华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书

2013年1号
（摘要）

重要提示

华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2012年3月23日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可【2012】392号）和2012年3月27日《关于华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2012】191号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2012年5月4日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证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。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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。

本基金是跟踪沪深300指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用沪深300指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用沪深300指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2013年5月3日，有关财务和业绩表现数据截止日为2013年3月31日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

一 基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
住所：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：齐亮
成立日期：2004年11月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178号
经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：沈炜
联系电话：400-888-0001，（021）38601777
股权结构：柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

（二）主要人员情况
1、董事会成员
齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长，2001年至2004年任华泰证券股份有限公司副总裁。
姜治平先生：董事，硕士，曾就职于CR&R环保公司、Unisys优利系统日本有限公司，1994年-2002年任纽约银行梅隆资产管理公司高级投资组合经理，2003年-2010年任纽约梅隆资产管理公司亚太区行政总裁，2010年-2011年任纽约梅隆银行被动投资及交易型开放式指数证券投资基金全球主管，2012年3月至今任柏瑞投资公司行政总裁。
吴祖芳先生：董事，硕士，1992年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。
Rajeev Mittal先生：董事，学士，1992年加入美国国际集团，2009—2011年担任柏瑞投资（欧洲分公司）总经理，新兴市场投资主管，全球固定收益研究团队主管和行政总裁（欧洲分公司），2011年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁（亚洲，日本除外）、总经理、新兴市场投资总管，全球固定收益研究团队主管。
韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。
朱小平先生，独立董事，硕士，1983至今任中国人民大学商学院教授。
陈念良先生，独立董事，1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。
薛加玉先生，独立董事，博士，1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。
杨科先生：独立董事，学士，2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。
2、监事会成员
常小抒先生：监事长，学士，2004-2007年任美国国际集团全球投资公司资深财务分析师，2007年至今任柏瑞投资亚洲有限公司（原美国国际集团亚洲投资公司）亚洲区首席财务官。
王桂芳女士：监事，硕士，1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。
柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理，2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。
陈培先生：监事，硕士。2001-2004年，就职于富国基金管理有限公司，任基金会计等职。2004年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金事务部总监。
3、总经理及其他高级管理人员
韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。
王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。
陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。
房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年就职于上海证券交易所登记结算公司，2001-2004年任华安基金管理有限公司部门总监，2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。
4、本基金基金经理
张娅女士：美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作，2004年初加入本公司，从事投资研究和金融工程工作，2006年11月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部总监。2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘ETF及华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。
柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理，2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。
5、投资决策委员会成员
主席：总经理韩勇先生；
成员：副总经理王溯舸先生；投资总监汪晖先生；田汉卿女士；固定收益部总监董元星先生；研究部副总监蔡静女士；基金经理沈涛先生。
列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。
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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，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、赎回对价；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之对价；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法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、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
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、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺
1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、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、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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）越权或违规经营；
（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、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、欺诈成份；
（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。
4、基金经理承诺
（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎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、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、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。

（五）基金管理人的内部控制制度
1、内部控制的原则
（1）健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；
（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。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；
（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；
（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；
（6）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。
2、内部控制的主要内容
（1）控制环境
董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。
公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。
公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。
（2）风险评估
公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。
（3）控制活动
控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。
自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。
（4）信息与沟通
公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。
（5）内部监控
内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。
3、基金管理人关于内部控制的声明
（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
（2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

二 基金托管人

（一）基金托管人基本情况
名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军
（二）主要人员情况
截至2013年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工163人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
（三）基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年3月，中国工商银行共托管证券投资基金305只，其中封闭式10只，开放式295只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的37项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。
（四）基金托管人的内部控制制度
中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011年五次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。
1、内部风险控制目标
保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。
2、内部风险控制组织结构
中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。
3、内部风险控制原则
（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。
（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。
（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。
（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。
4、内部风险控制措施实施
（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。
（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。
（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。
（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。
（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。
（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。
（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。
5、资产托管部内部风险控制情况
（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。
（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。
（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。
6、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
根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议，上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。
基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。三 相关服务机构

（一）一级代办券商
1)长城证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：广东省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）83515567
客服电话：（0755）33680000、400-6666-888
公司网址：www.cgws.com
2)长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：（027）65799999
传真：（027）85481900
客服电话：95579或4008-888-999
公司客服网址：www.95579.com
3)东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼21-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：（021）63325888
传真：（021）63327888
客服电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn
4)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
办公地址：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
联系人：梁旭
电话：（0519）88157761
传真：（0519）88157761
客服电话：400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn
5)东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区翠园路181号商旅大厦
办公地址：江苏省苏州市工业园区翠园路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
公司网址：www.dwjq.com.cn
6)方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：郭军瑞
电话：（0731）85832503
传真：（0731）85832214
客服电话：95571
公司网址：www.foundersc.com
7)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
电话：（021）22169999
传真：（021）22169134
客服电话：95525
公司网址：www.ebscn.com
8)广发证券股份有限公司
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：广州市天河北路183号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：（020）87555888
传真：（020）87555305
客服电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn
9)国都证券有限责任公司
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
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
联系人：黄静
电话：(010)84183333
传真：（010）84183311-3389
客服电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com
10)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：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：万建华
联系人：芮敏祺
电话：（021）38676666
传真：（021）38670666
客服电话：95521
公司网址：www.gtja.com
11)国信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：（0755）82130833
传真：（0755）82133302
客服电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn
12)国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：李蔡
电话：（0551）2207939
传真：（0551）2645709
客服电话：95578
公司网址：www.gyzq.com.cn
13)海通证券股份有限公司
注册地址：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：金芸、李笑鸣
客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com
14)宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：（010）88085858
传真：（010）88085195
客服电话：400-800-0562
公司网址：www.hysec.com
15)华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：孔晓君
电话：（0755）82569143
传真：（0755）82492962
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn
16)华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
法定代表人：洪家新
联系人：程学军
电话：（021）64379456
传真：（021）64333051
客服电话：021-32109999、029-68918888
公司网址：www.cfsc.com.cn
17)平安证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：（0755）22626391
传真：（0755）82400862
客服电话：95511*8
公司网址：stock.pingan.com
18)齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号23层
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
公司网址：www.qlzq.com.cn
19)山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：（0351）8686659
传真：（0351）8686619
客服电话：400-666-1618、（0351）95573
公司网址：www.i618.com.cn
20)上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号华旭大厦
办公地址：上海市西藏中路336号华旭大厦
法定代表人：郁忠民
联系人：张瑾
电话：（021）53519888
传真：（021）53519888
客服电话：400-891-8918、（021）962518
公司网址：www.962518.com
21)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
联系人：李清怡
电话：（021）54041654
传真：（021）54038844
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.sywg.com
22)西南证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：张煜
电话：（023）63786141
传真：（023）63810422
客服电话：400-809-6096
公司网址：www.swsc.com.cn
23)湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
电话：（021）68634518
传真：（021）68865680
客服电话：400-888-1551
公司网址：www.xcsc.com
24)兴业证券股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼
法定代表人：兰荣
联系人：雷宇钦
电话：（0591）38507679
客服电话：400-888-8123
公司网址：www.xyzq.com.cn
25)招商证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：广东省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
联系人：林生迎
电话：（0755）82960223
传真：（0755）82960141
客服电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn
26)浙商证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人：吴承根
联系人：李凌芳
电话：（021）64718888
传真：（0571）87901913
客服电话：（0571）967777
公司网址：www.stocke.com.cn
27)中国银河证券股份有限公司
注册地址：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：陈有安
联系人：田薇
电话：（010）66568430
传真：（010）66568990
客服电话：400-888-8888
公司网址：www.chinastock.com.cn
28)中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人：李剑阁
联系人：罗文雯
电话：（021）58763575
传真：（021）68875123
客服电话：（021）58796226-3736
公司网址：www.cicc.com.cn
29)中国中投证券有限责任公司
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-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层?
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
电话：（0755）82023442
传真：（0755）82026539
客服电话：400-600-8008
公司网址：www.china-invs.cn
30)中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：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
联系人：王霈霈
电话：（0571）87112507
传真：（0571）85783771
客服电话：（0571）96598
公司网址：www.bigsun.com.cn
31)中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市安立路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
联系人：权唐
电话：400-8888-108
传真：（010）65182261
客服电话：400-888-8108
公司网址：www.csc108.com
32)中信万通证券有限责任公司
注册地址：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(266061)
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(266061)
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：（0532）85022326
传真：（0532）85022605
客服电话：（0532）96577
公司网址：www.zxwt.com.cn
33)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
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
联系人：腾艳
电话：（010）60838888
传真：（010）60833739
客服电话：95558
公司网址：www.cs.ecitic.com
34)中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
联系人：程月艳、耿铭
电话：（0371）65585670
传真：（0371）65585665
客服电话：（0371）967218
公司网址：www.ccnew.com
35)华创证券有限责任公司
注册地址：贵州省贵阳市中华北路216号华创大厦
办公地址：贵州省贵阳市中华北路216号华创大厦
法定代表人：陶永泽
联系人：李宁
电话：（021）60762732
传真：
客服电话：0851-960872
公司网址：www.hczq.com
36)首创证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街115号
办公地址：北京市西城区德胜门外大街115号
法定代表人：吴涛
联系人：刘宇
电话：（010）59366070
传真：(010)59366281
客服电话：400-620-0620
公司网址：www.sczq.com.cn
37)西藏同信证券有限责任公司
注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号
办公地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号
法定代表人：贾绍君
联系人：王钧
电话：（021）36533017
传真：（021）36533017
客服电话：400-881-1177
公司网址：www.xzsec.com
（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
法定代表人：金颖
联系人：郑奕莉
电话：（021）58872935
传真：（021）68870311
（三）律师事务所和经办律师
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
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：秦悦民、王利民
（四）会计师事务所和经办注册会计师
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1233号汇亚大厦1604-1608室
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
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：谢瀚文
经办注册会计师：薛竞、王灵

四 基金的名称

华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金

五 基金的类型

股票型指数证券投资基金

六 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。

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。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八 基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（一）、决策依据
有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。
（二）、投资管理体制
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。
（三）、投资程序
研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。
1、研究：依托公司整体研究平台，数量分析师整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。
2、投资决策：投资决策委员会依据数量分析师提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。
3、组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。
4、交易执行：集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。
5、投资绩效评估：数量分析师定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。
6、组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。
基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。
（四）、投资组合管理
为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以全部或接近全部的基金资产，按照标的指数的权重比例分散投资于各成份股。正常情况下，本基金的股票投资不低于基金资产净值的95%。本基金将在基金合同生效之日起3个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。
正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按目标指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用优化方法作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。
1、投资组合的建立
基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。
（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。
（2）确定建仓策略：基金管理人根据对成份股基本面趋势和流动性的分析，确定合理的建仓策略。
（3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。
2、每日投资组合管理
（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，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，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。
（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。
（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。
（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。
（5）组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。
（6）以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，考虑T日将会发生的上市公司变动等情况，设计T日申购、赎回清单并公告。
3、定期投资组合管理策略
（1）每季度进行基金收益评估
基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，方可对超额收益部分进行分配；
本基金将根据基金收益评估的结果和支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行现金支付的准备。
（2）每月进行基金费用支付
每月末，本基金将根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。
（3）成份股更新
当成份股发生更新时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，并依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
（4）定期投资组合监控
每周末，数量分析师对本基金的运作情况进行量化评估，提交评估报告；
每季末，基金经理团队将根据评估报告，向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报，季报将对以下问题进行分析和说明：
对该季的投资操作、基金组合状况以及跟踪误差进行基本陈述，并重点对出现较大跟踪偏离的情况予以说明；
现金控制情况；
成份股更新期的策略；
成份股未来变化预测等。
投资决策委员会将根据本基金的投资运作季报，对下一阶段的投资操作提出建议和指导。
在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）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，基金管理人应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

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

本基金的标的指数为沪深300指数。

沪深300指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深300的价格指数。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，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，并在通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案且在指定媒体上刊登公告。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

本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

十一 基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2013年3月31日。
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	15,377,531,421.99	99.13
	其中：股票	15,377,531,421.99	99.13
2	固定收益投资	47,664,000.00	0.31
	其中：债券	47,664,000.00	0.31
	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	65,815,780.75	0.42
6	其他资产	21,653,040.85	0.14
7	合计	15,512,664,243.59	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末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	92,982,698.21	0.60
B	采掘业	1,365,298,730.32	8.83
C	制造业	5,417,389,154.33	35.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	440,847,491.64	2.85
E	建筑业	540,765,086.84	3.50
F	批发和零售业	383,977,902.58	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	385,370,949.21	2.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	276,419,820.91	1.79
J	金融业	5,259,782,267.97	34.02
K	房地产业	819,035,911.07	5.30
L	租赁和商务服务业	84,105,383.80	0.54
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	90,450,166.77	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	30,859,793.49	0.20
S	综合	190,246,064.85	1.23
	合计	15,377,531,421.99	99.46

3、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

代码	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	67,167,187	647,491,682.68	4.19
2	600036	招商银行	42,679,410	539,040,948.30	3.49
3	601318	中国平安	10,076,386	420,890,643.22	2.72
4	601166	兴业银行	22,882,303	395,863,841.90	2.56
5	600000	浦发银行	33,805,717	342,451,913.21	2.21
6	000002	万 科A	29,262,944	314,869,277.44	2.04
7	601328	交通银行	59,291,702	279,263,916.42	1.81
8	600030	中信证券	21,008,366	255,671,814.22	1.65
9	600837	海通证券	24,672,910	249,443,120.10	1.61
10	601088	中国神华	9,976,834	217,295,444.52	1.41

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注：本基金本报告期末未持有债券。
5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
注：本基金本报告期末未持有债券。
6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
8、投资组合报告附注
（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。
9、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,674,589.07
2	应收证券清算款	19,723,126.69
3	应收股利	–
4	应收利息	29,297.89
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	226,027.20
8	其他	–
9	合计	21,653,040.85

10、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

十二 基金的业绩

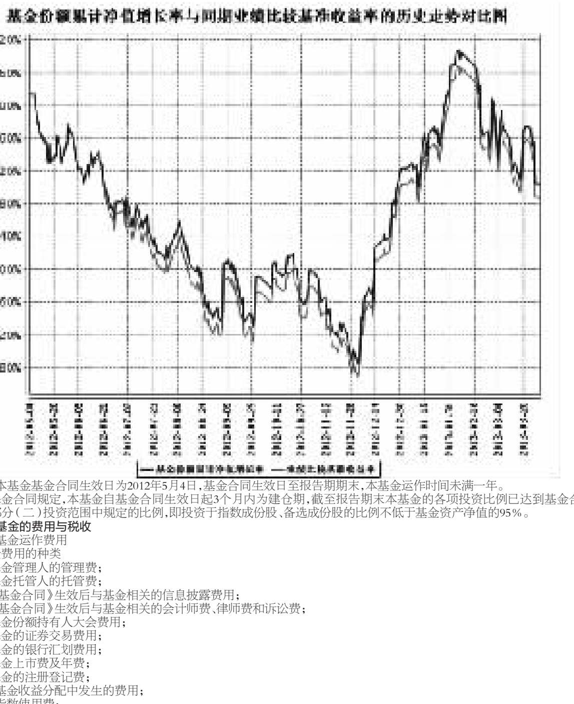
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2013年3月31日。

1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
成立至2012年12月31日	-5.03%	1.19%	-6.26%	1.20%	1.23%	-0.01%
过去三个月	-1.22%	1.55%	-1.10%	1.56%	-0.12%	-0.01%

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同生效日为2012年5月4日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三部分（二）投资范围中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

十三 基金的费用与税收

（一）基金运作费用
1、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》生效后与基金相关的信息披露费用；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券交易费用；
（7）基金的银行汇划费用；
（8）基金上市费及年费；
（9）基金的注册登记费；
（10）基金收益分配中发生的费用；
（11）指数使用费；
（12）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
2、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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.10%÷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
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
（3）指数使用费
本基金的指数使用费即指数许可使用基点费，收取标准为基金资产净值的0.03%，许可使用基点费的收取下限为每季人民币伍（5）万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。计算方法如下：
H ＝ E×0.03%÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用基点费
E为前一日的基金资产净值
指数使用费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
上述一、基金费用的种类中的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
3、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
（1）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；
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
（3）《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
4、费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
（二）基金销售费用
本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（八）投资人对基金份额的认购”中的相关规定。
本基金申购费、赎回费的费率水平、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十、基金份额的申购赎回”中的“（六）申购、赎回的对价、费用”中的相关规定。
（三）基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：
1、“三、基金管理人”部分，对董事会成员、监事会成员的相关信息作了更新。
2、“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
3、“五、相关服务机构”部分，更新了一级代办券商的相关信息。
4、“十二、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
5、“十三、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
6、“二十五、其他应披露事项”部分，根据前次招募说明书（更新）公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一三年六月十五日