

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
更新的招募说明书

(2007 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇〇七年五月

重要提示

上证180交易型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2006年2月22日证监基金字[2006]30号文批准募集。本基金基金合同自2006年4月13日正式生效。

基金管理人保证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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2007年4月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2007年3月31日（未经审计）。

目 录

一、绪言	1
二、释义	2
三、基金管理人.....	7
(一) 基金管理人概况.....	7
(二) 注册资本和股权结构.....	7
(三) 主要人员情况.....	7
(四) 基金管理人的职责.....	10
(五) 基金管理人的承诺.....	11
(六) 基金管理人的内部控制制度.....	12
四、基金托管人.....	16
(一) 基金托管人情况.....	16
(二) 基金托管人的内部控制制度.....	17
(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.....	18
五、相关服务机构.....	19
(一) 基金份额发售机构.....	19
(二) 登记结算机构.....	26
(三) 律师事务所和经办律师.....	26
(四) 会计师事务所和经办注册会计师.....	27
六、基金的募集.....	28
七、基金合同的生效.....	29
八、基金份额折算与变更登记.....	30
九、基金份额的交易.....	31
(一) 基金上市.....	31
(二) 基金份额的上市交易.....	31
(三) 基金份额参考净值的计算与公告.....	31
(四) 终止上市交易.....	31
十、基金份额的申购与赎回.....	33
(一) 申购和赎回场所.....	33
(二) 申购和赎回的开放日及时间.....	33
(三) 申购和赎回的数额限制.....	33
(四) 申购和赎回的原则.....	33
(五) 申购和赎回的程序.....	34
(六) 申购、赎回的对价和费用.....	34
(七) 申购、赎回清单的内容与格式.....	35
(八) 暂停申购、赎回的情形.....	42
(九) 集合申购与其他服务.....	42

十一、基金的投资	43
(一) 投资目标.....	43
(二) 投资理念.....	43
(三) 投资范围.....	43
(四) 投资策略.....	43
(五) 投资组合管理.....	44
(六) 业绩比较基准.....	46
(七) 风险收益特征.....	46
(八) 投资限制.....	46
(九) 基金的融资.....	47
(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法.....	47
(十一) 基金投资组合报告.....	48
十二、基金的业绩	51
(一) 基金净值表现.....	51
十三、基金的财产	52
(一) 基金资产总值.....	52
(二) 基金资产净值.....	52
(三) 基金财产的账户.....	52
(四) 基金财产的处分.....	52
十四、基金资产的估值	53
(一) 估值日.....	53
(二) 估值方法.....	53
(三) 估值对象.....	54
(四) 估值程序.....	54
(五) 基金净值的确认.....	54
(六) 估值错误的处理.....	54
(七) 暂停估值的情形.....	55
(八) 特殊情况的处理.....	55
十五、基金的收益与分配	56
(一) 基金收益的构成.....	56
(二) 基金净收益.....	56
(三) 收益分配原则.....	56
(四) 基金收益分配数额的确定原则.....	56
(五) 基金收益分配方案.....	57
(六) 基金收益分配方案的确定、公告与执行.....	57
十六、基金的费用与税收	58
(一) 基金运作费用.....	58
(二) 基金销售费用.....	58
(三) 不列入基金费用的项目.....	59
(四) 基金税收.....	59

十七、基金的会计与审计	60
(一) 基金会计政策.....	60
(二) 基金的审计.....	60
十八、基金的信息披露	61
(一) 招募说明书.....	61
(二) 基金合同、托管协议.....	61
(三) 基金份额发售公告.....	61
(四) 基金合同生效公告.....	61
(五) 基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告.....	61
(六) 基金开始申购、赎回公告.....	62
(七) 基金份额上市交易公告书.....	62
(八) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告.....	62
(九) 申购、赎回清单.....	62
(十) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告.....	62
(十一) 临时报告与公告.....	63
(十二) 澄清公告.....	63
(十三) 基金份额持有人大会决议.....	64
(十四) 中国证监会规定的其他信息.....	64
(十五) 信息披露文件的存放与查阅.....	64
十九、风险揭示	65
(一) 市场风险.....	65
(二) 管理风险.....	65
(三) 流动性风险.....	65
(四) 技术风险.....	65
(五) 基金投资组合收益与标的指数收益偏离的风险.....	65
(六) 标的指数变更的风险.....	66
(七) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险.....	66
(八) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险.....	66
(九) 退市风险.....	66
(十) 投资人申购失败的风险.....	67
(十一) 投资人赎回失败的风险.....	67
(十二) 基金份额赎回对价的变现风险.....	67
(十三) 第三方机构服务的风险.....	67
(十四) 不可抗力.....	67
(十五) 声明.....	67
二十、基金合同的终止与基金财产清算	69
(一) 基金合同的终止.....	69
(二) 基金财产清算小组.....	69
(三) 基金财产清算程序.....	69
(四) 清算费用.....	70
(五) 基金清算剩余财产的分配.....	70
(六) 基金财产清算的公告.....	70



(七) 基金财产清算帐册及文件的保存.....	70
二十一、基金合同的内容摘要.....	71
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	83
二十三、对基金份额持有人的服务.....	89
二十四、其他应披露事项.....	90
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	92
二十六、备查文件.....	93

一、绪言

《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定以及《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本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合同当事人之间权利、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》、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。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：指上证 180 交易型开放式指数证券投资基金；
- 基金管理人或本基金管理人：指华安基金管理有限公司；
- 基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司；
- 基金合同：指《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
- 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：指《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及基金管理人对其定期作出的更新。招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每 6 个月更新 1 次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日；
- 基金份额发售公告：指《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》；
- 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订；
- 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》；
- 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》；
- 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》；

- 交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；
- 基金合同当事人：指受基金合同约束，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：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人；
- 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；
- 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称；
- 基金份额持有人：指依基金合同或招募说明书合法取得基金份额的投资人；
- 发售代理机构：指基金管理人指定的，在本基金认购期间代理本基金发售业务的机构；
- 发售协调人：指基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构；
- 申购赎回代理券商：指基金管理人指定的，在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司；
- 销售代理机构：指发售代理机构和申购赎回代理券商；
- 登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司；
- 登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务；
- 募集期：指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月的期间；
- 基金合同生效日：指基金募集期结束后达到基金合同生效条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期；

- 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 工作日：指上海证券交易所的正常交易日；
- T日：指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
- 开放日：指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- 日/月：指公历日/月；
- 认购：指在本基金募集期内，投资人申请购买本基金基金份额的行为，投资人可以现金或股票方式申请认购；
- 申购：指在基金合同生效后，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
- 申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
- 申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 赎回对价：指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
- 标的指数：指上海证券交易所编制并发布的上证180指数及其未来可能发生的变更；
- 抽样复制：指按一定标准选取部分标的指数成份股，并通过定量优化方法，确定各组合证券的权重，以使组合表现紧密跟踪标的指数表现的指数模拟方法；
- 现金替代：指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
- 现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
- 最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金

- 份额应为最小申购、赎回单位的整数倍；
- 基金份额参考净值：指上海证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV；
- 预估现金部分：指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额；
- 元：指人民币元；
- 指定交易：指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”；
- 基金份额折算：指本基金建仓结束后，基金管理人根据基金合同规定将投资人的基金份额进行变更登记的行为；
- 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
- 收益评价日：指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之日，本基金收益评价日为每年 3 月 1 日、5 月 1 日、9 月 1 日和 11 月 1 日，收益评价日如恰逢节假日，则自动顺延至下一工作日；
- 基金累计报酬率：指收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；
- 标的指数同期累计报酬率：指收益评价日标的指数收盘值与基金份额折算日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%；
- 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息以及其他资产的价值总和；
- 基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值；
- 基金资产估值：指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；
- 基金份额净值：指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点第四位四舍五入，因此导致的损益归入基金财产，国家另有规定的，从其规定；
- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
- 不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全



部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 38 楼
- 3、设立日期：1998 年 6 月 4 日
- 4、法定代表人：王成明
- 5、办公地址：上海浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
- 6、联系电话：021-58881111
- 7、联系人：冯颖

(二) 注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5 亿元人民币
- 2、股权结构：

持股单位	持股占总股本比例
上海电气（集团）总公司	20%
上海国际信托投资有限公司	20%
上海广电（集团）有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
上海沸点投资发展有限公司	20%

(三) 主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

(1) 董事会：

徐建国先生，研究生学历，高级经济师及上海财经大学兼职教授。历任上海日用化学工业公司副经理，上海市轻工业局局长助理、副局长、党委书记，上海市经济委员会副主任，上海市宝山区区长，上海市黄浦区区长，上海市人民政府副秘书长、上海市经济委员会主任，现任上海电气（集团）总公司董事长。

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海申信进出口公司副经理，上海国际信托投资公司公关部科长、驻德国汉堡办事处总代表、AIT 公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理、上海国际信托投资有限公司副总经理，现主持华安基金管理有限公司日常工作。

辜昌基先生，大专学历，高级工程师。历任上海合成纤维研究所副科长，中石化上海石化总厂涤纶厂总工程师、厂长助理，中石化上海石化股份公司副总经理，中石化上海金山实业公司总经理，上海市经委副主任，现任上海工业投资（集团）有限公司董事长。

万才华先生，大专学历，经济师。历任中国农业银行上海市分行川沙支行营业部职员，浦东花木信用社信贷组长，浦东洋泾信用社副主任，中国农业银行上海市分行陆家嘴支行营业部副行长，中国农业银行上海市分行金桥支行副行长，兴业银行上海分行浦东支行行长，现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

顾培柱先生，大专学历，高级经济师。历任上海电子管二厂车间副主任，上海电子管厂副科长、办公室主任，上海电子管六厂、二厂厂长、副厂长，上海灯泡厂厂长，上海真空电子器件股份有限公司常务副总经理、副董事长、董事长，上海广电（集团）有限公司副总裁兼上海广电电子股份有限公司董事长、上海广电 NEC 液晶显示器有限公司董事长，现任上海广电（集团）有限公司总裁。

独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。现任全国政协委员，政协经济委员会委员，北京大学经济学院教授，博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市，武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生，研究生学历，教授。历任上海财经大学科研处处长，上海财经大学南德管理学院院长，上海财经大学常务副校长，现任上海国家会计学院院长、党委书记，APEC 金融与发展项目执行秘书处秘书长，兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2) 监事会：

谢伟民先生，研究生学历，副教授。历任上海市城建沪南工务所干部，空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师，上海市计委直属机关党委干事，中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员（副处级）、副处长，中共上海市金融工作党委组织处（宣传处）副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记（正处级）。

陈涵女士，研究生学历，经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长，现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生，研究生学历，高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长，上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长，上海电气（集团）总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

徐丹女士，研究生学历，高级会计师，中国注册税务师。历任上海石化总厂计财处会计、财务副科长，中石化上海金山实业公司财务处副处长，上海金山实业投资发展有限公司总会计师兼财务部主任，上海金山区财政局副局长，中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实华经济发展公司财务部经理，现任上海工业投资（集团）有限公司总会计师。

戴金宝先生，研究生学历，高级经济师。历任上海无线电三厂供销科科员，上海无线电二厂设计科设计师、党委书记助理、纪委书记，上海广电股份有限公司（原上海广播电视集团公司）组织部长、办公室主任、董事会秘书处主任，现任上海广电（集团）有限公司战略发展部经理。

蒋位先生，研究生学历，经济师。曾在上海财经大学任讲师，上海市发展计划委员会工作，现任上海沸点投资发展有限公司投资部高级经理。

孙志方先生，研究生学历，经济师。曾在上海国际信托投资公司综合研究室、法律顾问室、证券投资信托部工作，历任华安基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理、研究发展部总监、全球投资部总监。

（3）高级管理人员：

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海申信进出口公司副经理，上海国际信托投资公司公关部科长、驻德国汉堡办事处总代表、AIT 公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理、上海国际信托投资有限公司副总经理，现主持华安基金管理有限公司日常工作。

邵杰军先生，研究生学历，14 年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理，现任华安基金管理有限公司副总经理。

李炳旺先生，研究生学历，20 年基金业工作经验。曾任国际证券投资信托公司资讯暨注册登记部主管、怡富证券投资信托公司注册登记与 IT 资讯部主管、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生，研究生学历，21 年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监，现任华安基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

卢赤斌先生，硕士学位，8 年证券从业经历。1998 年至 2004 年曾先后在美国先锋证券公司（The Vanguard Group）投资系统部和股票基金管理部工作，参与负责公司证券管理系统的研发和协助基金经理管理本公司主要股票指数基金的运作。2004 年 7 月加入华安基金管理有限公司，在基金投资部从事交易型开放式指数证券投资基金的研发工作。

刘璿女士，管理学硕士，6 年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001 年 5 月加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问，专户理财部客户主管，2005 年 10 月转入基金投资部协助基金经理日常工作。

3、本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

王国卫先生，总经理助理、基金投资部总监

孙志方先生，总经理助理、研究发展部总监、全球投资部总监

陆敏慧女士，固定收益部副总监

诸 慧女士，集中交易部副总监

上述人员之间不存在亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

公司目前共有员工 153 人（44.4%以上具有硕士以上学历），主要来自国内外证券公司等金融机构，其中 80%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成，其中投资与研究、后台支持二个板块由曾在国际著名金融企业从业十年以上、经验丰富的海归专业人士领军。

（四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者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、编制中期和年度基金报告；
- 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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规行为的发生；

3、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）泄露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）除为基金管理人进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

5、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、代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

(3) 不泄露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) 除为基金管理人进行基金投资外，不直接或间接进行其他股票交易，也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六) 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

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、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。

2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

- (1) 董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。
- (2) 监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。
- (3) 督察长：督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。
- (4) 风险控制委员会：风险控制委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是评估监察稽核部提交的重要事项，如新产品的推出、新业务流程的建立、原先业务流程的重大改变、交易对手的选择、新托管机构和代销机构的引进等。
- (5) 监察稽核部：监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，向公司风险控制委员会和总经理报告。
- (6) 各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

4、基金管理人内部控制五要素

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、内部监控。

(1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的^{基础}，包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、

员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来，通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识，致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设，建立了公司内部控制体系。

（2）风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查，发现风险，将风险进行分类、按重要性排序，找出风险分布点，分析其发生的可能性及对目标的影响程度，评估目前的控制程度和风险高低，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后，确定应进一步采取的对应措施，对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善，并监督各个环节的改进实施。

（3）控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中，也得到了一贯的实施。主要包括：组织结构控制、操作控制、会计控制、信息沟通、内部监控。

①组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工，及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成权责分明、严格有效的三道监控防线：

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督和检查的责任。

以监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

②操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

③会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；会计账务的组织 and 处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

④信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司各级管理人员和员工可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

⑤内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查。检验其是否符合设计要求，并及时地充实和完善，反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势，确保内控制度的有效性。

5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：HK0939）于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。截至 2006 年 6 月 30 日止，中国建设银行总资产为人民币 51,662.42 亿元，客户存款为人民币 44,915.66 亿元，2006 年上半年实现税前利润人民币 328.14 亿元。中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。2006 年 8 月 24 日，中国建设银行在香港与美国银行签署协定，收购美国银行在香港的全资子公司美国银行（亚洲）股份有限公司 100% 的股权。中国建设银行在《银行家》2006 年公布的全球银行按一级资本排名中，名列中国银行业榜首，在世界大银行中列第 11 位。中国建设银行在《福布斯》2006 年全球领先企业榜中为第 65 名，列中国第二位。在《亚洲周刊》2006 年 7 月公布的亚洲银行 300 强排名中，中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位，

被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外，在 2006 年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中，中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司管治”、“最佳派息承诺”排行榜。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队等 8 个职能处室，现有员工 80 余人。

2、主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部工作，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2006 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰等 11 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华一道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板 ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长等 44 只开放式证券投资基金。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，直接负责风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、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

1、监督方法

依照《证券投资基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作，。利用自行开发的“证券投资基金托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

每日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，及时提醒基金管理人；发现异常情况，与基金管理人进行情况核实后，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资用途及费用等内容进行合法合规性监督。

根据基金投资运作监督情况，编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作进行合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、申购赎回代办证券公司（简称：一级交易商）：

（1）国泰君安股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818

传真：021-62583439

联系人：芮敏祺

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（2）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：谢平

电话：021-54033888

传真：021-64738844

联系人：王序微

客服电话：021-962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

（3）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

传真：021-53858549

联系人：金芸

客服电话：021-962503

公司网址：www.htsec.com

（4）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

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

客服电话：4008888111；0755-26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(5) 长江证券有限责任公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：明云成

联系人：毕艇

电话：027-65799560

传真：027-85481532

客服电话：4008888999

公司网址：www.cz318.com.cn

(6) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦 15 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦 15 楼

法定代表人：王明权

电话：021-68816000-1587

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客服电话：10108998

公司网址：www.ebscn.com

(7) 广发证券有限责任公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

客服电话：020-87555888

公司网址：www.gf.com.cn

(8) 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

法定代表人：朱利

电话：010-66568613；66568587

传真：010-66568536

联系人：郭京华

客服电话：010-68016655

公司网址：www.chinastock.com.cn

(9) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路 111 号

办公地址：上海市临平北路 19 号

法定代表人：蒋元真

电话：021-65076608-557

传真：021-65213164

联系人：刘永

客服电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

(10) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京市新源南路 6 号京城大厦 3 楼

法定代表人：王东明

电话：010-84864818-63266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

客服电话：010-84588266

公司网址：www.ecitic.com

(11) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市市南区东海西路 28 号

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85023905

传真：0532-85023905

联系人：李锦

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(12) 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：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：010-65183888

传真：010-65182261

联系人：魏明

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

(13) 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：汪建熙

电话：021-58400833

传真：021-68875123

联系人：王欢

客服电话：021-58796226-3670

公司网址：www.cicc.com.cn

(14) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

电话：025-83367888-4101

传真：025-83364032

联系人：胥春阳

客服电话：025-83364032

公司网站：www.njzq.com.cn

（15）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：叶黎成

电话：0755-82450826

传真：0755-82433794

联系人：余江

客服电话：95511

公司网站：www.pa18.com

（16）中原证券有限责任公司

注册地址：许昌市南关大街 38 号

办公地址：郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 10 楼

法定代表人：张建刚

电话：0371-65585610

传真：0371-65585665

联系人：梁锦宝

客服电话：0371-967218

公司网址：www.ccnew.com

（17）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼

办公地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人：王益民

电话：021-62568800-3003

传真：021-62569651

联系人：吴宇

客服电话：021-962506

公司网址: www.dfzq.com.cn

(18) 东海证券有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延龄路常信大厦 18、19 楼

办公地址: 上海市东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人: 顾森贤

电话: 021-50588876

传真: 021-50585607

联系人: 龙涛

客服电话: 0519-8166222

公司网址: www.longone.com.cn

(19) 华泰证券有限责任公司

注册地址: 南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址: 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: 025-84457777-721

传真: 025-84579879

联系人: 袁红彬

客服电话: 025-84579897

公司网址: www.htsc.com.cn

(20) 国信证券有限责任公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人: 何如

电话: 0755-82133066

传真: 0755-82133302

联系人: 林建闽

客服电话: 8008108868

公司网址: www.guosen.com.cn

(21) 国海证券有限责任公司

注册地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅锋

电话：0771-96100；0755-82485852

传真：0755-82485852

联系人：徐伟平

客服电话：4008888100

公司网址：www.ghzq.com.cn

（22）德邦证券有限责任公司

注册地址：辽宁省沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 层

法定代表人：王军

电话：021-68590808-8125

传真：021-68596077

联系人：罗芳

客服电话：021-68590808-8119

公司网址：www.tebon.com.cn

（23）联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、25 层

法定代表人：王政

电话：0755-82492000

传真：0755-82492062

联系人：范雪岭

客服电话：4008888555，0755-25125666

公司网址：www.lhzq.com

（24）广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

法定代表人：王比

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(25) 信泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市长江路 88 号

法定代表人：钱凯法

电话：025-84784782

传真：025-84784741

联系人：舒萌菲

公司网址：www.thope.com

(26) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号

法定代表人：汤世生

电话：010-62267799

传真：010-62294470

联系人：丁伟

公司网址：www.ehongyuan.com.cn

2、二级市场交易代办证券公司

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。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

(二) 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

传真：021-68870311

(三) 律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 21 楼

负责人：韩炯

电话：（021）68818100

传真：（021）68816880

联系人：秦悦民

经办律师：秦悦民、傅轶

（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

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号

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）61238888

传真：（021）61238800

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：汪棣、薛竞

六、基金的募集

上证 180 交易型开放式证券投资基金由华安基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2006 年 2 月 22 日证监基金字[2006]30 号文批准。

本基金为交易型开放式，基金存续期间为不定期。

本基金的募集方式有网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

本基金的募集对象为中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外），以及合格境外机构投资者。

本基金募集期间每份基金份额面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

本基金自 2006 年 3 月 9 日至 2006 年 4 月 6 日进行发售。

七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效的条件，基金合同自 2006 年 4 月 13 日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

八、基金份额折算与变更登记

根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定 2006 年 5 月 10 日为上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2919.214 点，基金资产净值为 1,167,168,017.51 元，折算前基金份额总额为 1,072,822,105 份，折算前基金份额净值为 1.088 元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.37268313，折算后基金份额总额为 399,822,674 份，折算后基金份额净值为 2.919 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 5 月 11 日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法计算保留到整数位。

投资者可以自 2006 年 5 月 12 日起在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额。

九、基金份额的交易

（一）基金上市

根据有关规定，本基金基金合同生效后，具备上市条件，于2006年5月18日起在上海证券交易所上市交易。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海、深圳证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定，包括但不限于：

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍，不足100份的部分可以卖出；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元；
- 5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

（三）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，上海证劵交易所开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购、赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中可以用现金替代成份股的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份股的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

3、上海证券交易所可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

（四）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金份额的上市交易，

并报中国证监会备案：

- 1、不再具备《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

十、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理券商办理基金申购赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

本基金在基金份额折算日之后、基金上市交易之前可开始办理申购。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购。

本基金已于 2006 年 5 月 18 日起，开始办理申购、赎回业务。

2、开放日及开放时间

投资人可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

（三）申购和赎回的数额限制

投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为 30 万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改的 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（四）申购和赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

基金管理人在不损害基金份额持有人利益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日的 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回申请的提出

投资人须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资人申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资人提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资人可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询确认情况。

3、申购和赎回的清算交收与登记

投资人T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资人办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购、赎回的对价和费用

1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购、赎回份额的0.5%收取申购、赎回佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

4、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数。

（七）申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券最新价格 × (1 + 现金替代溢价比例)

其中，“最新价格”的确定原则为：

- （i）该证券正常交易时，采用最新成交价；
- （ii）该证券正常交易中出現涨停时，采用涨停价格；
- （iii）该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；
- （iv）该证券停牌且当日无成交时，采用经除权调整后的一前一交易日收盘价。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如

果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将已收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特例情况：若在 T 日后，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日后第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例 (\%)} = \frac{\sum \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券最新价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{最新基金份额参考净值 (IOPV)}} \times 100\%$$

(3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证

券的数量乘以其 T 日预计开盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

$T \text{ 日预估现金部分} = T-1 \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日预计开盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日预计开盘价相乘之和})$

其中，T 日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和})$

T 日投资人申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2007 年 03 月 30 日
基金名称	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

基金管理公司名称	华安基金管理有限公司
一级市场基金代码	510181

2007年03月29日信息内容

现金差额（单位：元）	-6,962.07
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	1,906,755.93
基金份额净值（单位：元）	6.356

2007年03月30日信息内容

预估现金部分（单位：元）	-4,293.07
现金替代比例上限	25.00%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	300,000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
600000	浦发银行	2000	允许	10.00%	
600001	邯郸钢铁	2000	允许	10.00%	
600004	白云机场	600	允许	10.00%	
600005	武钢股份	3700	允许	10.00%	
600006	东风汽车	900	允许	10.00%	
600008	首创股份	1000	允许	10.00%	
600009	上海机场	1400	允许	10.00%	
600010	包钢股份	2800	允许	10.00%	
600011	华能国际	800	允许	10.00%	
600012	皖通高速	400	允许	10.00%	
600015	华夏银行	2000	允许	10.00%	
600016	民生银行	8400	允许	10.00%	
600018	上港集团	4900	允许	10.00%	
600019	宝钢股份	6200	允许	10.00%	
600020	中原高速	700	允许	10.00%	
600022	济南钢铁	500	允许	10.00%	
600026	中海发展	700	允许	10.00%	

600027	华电国际	1100	允许	10.00%	
600028	中国石化	4200	允许	10.00%	
600029	南方航空	0	必须		11145
600030	中信证券	2100	允许	10.00%	
600031	三一重工	200	允许	10.00%	
600033	福建高速	700	允许	10.00%	
600036	招商银行	5700	允许	10.00%	
600037	歌华有线	500	允许	10.00%	
600048	保利地产	200	允许	10.00%	
600050	中国联通	10000	允许	10.00%	
600058	五矿发展	400	允许	10.00%	
600060	海信电器	300	允许	10.00%	
600062	双鹤药业	300	允许	10.00%	
600073	上海梅林	200	允许	10.00%	
600085	同仁堂	300	允许	10.00%	
600088	中视传媒	100	允许	10.00%	
600089	特变电工	0	必须		8164
600096	云天化	300	允许	10.00%	
600098	广州控股	1000	允许	10.00%	
600100	同方股份	500	允许	10.00%	
600104	上海汽车	2300	允许	10.00%	
600110	中科英华	200	允许	10.00%	
600123	兰花科创	300	允许	10.00%	
600130	波导股份	500	允许	10.00%	
600132	重庆啤酒	100	允许	10.00%	
600138	中青旅	300	允许	10.00%	
600151	航天机电	400	允许	10.00%	
600153	建发股份	400	允许	10.00%	
600161	天坛生物	200	允许	10.00%	
600169	太原重工	300	允许	10.00%	
600171	上海贝岭	400	允许	10.00%	
600176	中国玻纤	200	允许	10.00%	
600177	雅戈尔	1300	允许	10.00%	
600183	生益科技	800	允许	10.00%	
600188	兖州煤业	700	允许	10.00%	
600196	复星医药	600	允许	10.00%	
600205	山东铝业	0	必须		5082
600210	紫江企业	1200	允许	10.00%	
600219	南山铝业	700	允许	10.00%	
600236	桂冠电力	500	允许	10.00%	
600256	广汇股份	400	允许	10.00%	
600266	北京城建	300	允许	10.00%	
600269	赣粤高速	700	允许	10.00%	

600270	外运发展	400	允许	10.00%	
600271	航天信息	100	允许	10.00%	
600289	亿阳信通	100	允许	10.00%	
600296	兰州铝业	0	必须		5844
600309	烟台万华	600	允许	10.00%	
600316	洪都航空	100	允许	10.00%	
600317	营口港	300	允许	10.00%	
600320	振华港机	1700	允许	10.00%	
600322	天房发展	400	允许	10.00%	
600331	宏达股份	300	允许	10.00%	
600333	长春燃气	300	允许	10.00%	
600348	国阳新能	300	允许	10.00%	
600350	山东高速	800	允许	10.00%	
600360	华微电子	200	允许	10.00%	
600362	江西铜业	400	允许	10.00%	
600383	金地集团	500	允许	10.00%	
600418	江淮汽车	900	允许	10.00%	
600426	华鲁恒升	200	允许	10.00%	
600428	中远航运	400	允许	10.00%	
600432	吉恩镍业	100	允许	10.00%	
600438	通威股份	200	允许	10.00%	
600456	宝钛股份	200	允许	10.00%	
600460	士兰微	200	允许	10.00%	
600472	包头铝业	300	允许	10.00%	
600475	华光股份	200	允许	10.00%	
600489	中金黄金	200	允许	10.00%	
600497	驰宏锌锗	100	允许	10.00%	
600498	烽火通信	200	允许	10.00%	
600500	中化国际	700	允许	10.00%	
600519	贵州茅台	400	允许	10.00%	
600521	华海药业	200	允许	10.00%	
600528	中铁二局	300	允许	10.00%	
600533	栖霞建设	200	允许	10.00%	
600535	天士力	200	允许	10.00%	
600547	山东黄金	100	允许	10.00%	
600550	天威保变	200	允许	10.00%	
600583	海油工程	600	允许	10.00%	
600585	海螺水泥	400	允许	10.00%	
600596	新安股份	200	允许	10.00%	
600597	光明乳业	400	允许	10.00%	
600598	北大荒	600	允许	10.00%	
600600	青岛啤酒	300	允许	10.00%	
600601	方正科技	1500	允许	10.00%	

600631	百联股份	500	允许	10.00%	
600635	大众公用	800	允许	10.00%	
600636	三爱富	200	允许	10.00%	
600639	浦东金桥	300	允许	10.00%	
600642	申能股份	1700	允许	10.00%	
600643	爱建股份	400	允许	5.00%	
600649	原水股份	900	允许	10.00%	
600660	福耀玻璃	600	允许	10.00%	
600663	陆家嘴	500	允许	10.00%	
600675	中华企业	600	允许	10.00%	
600685	广船国际	200	允许	10.00%	
600688	上海石化	1100	允许	5.00%	
600690	青岛海尔	1000	允许	10.00%	
600694	大商股份	300	允许	10.00%	
600717	天津港	900	允许	10.00%	
600739	辽宁成大	500	允许	10.00%	
600748	上实发展	300	允许	10.00%	
600754	锦江股份	300	允许	10.00%	
600770	综艺股份	200	允许	10.00%	
600779	水井坊	400	允许	10.00%	
600786	东方锅炉	200	允许	10.00%	
600787	中储股份	400	允许	10.00%	
600795	国电电力	1100	允许	10.00%	
600797	浙大网新	800	允许	10.00%	
600808	马钢股份	1100	允许	10.00%	
600811	东方集团	800	允许	10.00%	
600824	益民百货	400	允许	10.00%	
600832	东方明珠	1100	允许	10.00%	
600835	上海机电	400	允许	10.00%	
600839	四川长虹	1600	允许	10.00%	
600851	海欣股份	700	允许	10.00%	
600855	航天长峰	200	允许	10.00%	
600875	东方电机	100	允许	10.00%	
600879	火箭股份	500	允许	10.00%	
600880	博瑞传播	200	允许	10.00%	
600886	国投电力	600	允许	10.00%	
600887	伊利股份	500	允许	10.00%	
600895	张江高科	700	允许	10.00%	
600900	长江电力	3900	允许	10.00%	
600970	中材国际	100	允许	10.00%	
600997	开滦股份	300	允许	10.00%	
601006	大秦铁路	3100	允许	10.00%	
601166	兴业银行	500	允许	10.00%	

601318	中国平安	1100	允许	10.00%	
601398	工商银行	10800	允许	10.00%	
601628	中国人寿	700	允许	10.00%	
601988	中国银行	6100	允许	10.00%	

（八）暂停申购、赎回的情形

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的申购、赎回申请：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
- 2、上海证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购、赎回；
- 4、法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日报中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

（九）集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资人集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

基金管理人指定的申购、赎回代理券商可依据法律法规和基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

十一、基金的投资

（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最小化。

（二）投资理念

通过金融工程的技术和手段实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，从而以较低的成本和较低的风险获得中国资本市场的平均水平回报，并通过金融创新，满足投资人长期、短期、套利等多种投资需求。

（三）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，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，基金管理人将在十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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

（四）投资策略

本基金主要采取抽样复制的指数跟踪方法，即根据量化的选股指标，选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合，并通过优化模型确定投资组合中个股的权重，以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。投资于股票部分的基金资产将严格按照基金管理人公示的抽样复制方法所确定的成份股投资比例进行配置。通过抽样复制，剔除流动性较差的成份股，从而减少基金运行过程中可能出现的流动性风险，并有效降低基金申购及赎回的复杂程度。基金管理人将在基金募集期开始之前公示抽样复制方法，同时根据标的指数成份股的成交情况，基金管理人可对指数跟踪方法进行调整，并于方法调整前予以公示。

1、决策依据

- （1）法律法规和基金合同的有关规定；
- （2）标的指数编制、调整等相关规定，以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略。

2、决策程序

研究开发、投资决策、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) 研究开发：产品开发小组依托公司和外部独立研究机构力量，采用国际通行的指数模拟方法，并结合我国证券市场运行特征，开发上证 180 指数抽样复制策略。金融工程小组通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析，进行基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，定期撰写研究报告，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产品开发小组所开发的指数模拟策略，以及金融工程小组提供的研究报告，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，基金经理以抽样复制法构建组合。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：集中交易部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：金融工程小组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，并在基金更新的招募说明书及其更新中公告。

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) 投资组合管理

1、组合构建

基金管理人构建投资组合的过程按时间跨度可分为两个阶段，即募集期前，及募集开始至基金份额折算日。

(1) 募集期前：基金管理人根据事先确定的指数跟踪策略确定纳入目标组合的成份股，并根据市场状况及个股成交情况，运用流动性惩罚模型确定募集期内，网下股票认购中个股认购规模受限制的个股名单。

(2) 募集开始至基金份额折算日：募集开始至基金份额折算日，基金经理根据事先确定的指数跟踪策略确定目标组合内各股的权重构成，并通过对成份股流动性及证券市场交易情况的分析，确定合理的建仓策略。基金经理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、组合管理

按对组合监控、管理的频率，组合管理可分为每日组合管理，月末组合管理、半年组合管理以及不定期组合管理。

(1) 每日组合管理

- 成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪基金组合内成份股公司的行为（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。
- 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。
- 成份股流动性分析：基金经理以定量指标对成份股流动性进行分析，为确定申购、赎回清单中的现金替代部分提供决策依据。
- 成份股权重偏离分析：对投资组合成份股实际权重与指数成份股权重之间的偏离进行归因分析，为组合调整提供决策依据。
- 现金头寸分析：根据成份股信息的分析，确定 T 日基金所应持有的现金头寸。
- 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情况，构建 T 日申购、赎回清单并公告。

(2) 月末组合管理

- 根据基金合同中基金管理费、基金托管费、基金收益分配等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。
- 在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

(3) 半年组合管理（标的指数调整周期）

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成份股调整生效前，分析并确定

组合调整策略，并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

（4）不定期组合管理

若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。

3、投资绩效评估

（1）每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

（2）每月末，金融工程小组通过定量指标对投资组合与标的指数的拟合情况进行评价。

（3）每月末，基金经理根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。若本基金标的指数发生变更，则本基金业绩比较基准随之发生变化。

（七）风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

（八）投资限制

1、组合限制

依照《运作办法》，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

（1）基金财产参与股票发行申购，单只基金所申报的金额超过基金总资产，单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（2）违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；

（3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(5) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他情形。

由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、成份股价格的市场变化等基金管理人之外的因素导致基金投资不符合上述约定比例的不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到标准。

若本基金完全按照标的指数的构成比例进行投资的，则本基金不受上述第 3、4 条比例限制的约束，本基金完全按照标的指数的构成比例进行投资指本基金资产净值 95% 以上的股票投资的个股权重构成与标的指数成份股权重构成一致。日后如法律法规或中国证监会改变上述比例限制的，则本基金比例限制将进行调整。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(九) 基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对所投资公司的控股或者直接管理；
- 2、所有行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金财产的保值和增值。

(十一) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2007 年 4 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2007 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	540,066,895.82	99.49%
2	债券	0.00	0.00%
3	银行存款和清算备付金合计	2,785,035.54	0.51%
4	其他资产	1,036.96	0.00%
	合计	542,852,968.32	100.00%

2、股票投资组合

1) 指数投资按行业分类的股票投资组合

	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	2,628,326.00	0.49%
B	采掘业	30,062,344.54	5.55%
C	制造业	169,222,963.71	31.24%
	C0 食品、饮料	24,081,731.10	4.45%
	C1 纺织、服装、皮毛	6,872,185.00	1.27%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	16,377,634.92	3.02%
	C5 电子	6,510,700.65	1.20%
	C6 金属、非金属	59,821,654.88	11.05%
	C7 机械、设备、仪表	45,507,715.57	8.40%
	C8 医药、生物制品	7,209,966.56	1.33%
	C99 其他制造业	2,841,375.03	0.52%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,716,366.30	6.41%
E	建筑业	3,553,504.80	0.66%
F	交通运输、仓储业	55,378,463.74	10.22%
G	信息技术业	29,691,578.84	5.48%
H	批发和零售贸易	15,474,655.35	2.86%
I	金融、保险业	157,052,799.80	29.00%
J	房地产业	16,016,260.68	2.96%
K	社会服务业	7,883,501.60	1.46%
L	传播与文化产业	5,835,925.80	1.08%
M	综合类	12,550,204.66	2.32%
	合计	540,066,895.82	99.72%

2) 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末没有持有积极投资的股票投资组合。

3) 指数投资前五名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占资产净值比例
1	600016	民生银行	2,529,500	31,466,980.00	5.81%
2	600036	招商银行	1,772,500	30,806,050.00	5.69%
3	600030	中信证券	581,347	25,015,361.41	4.62%
4	600019	宝钢股份	1,800,002	17,820,019.80	3.29%
5	600050	中国联通	3,024,968	17,091,069.20	3.16%

4) 积极投资前五名股票明细

本基金本报告期末没有持有积极投资的股票。

3、 债券投资组合

1) 按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末没有持有债券投资。

2) 基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末没有持有债券投资。

4、 权证投资组合

本基金本报告期末没有持有权证投资。

5、 资产支持证券投资组合

本基金本报告期没有投资资产支持证券。

6、 投资组合报告附注

1) 本基金的估值方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日（或最近交易日）的市场收盘价计算，已发行未上市股票采用成本价计算，未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

2) 本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3) 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收证券清算款	0.00
2	应收利息	1,036.96
3	应收股利	0.00



合计 1,036.96

4) 处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没有持有可转换债券投资。

5) 本报告期在股权分置改革中获得的权证明细

本基金本报告期内没有在股权分置改革中获得权证。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作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。

（一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截至时间 2007 年 3 月 31 日）

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
自 2006-4-13 （合同生效日）至今	139.11%	1.79%	149.83%	1.83%	-10.72%	-0.04%
自 2006-4-13 （合同生效日）至 2006-12-31	81.63%	1.48%	87.32%	1.53%	-5.69%	-0.05%
2007-1-1 至 2007-3-31	31.64%	2.53%	33.37%	2.53%	-1.73%	0.00%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和销售代理机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十四、基金资产的估值

（一）估值日

基金合同生效后，每个工作日对基金资产进行估值。

（二）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、股票估值方法：

（1）上市流通股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、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次发行的股票，按成本价估值。

（3）配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（3）小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，如果基金管理人认为按本项第（1）—（3）小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值办法：

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

（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，按最近交易日债券收盘净价估值。

（3）未上市债券按其成本价估值。

（4）在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值。

(5) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（4）小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，如果基金管理人认为按本项第（1）—（4）小项规定的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基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人每工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（五）基金净值的确认

基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真等方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方确认的方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、

及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

差错处理的原则和方法如下：

（1）基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

（2）错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

（3）因基金份额净值计算错误，给基金财产或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿；

（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准；

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金财产相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金财产的；

5、法律法规和基金合同认定的其它情形。

（八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（4）项或债券估值方法的第（5）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算机构发送的数据错误，本基金管理人和本基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息收入；
- 2、买卖证券价差收入；
- 3、存款利息收入；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权。
- 2、基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。
- 3、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。
- 4、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，方可进行收益分配。
- 5、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配1次，最多分配4次，若自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配。每次基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配收益的100%。
- 6、本基金收益分配采取现金方式。
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配数额的确定原则

- 1、本基金收益评价日为每年3月1日、5月1日、9月1日和11月1日，收益评价日如恰逢节假日，则自动顺延至下一工作日。
- 2、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。
基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去1

乘以100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日的指数收盘价与基金份额折算日的指数收盘价之比减去1乘以100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益： $(\text{基金累计报酬率} - \text{标的指数同期累计报酬率}) \times \text{收益评价日发行在外的基金份额总额} \times \text{基金份额折算日基金份额净值}$ 。

3、计算截至收益评价日本基金的可分配收益。

4、基金收益分配数额为上述计算的基金超过标的指数的收益、本基金可分配收益中的较小值。

5、每基金份额的应分配收益为上述确定的基金收益分配数额除以收益评价日发行在外的基金份额总额，保留小数点后3位，第4位舍去。

（五）基金收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（六）基金收益分配方案的确定、公告与执行

1、基金收益分配方案由基金管理人拟定，基金托管人复核，并公告。

2、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。

十六、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1、基金管理人的管理费

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：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，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3个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告。

4、证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金分红手续费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相关合同的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售费用

申购、赎回佣金：

投资人在申购或赎回基金份额时，需按照本招募说明书第十节第（六）款的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

$$\text{申购/赎回佣金} = \text{申购/赎回份额} \times \text{申购、赎回佣金比率}$$

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资人申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。基金标的指数使用费由基金管理人承担。

（四）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十七、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

（二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后在2日内公告。

十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

（二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并至少提前3个工作日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将在3个工作日内将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

(六) 基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前的3个工作日前在指定报刊及网站上公告。

(七) 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(八) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发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；

基金管理人将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。

(九) 申购、赎回清单

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，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

(十) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

(十一) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售代理机构；
- 20、基金更换登记结算机构；
- 21、法律法规和中国证监会规定的其他事项。

(十二) 澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份

额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十三) 基金份额持有人大会决议

(十四) 中国证监会规定的其他信息

(十五) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在至少一种指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

十九、风险揭示

（一）市场风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理等市场因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（二）管理风险

基金管理人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购与赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

（三）流动性风险

在调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

（四）技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

（五）基金投资组合收益与标的指数收益偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

1、由于本基金采用抽样复制方法跟踪标的指数，基金投资组合的成份股及各成份股权重与标的指数成份股基期权重存在差异，使本基金投资组合收益与标的指数收益存在偏离。

2、由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

3、由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

5、由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6、在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

7、其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（六）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

（七）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

（八）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

（九）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

（十）投资人申购失败的风险

本基金的申购、赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

（十一）投资人赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

（十二）基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

（十三）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

1、申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。

2、登记结算机构可能调整结算制度，如对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3、证券交易所、登记结算机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

（十四）不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

（十五）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担

担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售代理机构销售，但是，本基金并不是销售代理机构的存款或负债，也没有经销售代理机构担保或者背书，销售代理机构并不能保证其收益或本金安全。

二十、基金合同的终止与基金财产清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内没有新任基金管理人承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内没有新任基金托管人承接其原有权利义务；
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他情况。

（二）基金财产清算小组

1、自基金合同终止事项发生之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

2、基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（三）基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告。

- 1、基金合同终止时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2、对基金财产进行清理和确认；
- 3、对基金财产进行估价和变现；
- 4、聘请律师事务所出具法律意见书；
- 5、聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6、将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 7、参加与基金财产有关的民事诉讼；

- 8、公布基金财产清算公告；
- 9、对基金剩余财产进行分配。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）基金清算剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（六）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

（七）基金财产清算帐册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

二十一、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

(一) 基金管理人

1、基金管理人的权利

- (1) 运用基金财产；
- (2) 获得基金管理人报酬；
- (3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (4) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金业务的规则；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (7) 选择、更换登记结算机构，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (8) 选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (10) 依法召集基金份额持有人大会；
- (11) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托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) 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；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 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管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，

不得委托第三人运作基金财产；

- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购的基金份额或赎回的股票、现金替代以及现金差额；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 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；
- (16) 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；
- (17) 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；
- (18) 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；
- (19) 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；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1、基金托管人的权利

- (1) 获得基金托管费；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关

法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

1、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权

(二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后决定，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应

当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

4、代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日的30天前在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （6）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式

- （1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、更换基金管理人或更换基金托管人、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2) 通讯方式开会

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知；

②召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

④直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符；

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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。

（六）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日的40天前提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日的30天前公告。

（3）对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合并持有权利登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日的30日前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，

确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并在公证机关监督下形成大会决议。

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%以上多数从出席会议的基金份额持有人和代理人中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。

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、住所地址、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

在通讯方式开会的情况下，首先由召集人提前30天公布提案，在所通知的表决截止日期第2天在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

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；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项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、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5、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，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名基金份额持有人代表担任监票人。

(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。

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。若基金管理人、基金托管人经通知拒绝到会的，经公证机关将拒绝到会情况记录在案的，不中断计票程序，并不影响计票结果。

(九) 基金份额持有人大会决议报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。

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日内在至少一种指定媒体公告。

三、基金合同的终止和基金财产的清算

(一) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内没有新任基金管理人承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内没有新任基金托管人承接其原有权利义务；

4、法律法规或中国证监会规定的其他情况。

（二）基金财产的清算

1、基金财产清算小组

（1）自基金合同终止事项发生之日起30个工作日内，成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

（2）基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

- （1）基金合同终止时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估价和变现；
- （4）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （7）参加与基金财产有关的民事诉讼；
- （8）公布基金财产清算公告；
- （9）对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或其他与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

二十二、基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 38 楼

办公地址：上海浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

邮政编码：200120

法定代表人：王成明

成立时间：1998 年 6 月 4 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】20 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金投资范围包括股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以上证 180 指数成份股、备选成份股为主要投资对象,投资于上证 180 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,基金管理人将在十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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

依照《运作办法》,基金管理人运用基金财产进行证券投资,不得有下列情形:

- 1、基金财产参与股票发行申购,单只基金所申报的金额超过基金总资产,单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- 2、违反基金合同关于投资范围等约定;
- 3、本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;
- 4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;
- 5、法律法规和中国证监会规定禁止的其他情形。

自基金合同生效日起,基金建仓期不超过 3 个月。由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、成份股价格的市场变化等基金管理人之外的因素导致基金投资不符合上述约定比例的不在限制之内,但基金管理人应在十个交易日内进行调整,以达到标准。

若本基金完全按照标的指数的构成比例进行投资的,则本基金不受上述第 3、4 条比例限制的约束。日后如法律法规或中国证监会改变上述比例限制的,则本基金比例限制将进行调整。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基

金托管人及时相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应向基金托管人说明理由,在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并承担交易对手不履行合同造成的损失,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、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进行监督和核查。

(六) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,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。

(七) 对基金托管人按照法规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。

(八) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,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、基金财产保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。

- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。。

- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期内，基金管理人及发售代理机构将网下发售的认购资金划入基金管理人在银行开设的基金募集专户；网上现金认购结束，登记结算机构应将网上现金认购的资金划入发售协调人在银行开设的基金募集专户；网下股票认购结束，登记结算机构应根据基金管理人提供的资料对募集的股票进行冻结。

基金募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金资金专户中，基金募集的股票存放在以基金托管人和基金联名方式开立的证券账户下。

2、若基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件，由基金管理人按规定办理募集资金的退款和募集股票的解冻事宜。

（三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

- 3、基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

（四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的交收指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代、现金差额的结算。

（八）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。

（九）与基金财产有关的重大合同的保管

基金合同和托管协议由基金管理人和基金托管人各自保管原件。在基金运作中签订的重大合同由基金管理人保管上述重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

四、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

（一）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

（二）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

本基金基金份额持有人名册由基金管理人负责提供，基金托管人按照相关规定建立并保管。在编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，由基金托管人按相关规定负责保管。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。

六、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

七、托管协议的修改与终止

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规规定的其他终止事项。

二十三、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

（一）客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值。

华安客户服务中心电话：40088-50099；021-68604666

传真：021-68862145

（二）网上客户服务中心

网上客户服务中心为投资人提供查询服务以及相互交流的平台。登录网站后，投资人可以查询基金相关资料；投资人还可以查询热点问题及其解答，加入“华安社区”进行讨论和交流，并提交投诉和建议。

公司网址：www.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

（三）客户投诉处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人提供的服务进行投诉。投资人还可以通过发售代理机构、申购赎回代理券商的服务电话对该代理机构提供的服务进行投诉。

二十四、其他应披露事项

基金管理人将根据有关规定,在基金半年度报告和年度报告中将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露,并向中国证监会报告。

1、本期公告事项

序号	公告事项	信息披露报纸名称	披露日期
1	华安基金管理有限公司临时公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年10月16日
2	华安基金管理有限公司董事会声明	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年10月16日
3	华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2006 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年10月27日
4	华安基金管理有限公司临时公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年11月7日
5	华安基金管理有限公司关于临时调整上证 180 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年11月9日
6	华安基金管理有限公司上证 180 交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年11月18日
7	华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要(2006 年第 1 号)	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年11月27日
8	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单中的成份股变更公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2006年12月29日
9	华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2006 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007年1月20日
10	华安基金管理有限公司关于临时调整上证	上海证券报、中国证券报、	2007年1月22日

	180 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告	证券时报	
11	华安基金管理有限公司关于临时调整上证180 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007 年 2 月 16 日
12	华安基金管理有限公司关于基金经理调整的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007 年 3 月 14 日
13	华安基金管理有限公司关于临时调整上证180 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007 年 3 月 15 日
14	华安基金管理有限公司关于变更董事的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007 年 3 月 22 日
15	华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2006 年年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2007 年 3 月 31 日

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人及销售代理机构营业网点的营业场所，投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

二十六、备查文件

（一）备查文件

- 1、中国证监会核准上证180交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证180交易型开放式指数证券投资基金证券登记及服务协议》
- 4、《上证180交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华安基金管理有限公司

二〇〇七年五月二十八日