上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

一、重要声明与提示

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2009年8月27日刊登于《中国证券报》、2009年8月28日刊登于《上海证券报》、2009年8月29日刊登于《证券时报》和交银施罗德基金管理有限公司网站(www.jyfund.com,www.jysld.com,www.bocomschroder.com)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称:治理ETF。
2、二级市场交易代码:510010。
3、基金申购赎回简称:治理申赎。
4、申购赎回代码:510011。
5、2009年12月8日基金份额总额:1,123,524,362份。
6、2009年12月8日基金份额净值:0.931元。
7、本次上市交易份额:1,123,524,362份。
8、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
9、上市交易日期:2009年12月15日。
10、基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司。
11、基金托管人:中国农业银行股份有限公司。
12、上市推荐人:海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司
13、申购赎回代办券商(以下简称“一级交易商”):光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、德邦证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、宏源证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、方正证券有限责任公司和东北证券股份有限公司等35家证券公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:2009年8月17日中国证监会证监许可[2009]795号文。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:本基金自2009年8月31日至2009年9月18日进行发售,其中,网下现金发售的日期为2009年8月31日至2009年9月18日,网上现金发售日期为2009年9月18日,通过发售代理机构进行网下股票认购的发售期间为2009年9月16日至2009年9月18日,通过基金管理人进行网下股票认购的发售日期为2009年9月18日。
5、发售价格:1.00元人民币。
6、发售期限:网下现金发售15个工作日,网上现金发售1个工作日,通过发售代理机构进行网下股票认购3个工作日,通过基金管理人进行网下股票认购1个工作日。
7、发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。
8、发售机构
(1)直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。
(2)代销机构

本基金的网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、德邦证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、中信证券股份有限公司和方正证券有限责任公司等证券公司。

本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的81家证券公司:爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、江南证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、联讯证券经纪有限责任公司、民生证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏证券经纪有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、信泰证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中山证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

(二)基金合同生效

截至2009年9月18日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资,本次募集确认的募集金额总额为1,009,243,480.00元人民币(含所募集股票市值),折合基金份额1,009,243,480.00份;经基金注册登记机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计40,684.00元人民币,折合基金份额40,684.00份。本次募集所有资金已于2009年9月24日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金托管专户;所募集股票已于2009年9月23日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为5,824户,按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算,本次募集期间募集金额(含所募集股票市值)和利息结转的基金份额共计1,009,284,164.00份,已全部计入相应基金份额持有人账户,归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本基金管理人的基金从业人员没有认购本基金。

根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)等法律法规以及《上证180公司治理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”或“《基金合同》”)、《上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金本次募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2009年9月25日获得中国证监会的书面确认,基金合同自该日起生效。

(三)基金份额折算

根据《上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证180公司治理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2009年12月4日为本基金的基金份额折算日,折算后的基金份额净值与基金份额折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2009年12月4日,上证180公司治理指数收盘值为938.90点,本基金资产净值为1,054,880,523.33元,折算前基金份额总额为1,009,284,164份,折算前基金份额净值为1.045元。

根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为1.11319302(以四舍五入的方法保留到小数点后8位),折算后基金份额总额为1,123,524,362份,折算后基金份额净值为0.939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上海分公司于2009年12月7日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位(小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产)。投资者可以自2009年12月8日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理,并互相核对。

(四)基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所上证债字[2009]215号。
2、上市交易日期:2009年12月15日。
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
4、基金二级市场交易简称:治理ETF。
5、二级市场交易代码:510010。
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
6、基金申购赎回简称:治理申赎。
7、申购赎回代码:510011。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、德邦证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、宏源证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、方正证券有限责任公司和东北证券股份有限公司等35家证券公司。

8、本次上市交易份额:1,123,524,362份。
9、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2009年12月8日,本基金份额持有人户数为5,824户,平均每户持有的基金份额为192,913份。
(二)持有人结构
截至2009年12月8日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为749,310,686份,占基金总份额的66.69%;个人投资者持有的基金份额为374,213,676份,占基金总份额的33.31%。
(三)前十名基金份额持有人的情况:
截至2009年12月8日。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	光大证券股份有限公司	55,669,487	4.95
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	55,668,555	4.95
3	长城证券有限责任公司	55,659,651	4.95
4	齐鲁证券有限公司	50,093,685	4.46
5	海通证券股份有限公司	44,532,173	3.96
6	东方证券股份有限公司	33,395,790	2.97
7	光大证券－光大银行－光大阳光基中宝(阳光2号二期)集合资产管理计划	33,395,790	2.97
8	招商证券股份有限公司	28,943,018	2.58
9	平安证券有限责任公司	27,832,050	2.48
10	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	22,266,086	1.98

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:交银施罗德基金管理有限公司
2、法定代表人:彭纯
3、总经理:莫泰山
4、注册资本:贰亿元人民币
5、注册地址:上海市交通银行大楼二层(裙)
6、设立批准文号:中国证监会证监基金字[2005]128号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:310000400579595号
8、经营范围:基金募集;基金销售;资产管理以及中国证监会许可的其它业务(涉及行政许可的凭许可证经营)
9、股权结构:交通银行股份有限公司占公司注册资本的65%;施罗德投资管理有限公司占注册资本的30%;中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司占公司注册资本的5%。
10、内部组织结构及职能:

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会,有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的职能,切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责,下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会,其中投资决策委员会包括公募基金(除QDII)投资决策委员会、QDII投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长,监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究部下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部及金融工程部。市场及产品部下设产品开发部、市场部、销售部与专户理财部。营运部下设财务部、基金运营部与信息技术部。公司并设综合管理部,负责人力资源及行政事务。此外,监察稽核下设合规审计部与风险管理部,由督察长协同总经理直接管理。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中,基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

11、人员情况:
截止到2009年9月30日,公司有员工156人,其中60.26%的员工具有硕士以上学历。
12、信息披露负责人:陈超
电话:021-61055050
13、基金管理业务情况简介:

截至2009年9月30日,交银施罗德基金管理有限公司旗下共管理11只开放式基金,资产管理规模近680亿元。旗下管理的基金有交银施罗德精选股票证券投资基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金、交银施罗德增利债券证券投资基金、交银施罗德环球精选价值证券投资基金(QDII基金)、交银施罗德保本混合型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金以及交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

14、本基金基金经理

屈乐伟先生,基金经理。数理系硕士。13年证券投资从业经验。历任广发证券北京业务总部研发部经理、投资部经理;华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理助理。2006年6月加入交银施罗德基金管理有限公司,自2009年9月29日起兼任交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理至今。

何晓彬先生,基金经理助理。经济学博士,FRM。5年基金行业从业经验。历任长城基金管理公司金融工程小组数量分析师。2006年7月加入交银施罗德基金管理有限公司,担任金融工程部总经理助理、数量分析师。

(二)基金托管人
1、名称:中国农业银行股份有限公司(以下简称:中国农业银行)
2、住所:北京市东城区建国门内大街69号
3、办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
4、成立时间:2009年1月15日
5、法定代表人:项俊波
6、行长:项俊波
7、基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号
8、注册资本:贰仟六百亿元人民币
9、存续期间:持续经营
10、电话:010-68424199
11、传真:010-68424181
12、资产托管部信息披露负责人:李芳菲
13、基金托管部人员情况:

中国农业银行托管业务部现有员工130名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

14、基金托管业务情况简介:

截止2009年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共72只,包括交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)及其它托管资产,托管资产为2800亿元人民币。

(三)上市推荐人
1、海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566
传真:(021)53858549
联系人:金芸、杨薇
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503
网址:www.htsec.com
2、光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com
(四)一级交易商
1、光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com
2、国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:祝幼一
电话:(021)38676161
传真:(021)38670161
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com
3、中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:黎晓宏
电话:(010)65186080
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客户服务电话:400-888-8108
网址:www.csc108.com
4、海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566
传真:(021)53858549
联系人:金芸、杨薇
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503
网址:www.htsec.com
5、广发证券股份有限公司
住所:广州市天河北路183号大都会广场43楼
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
传真:(020)87555305
联系人:肖中梅
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn
6、中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:胡长生
电话:(010)66568047
联系人:李洋
客户服务电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
7、招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn
8、申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
联系人:黄维琳
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sw2000.com.cn
9、华泰联合证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌
客户服务电话:95513,400-8888-555
网址:www.lhzq.com
10、华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
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
电话:(025)84457777-950、248
传真:(025)84579778
联系人:李金龙、张小波
客户服务电话:(025)95597
网址:www.htsc.com.cn
11、国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
12、齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经七路128号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
13、长城证券有限责任公司
住所: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
电话:(0755)83516289
传真:(0755)83516199
联系人:匡婷
客户服务电话:(0755)33680000,400-6666-888
公司网址:www.cc168.com.cn
14、中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:(0571)85776115
传真:(0571)85783771
联系人:俞会亮
客户服务电话:(0571)96598
网址:www.96598.com.cn
15、、兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
电话:(021)38565785
传真:(021)38565783
联系人:谢高得
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn
16、湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海浦东陆家嘴环路958号华能华泰联合大厦五层
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
联系人:钟康莺
客户服务电话:400-888-1551或当地营业部客服电话
网址:www.xcsc.com
17、中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦3层
法定代表人:李剑阁
网址:www.cicc.com.cn
18、德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008-888-128
网址:www.tebon.com.cn
19、中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
客户服务电话:(0532)96577
网址:www.zxwt.com.cn
20、长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
电话:(021)63219781
传真:(021)51062920
联系人:李良
客户服务电话:4008-888-999,(027)85808318
网址:www.95579.com
21、平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
法定代表人:杨宇翔
电话:(0755)22627802
传真:(0755)82433794
联系人:袁月
客户服务电话:95511,400-886-6338
网址:www.pingan.com
22、国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:雷波
电话:(028)86690126
传真:(028)86690126
联系人:金喆
客户服务电话:400-6600-109
公司网址:www.gjzq.com.cn
23、国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
24、江南证券有限责任公司
住所:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
联系人:戴蕾
客户服务电话:(0791)6768763
网址:www.scstock.com
25、渤海证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:张志军
联系人:王兆权
客户服务电话:400-651-5988
网址:www.bhzq.com
26、西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25楼
办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25楼
法定代表人:王珠林
联系人:秦治国
电话:023-63721712
传真:023-63786215
客户服务电话:400-809-6096
网址:www.swsc.com.cn
27、恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人:刘汝军
传真:(021)68405181
客户服务电话:(0471)4960762,(021)68405273
网址:www.cnht.com.cn
28、江海证券有限公司
住所:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:(0451)82269280
传真:(0451)82269290
客户服务电话:400-666-2288
联系人:徐世旺
公司网址:www.jhzq.com.cn
29、宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人:汤世生
电话:(010)88085338
传真:(010)88085240
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com
30、东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
电话:(021)63325888
传真:(021)63326173
联系人:吴宇
客户服务电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn
31、中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
电话:(010)84588266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
客户服务电话:(010)84588903
网址:www.cs.ecitic.com
32、安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)82558305
传真:(0755)82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-800-1001
网址:www.axzq.com.cn
33、国元证券股份有限公司
住所: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
客户服务电话:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn
34、方正证券有限责任公司
住所:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
联系电话:(0731)85832343
传真:(0731)85832342
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com
35、东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:(0431)85096709
联系人:潘锴
客户服务电话:(0431)96688-0,(0431)85096733
网址:www.nesc.cn
(五)基金验资机构
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
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:金毅
经办注册会计师:薛竞、金毅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付,不由基金资产承担。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金截至2009年12月8日的资产负债表如下:

资产	本报告期末 2009年12月8日
资产:	
银行存款	345,618.59
结算备付金	5,271,084.00
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	1,027,296,833.43
其中:股票投资	1,027,296,833.43
债券投资	–
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	13,228,773.12
应收利息	1,146,786.43
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	19,377.51
资产总计	1,047,558,473.08
负债和所有者权益	**本报告期末 2009年12月8日**
负债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	113,983.73
应付托管费	22,796.73
应付销售服务费	–
应付交易费用	837,527.25
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	443,362.78
负债合计	1,417,670.49
所有者权益:	
实收基金	1,009,284,164.00
未分配利润	36,856,638.59
所有者权益合计	1,046,140,802.59
负债和所有者权益总计	1,047,558,473.08

注:1、截至2009年12月8日,基金份额净值0.931元,基金份额总额1,123,524,362份。
2、本报告期自2009年9月25日起至2009年12月8日止。本基金合同于2009年9月25日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2009年12月8日,本基金的投资组合情况如下:
(一)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	1,027,296,833.43	98.07
	其中:股票	1,027,296,833.43	98.07
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	5,616,702.59	0.54
6	其他资产	14,644,937.06	1.40
7	合计	1,047,558,473.08	100.00

(二)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	0.00	0.00
B	采掘业	130,838,178.39	12.51
C	制造业	162,955,700.75	15.58
C0	食品、饮料	4,396,468.32	0.42
C1	纺织、服装、皮毛	5,815,565.02	0.56
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,148,282.40	1.26
C5	电子	3,491,706.00	0.33
C6	金属、非金属	70,343,222.69	6.72
C7	机械、设备、仪表	56,287,339.32	5.38
C8	医药、生物制品	9,473,117.00	0.91
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	56,002,315.71	5.35
E	建筑业	28,448,696.75	2.72
F	交通运输、仓储业	91,276,246.35	8.73
G	信息技术业	27,101,766.00	2.59
H	批发和零售贸易	12,044,891.10	1.15
I	金融、保险业	459,504,713.16	43.92
J	房地产业	37,663,523.82	3.60
K	社会服务业	7,156,262.60	0.68
L	传播与文化产业	3,188,536.00	0.30
M	综合类	11,116,002.80	1.06
	合计	1,027,296,833.43	98.20

(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	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	600036	招商银行	3,910,100	69,677,982.00	6.66
2	601318	中国平安	1,009,647	58,791,744.81	5.62
3	600016	民生银行	6,726,500	52,735,760.00	5.04
4	601166	兴业银行	1,252,722	50,459,642.16	4.82
5	600030	中信证券	1,631,810	50,276,066.10	4.81
6	600000	浦发银行	1,889,979	42,467,828.13	4.06
7	601088	中国神华	1,159,520	41,336,888.00	3.95
8	600033	福建高速	4,104,779	29,102,883.11	2.78
9	601601	中国太保	1,082,846	28,597,962.86	2.73
10	601398	工商银行	5,300,200	28,091,060.00	2.69

(四)按券种分类的债券投资组合
截至2009年12月8日,本基金未持有债券。
(五)投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2009年12月8日,本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2、本基金前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他资产构成如下:

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	13,228,773.12
3	应收利息	1,146,786.43
4	其他资产	19,377.51
5	合计	14,644,937.06

4、权证投资情况
截至2009年12月8日,本基金未持有权证;自基金合同生效日至2009年12月8日,本基金未投资任何权证。
5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2009年12月8日,本基金未持有可转换债券。
6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至2009年12月8日,本基金未持有资产支持证券。
7、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

以2009年12月4日为基金份额折算日,本基金进行了基金份额折算,具体内容详见第三章的“(三)基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
(二)根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,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,基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为海通证券股份有限公司和光大证券股份有限公司。上市推荐人与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。
上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;
2、基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、基金份额的申购与赎回

(一)申购和赎回的开放日及时间
1、申购、赎回的开始时间
自2009年12月15日起,本基金开始办理申购、赎回业务。
2、开放日及开放时间
投资者可办理申购、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。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(二)申购和赎回场所
投资者应当在一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。
目前本基金一级交易商包括光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、德邦证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、宏源证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、方正证券有限责任公司和东北证券股份有限公司等35家证券公司。

(三)申购和赎回的数额限制
投资者申购、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100万份,基金管理人有权对其进行更改,并在更改前至少3个工作日依照有关规定在指定媒体上予以公告。
(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。
5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。
(五)申购与赎回的程序
1、申购和赎回申请的提出
投资者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。投资者申购本基金时,须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时,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
投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资者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。
3、申购和赎回的清算交收与登记
投资者T日申购、赎回成功后,注册登记机构在T日收市后为投资者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。如果注册登记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。
注册登记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个工作日前在指定媒体公告。
(六)申购、赎回的对价及费用
1、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者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。赎回对价是指投资者赎回基金份额时,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。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售在外的基金份额总数。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、投资者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或赎回份额0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。
(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日现金替代的溢价比例、T日允许现金替代的最高比例、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其它相关内容。
2、申购赎回清单组合证券相关内容
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、最小申购赎回单位
最小申购赎回单位是基金申购赎回的最基本单位。
4、申购赎回清单现金替代相关内容
现金替代是指申购、赎回过程中,投资者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者无法在申购时买入的证券,或基金管理人认为可以采用现金替代的其他情形。
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现涨停时,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,采用最近一次收盘价(考虑当日的除权除息等因素)。
收取可以现金替代溢价的原因是,对于使用可以现金替代的证券,基金管理人需随后买入,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者收取欠缺的差额。
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,基金管理人将以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者或投资者应补交的款项;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者或投资者应补交的款项。
特例情况:若自T日起(不含T日),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者或投资者应补交的款项。
若现金替代日(T日)后至T+2日(若在特例情况下,则为T日起第20个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则进行相应调整。
T+2日后第1个工作日(若在特例情况下,则为T日起第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:为更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者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:

$$现金替代比例(\%)=\frac{\sum 第i只替代证券的数量\times该证券最新价格\times(1+[illegible])}{[illegible]}$$

(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,或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。
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。
5、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机构预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金,由基金管理人计算的现金数额。
本基金T日申购赎回清单中公告预估现金部分计算公式为:
T日预估现金部分＝T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值－(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和)
其中,T日预计开盘价主要根据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。
6、申购赎回清单现金差额相关内容
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日现金差额＝T日最小申购赎回单位对应的基金份额×T日基金份额净值－(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和)
T日投资者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。在投资者申购时,如现金差额为正数,则投资者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,则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金;在投资者赎回时,如现金差额为正数,则投资者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,则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。
7、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	2009年12月9日
基金名称	上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金
基金管理人公司名称	交银施罗德基金管理有限公司
一级市场基金代码	510011
2009年12月8日信息内容	
现金差额(单位:元)	562.00
最小申购赎回单位资产净值(单位:元)	931,124.27
基金份额净值(单位:元)	0.931
2009年12月9日信息内容	
预估现金部分(单位:元)	-3,266.73
现金替代比例上限	30%
是否需要公布IOPV	是
最小申购赎回单位(单位:份)	1,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购、允许赎回

成份股信息内容

股票简称	股票代码	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
浦发银行	600000	1700	允许	10%	
邯郸钢铁	600001	600	允许	10%	
武钢股份	600005	1000	允许	10%	
华能国际	600011	900	允许	10%	
民生银行	600016	6200	允许	10%	
上港集团	600018	1400	允许	10%	
宝钢股份	600019	1700	允许	10%	
中海发展	600026	200	允许	10%	
华电国际	600027	400	允许	10%	
南方航空	600029	500	允许	10%	
中信证券	600030	1500	允许	10%	
三一重工	600031	200	允许	10%	
福建高速	600033	200	允许	10%	
招商银行	600036	3600	允许	10%	
歌华有线	600037	200	允许	10%	
保利地产	600048	500	允许	10%	
中国联通	600050	2800	允许	10%	
五矿发展	600058	100	允许	10%	
同仁堂	600085	100	允许	10%	
特变电工	600089	500	允许	10%	
云天化	600096	100	允许	10%	
同方股份	600100	200	允许	10%	
上海汽车	600104	400	允许	10%	
包钢稀土	600111	200	允许	10%	
兰花科创	600123	100	允许	10%	
中青旅	600138	100	允许	10%	
航天机电	600151	100	允许	10%	
建发股份	600153	200	允许	10%	
中体产业	600158	200	允许	10%	
天坛生物	600161	100	允许	10%	
雅戈尔	600177	400	允许	10%	
生益科技	600183	200	允许	10%	
兖州煤业	600188	200	允许	10%	
复星医药	600196	200	允许	10%	
南山铝业	600219	300	允许	10%	
北京城建	600266	100	允许	10%	
赣粤高速	600269	400	允许	10%	
烟台万华	600309	300	允许	10%	
华发股份	600325	200	允许	10%	
承德钒钛	600357	200	允许	10%	
江西铜业	600362	200	允许	10%	
金地集团	600383	700	允许	10%	
中远航运	600428	200	允许	10%	
吉恩镍业	600432	100	允许	10%	
宝钛股份	600456	100	允许	10%	
驰宏锌锗	600497	200	允许	10%	
中化国际	600500	200	允许	10%	
上海能源	600508	100	允许	10%	
中铁二局	600528	200	允许	10%	
栖霞建设	600533	200	允许	10%	
天威保变	600550	200	允许	10%	
海油工程	600583	400	允许	10%	
新安股份	600596	100	允许	10%	
青岛啤酒	600600	100	允许	10%	
方正科技	600601	600	允许	10%	
大众交通	600611	200	允许	10%	
大众公用	600635	400	允许	10%	
申能股份	600642	500	允许	10%	
城投控股	600649	400	允许	10%	
川投能源	600674	100	允许	10%	
广船国际	600685	100	允许	10%	
青岛海尔	600690	300	允许	10%	
天津港	600717	300	允许	10%	
上实发展	600748	100	允许	10%	
厦门国贸	600755	100	允许	10%	
国电电力	600795	900	允许	10%	
马钢股份	600808	800	允许	10%	
海通证券	600837	1400	允许	10%	
四川长虹	600839	500	允许	10%	
火箭股份	600879	200	允许	10%	
亚泰集团	600881	600	允许	10%	
国投电力	600886	200	允许	10%	
长江电力	600900	1400	允许	10%	
开滦股份	600997	200	允许	10%	
大秦铁路	601006	1300	允许	10%	
中国神华	601088	1100	允许	10%	
中国国航	601111	500	允许	10%	
兴业银行	601166	1200	允许	10%	
西部矿业	601168	500	允许	10%	
中国铁建	601186	1000	允许	10%	
中国平安	601318	900	允许	10%	
交通银行	601328	100	必须	–	867.00
广深铁路	601333	900	允许	10%	
中国中铁	601390	1700	允许	10%	
工商银行	601398	4800	允许	10%	
北辰实业	601588	500	允许	10%	
中国铝业	601600	600	允许	10%	
中国太保	601601	1000	允许	10%	
中国人寿	601628	500	允许	10%	
潞安环能	601699	200	允许	10%	
上海电气	601727	200	允许	10%	
中国石油	601857	1200	允许	10%	
中煤能源	601898	600	允许	10%	
紫金矿业	601899	700	允许	10%	
中国远洋	601919	800	允许	10%	
建设银行	601939	3000	允许	10%	
金钼股份	601958	300	允许	10%	
中国银行	601988	2100	允许	10%	
大唐发电	601991	200	允许	10%	
中信银行	601998	800	允许	10%	

(下转B16版)