上证180成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2013年第1号

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示

上证180成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会2011年4月7日证监许可[2011]496号文核准募集。

基金管理人保证《上证180成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。本基金为股票基金,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。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2013年2月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日,财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

法定代表人:郑安国

总经理:裴长江

成立日期:2003年3月7日

注册资本:1.5亿元

电话:021-38505888

传真:021-38505777

联系人:韩东霞

股权结构:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份,外方股东领先资产管理有限公司持有49%的股份。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

郑安国先生,董事长、博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理、总裁。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理,中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

Alain Jean Patrick DUBOIS先生,董事,硕士。曾任法国财政部预算办公室部门负责人、里昂信贷资本市场部从事研究开发工作、拉扎德兄弟银行部门经理、Arjil et Cie银行董事总经理、德国商业银行资深产品设计师、法国兴业银行资深产品设计师、领先资产管理有限公司业务发展部负责人。现任领先资产管理有限公司董事长。

裴长江先生,董事,硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理,申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理,申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理,华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

谢文杰先生,董事,金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区(除日本外)董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

张群先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任北京科技大学经济管理学院(现东凌经济管理学院)教授、院长。现任北京科技大学东凌经济管理学院教授、学术委员会副主席,管理科学研究所所长。

罗飞先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士,独立董事,法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

2、监事会成员

张永光 (Jackson CHEUNG)先生,监事,工商管理硕士。曾在法国兴业银行主管银团贷款、项目融资、固定收益、外汇交易、衍生产品及结构性融资等工作,法国兴业银行亚洲区债务融资及衍生产品业务部总管。现任法国兴业银行集团中国区总裁。

贾璐女士,监事,硕士研究生,高级工程师。曾任宝钢自动化部组干科主办,宝钢国贸公司人事部人才开发室主任,宝钢国际公司人力资源部部长、组织部部长,宝钢资源(国际)公司总经理助理。现任华宝投资公司副总经理,宝钢集团金融系统党委副书记。

贺桂先先生,监事,毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理,现任公司营运副总监。

3、总经理及其他高级管理人员

裴长江先生,总经理,硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理,申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理,申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理,华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理。

谢文杰先生,副总经理,金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区(除日本外)董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

任志强先生,副总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

黄小薏(HUANG Xiaoyi Helen)女士,副总经理,硕士。曾任加拿大明道银行证券公司金融分析师,Acthop投资公司财务总监。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

刘月华先生,督察长,硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券协会等单位工作。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

胡洁女士,金融学硕士。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任交易员、高级产品经理、高级分析师、投资经理助理的职务。2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金的历任基金经理为余海燕女士,任职时间为2011年8月至2012年10月。

5、投资决策委员会成员

任志强先生,副总经理、投资总监。

牟旭东先生,投资副总监。

郭鹏飞先生,国内投资部总经理、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,投资副总监、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、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。

蒋宁女士,投资副总监、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)监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和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。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性;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;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;进行日常风险监控工作;协助评价基金财产风险状况;负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

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。

二、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

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管及投资者服务部总经理: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

(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,现有员工120余人。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、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管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,托管资产规模居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2012年12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LOF、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、海富通精选武号混合、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、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日盈债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、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力量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)等189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,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,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。最近一年内,中国银行托管及投资者服务部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。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商(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)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

联系人: 刘晨、李芳芳

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务热线:4008888788、10108998

公司网址:www.ebscn.com

(3)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

(4)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:陈有安

客户服务电话:4008-888-888

电话:010-66568430

联系人:田薇

网站:www.chinastock.com.cn

(5)中信建投证券股份有限公司

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:王常青

电话:400-8888-108(免长途费)

联系人:权唐

公司网址:www.csc108.com

(6)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

(7)广发证券股份有限公司

法定代表人:孙树明

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

公司网站:广发证券网 http://www.gf.com.cn

(8)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

法定代表人:胡运钊

电话:027-65799999

传真:027-85481900

联系人:李良

客户服务热线:95579或4008-888-999

公司客服网址:www.95579.com

(9)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:储晓明

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

(10)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(518048)

法定代表人: 杨宇翔

联系人:郑舒丽

电话:0755-22626172

客服电话: 95511—8

公司网址: http://www.pingan.com

(11)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

(12)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:95562

公司网站:www.xyzq.com.cn

(13)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

客户服务热线:95536

国信证券网站:www.guosen.com.cn

(14)中国中投证券有限责任公司

住所:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层

法定代表人:龙增来

客服电话:400-600-8008

网址:www.cjis.cn

(15)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

(16)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

(17)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

(18)中航证券有限公司

注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人:杜航

联系人:戴蕾

联系电话:0791-86768681

客服电话:400-8866-567

公司网址:www.avicsec.com

(19)西南证券股份有限公司

住所:重庆市江北区桥北苑8号

办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人:余维佳

客户服务电话:4008-096-096

传真:023-63786311

联系人:陈诚

(20)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

法定代表人:况雨林

客户服务电话:0871-3577930

网址: www.hongtazq.com

2、二级市场交易代理券商

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。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

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

住所:上海市长乐路989号世纪商贸广场45楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼

法定代表人:葛明

联系电话:(021)22288888

传真:(021)22280000

联系人:徐艳

签章注册会计师:徐艳、边卓群

四、基金的名称

本基金名称:上证180成长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:股票型指数基金

本基金运作方式: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的最小化。

七、基金的投资范围

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。

八、基金的投资策略

(一)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、价差挖掘策略、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。

(二)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。

九、基金的业绩比较基准

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。

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刻画了上证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的标的指数,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。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至2012年12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	371,946,725.80	99.41
	其中:股票	371,946,725.80	99.41
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,966,753.94	0.53
6	其他资产	233,552.32	0.06
7	合计	374,147,032.06	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)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	-	-
B	采掘业	25,600,051.00	6.86
C	制造业	110,343,199.80	29.56
C0	食品、饮料	29,888,884.00	8.01
C1	纺织、服装、皮毛	468,069.00	0.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,270,226.00	0.61
C5	电子	3,510,057.00	0.94
C6	金属、非金属	30,953,634.80	8.29
C7	机械、设备、仪表	38,700,633.00	10.37
C8	医药、生物制品	4,551,696.00	1.22
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,556,475.00	1.22
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	2,969,262.00	0.80
G	信息技术业	3,411,184.00	0.91
H	批发和零售贸易	4,604,928.00	1.23
I	金融、保险业	132,656,569.00	35.54
J	房地产业	17,585,996.00	4.71
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,067,775.00	0.29
	合计	302,795,439.80	81.12

(2)积极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	-	-
B	采掘业	907,610.00