的，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，并予以公告：

1、基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。

2、基金份额持有人的人数不少于200人。

基金备案获中国证监会书面确认之日起，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。

基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并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。

二、认购方式与相关规定

（一）认购方式

本基金采取金额认购的方式。

（二）认购费率

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，如下所示：

（单位：元）

认购金额（M）	认购费率
M<100万	1.00%
100万≤M<500万	0.60%
M≥500万	每笔1000元

投资者重复认购，须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

（三）认购份额的计算

本基金份额的初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

本基金认购采取金额认购方式，认购份额的计算包括认购金额和认购金额在本基金募集期间产生的利息，其中利息以注册登记机构的记录为准，保留小数点后两位。认购份额计算时采用四舍五入方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

本基金有效认购申请的认购费用及认购份额的计算统一采用外扣法，计算公式如下：

基金的认购金额包括认购费用和净认购金额，其中：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额初始面值

例：某投资者投资10,000元认购本基金，认购费率为1.00%，假定募集期产生的利息为3.00元，则可认购基金份额为：

净认购金额=10,000/（1+1.0%）=9,900.99元

认购费用=10,000-9,900.99=99.01元

认购份额=（9,900.99+3.00）/1.00=9,903.99份

即：该投资者投资10,000元认购本基金，可得到9,903.99份基金份额。

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（四）基金的认购限制

通过本公司网站和代销机构首次认购单笔最低金额为人民币1,000元；通过本公司直销柜台首次认购单笔最低金额为人民币100,000元，追加认购单笔最低金额为人民币10,000元。投资者在募集期内可以多次认购基金份额。募集期间不设置投资者单个基金账户最高认购金额限制。

三、个人投资者的开户及认购程序

本程序说明仅供投资人参考，具体程序及相关事宜以各代销机构的规定为准，新增代销渠道的认购程序以有关公告为准。

（一）中国工商银行股份有限公司

1、受理开户和认购的时间

基金发售日的9:00-17:00。周六、周日照常办理。

2、开户及认购程序

①持代销网点提交以下材料，办理开户手续：

a、本人现时有效的法定身份证件原件（包括居民身份证、军人证、护照等，下同）；

b、填妥的《基金账户业务申请表》；

c、中国工商银行牡丹灵通卡或理财金账户卡。

投资者可于T+2日以后通过中国工商银行指定的代理基金业务网点办理开户确认手续。

②开户同时可办理认购手续，需填妥并提交以下材料：

a、本人现时有效的身份证件原件；

b、中国工商银行牡丹灵通卡或理财金账户卡；

c、填妥的《基金业务申请表》、《基金申认购申请表》。

中国工商银行网上银行和电话银行可同时受理基金的认购业务，具体情况可通过该行网站、客户服务电话（95588）查询。

中国工商银行代销网点接受认购申请后，当即向投资者提供缴款回执；投资者于发布本基金合同生效公告后到该行基金代销网点办理认购业务确认手续。

3、注意事项

①一个投资者只能开立一个基金账户。

②中国工商银行代销网点在个人投资者申请认购基金时不接受现金，投资者必须预先在用于认购基金的理财金账户卡或社丹灵通卡中存入足额的资金。

③个人投资者指定的银行存款账户须是中国工商银行理财金账户卡或社丹灵通卡中的人民币活期结算账户。

④个人投资者认购基金申请成立公布的个人投资者认购时间内办理。

⑤中国工商银行代销具体事宜，请以中国工商银行公告为准。

（二）基金公司直销中心

1、受理开户和认购的时间

基金发售日的9:00-17:00。

2、个人投资者办理开户（或账户注册）申请材料：

填妥并签章的《开放式基金账户业务申请表（