上证红利交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

2009年第2号

【重要提示】

本基金经中国证监会2006年9月26日证监基金字[2006]196号文核准募集。本基金的基金合同于2006年11月17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，投资人认购（或申购）基金份额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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不对投资人保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日为2009年11月16日，有关财务和业绩表现数据截止日为2009年9月30日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人招商银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书进行了复核确认

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1、基金管理人

名称：友邦华泰基金管理有限公司
住所：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
法定代表人：齐亮
成立日期：2004年11月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178号
经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：沈炜
联系电话：400-888-0001，021-38601777

2、股权结构：AIG Global Investment Corp.（AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长，2001年至2004年任华泰证券有限责任公司副总裁。

Ravi Mehrotra先生：董事，硕士，曾在印度的美国银行、领先证券和富兰克林邓普顿资产管理公司任职，2006年加入美国国际集团，目前担任美国国际集团（香港）亚洲资产管理公司执行董事。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992年起至今历任华泰证券有限责任公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

陈国杰先生：董事，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理集团资深副总裁兼区域总监（亚洲），美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职。

徐耀华先生：独立董事，硕士，1994-2000年任香港联合交易所有限公司执行总监、行政总裁，1997年至今担任香港证券专业学会主席，2006年至今任香港华高和昇财务顾问有限公司主席。

林征女士：独立董事，硕士，1983-1992年任全国人大法工委副处长，1999-2001年任华夏证券有限责任公司副总经理，2001年至今任天相投资顾问有限公司副总经理。

王学林先生，独立董事，学士，1987-1988年任上海市对外经济贸易委员会主任科员，1988-1999年任上海市外国投资工作委员会副处级调研员，1999-2003年任上海市国际贸易促进委员会副处级调研员。

2、监事会成员

常小抒先生：监事长，学士，2004-2007年任美国国际集团全球投资公司资深财务分析师，2007年至今美国国际集团亚洲投资公司，资产管理亚洲区首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1993-1995年任上海大陆期货公司交易部、市场部经理，1995-1996年任江苏东华期货公司上海业务部副总经理，1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入友邦华泰基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金基金经理。

3、总经理及其他高级管理人员

陈国杰先生：总经理，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理集团资深副总裁兼区域总监（亚洲），美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职，并自友邦华泰基金管理有限公司成立至今任公司董事。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券有限责任公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004年任华泰证券有限责任公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任友邦华泰基金管理有限公司总经理助理。

刘宏友先生：副总经理，硕士，1992–2004年历任华泰证券有限责任公司部门副总经理、总经理，2004–2006年任华夏基金管理有限公司上海营销总部副总经理。2006–2008年5月任友邦华泰基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

张娅女士：美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作，2004年初加入友邦华泰基金管理有限公司，从事投资研究和金融工程工作。2006年11月开始至今担任本基金基金经理。

柳军先生：简历同上。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理陈国杰先生；

成员：副总经理王溯舸先生；研究部总监张净女士；研究部副总监蔡静女士；投资部总监梁丰先生；投资部副总监汪晖先生；海外投资部总监李文杰先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

6、上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：147.07亿元
法定代表人：秦晓
行长：马蔚华
资产托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】83号
电话：0755—83199084
传真：0755—83195201
资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2009年6月30日，招商银行总资产1.973万亿元人民币，核心资本824.66亿元人民币。

（二）主要人员情况

秦晓先生，招商银行董事长和非执行董事，2001年4月加入本公司。英国剑桥大学经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员，香港中国企业协会名誉会长、清华大学经济管理学院和中国人民银行研究生部兼职教授。2001年1月起任招商局集团有限公司董事长。曾任中国国际信托投资公司总经理、副董事长、中信实业银行董事长。秦晓博士曾任第九届全国人大代表、国家外汇管理局外汇政策顾问、日本丰田公司国际咨询委员会委员，并于2001年担任亚太经合组织工商咨询理事会主席。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999年1月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自2002年7月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995年5月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

夏博辉先生，男，1963年11月出生，湖南人，管理学博士（厦门大学），教授、注册会计师。现任招商银行资产托管部总经理，财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人，中国会计学会理事、中国金融会计学会专家委员会委员。1992–1999年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研研究生处长、科研处处长及讲师、副教授、教授，2000–2005年6月历任深圳发展银行会计出纳部总经理、财务会计部总经理、计划财会部总经理、财务执行总监等职；2005年7月，加盟招商银行。1993–1996年，受聘担任世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长。曾获“全国优秀教师并授予全国优秀教师奖章”（1993）、湖南省普通高校优秀教学成果一等奖（1993）、湖南省第五届优秀社会科学成果（著作）二等奖（1999）、中国青年科技论坛二等奖（1999）。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

（三）基金托管业务经营情况

截至2009年10月31日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金及其它托管资产，托管资产为1708.25亿元人民币。

(四) 托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

（5）适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

（6）防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）申购赎回代理证券公司（一级交易商）

1）华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
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
联系人：樊昊
电话：（025）84457777
传真：（025）84579763
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

2）华泰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、24、25层
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
电话：（0755）82492000
传真：（0755）82492962
客服电话：400-888-8555，95513
公司网址：www.lhzq.com

3）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：胡长生
联系人：李洋
电话：（010）66568587
传真：（010）66568536
客服电话：（010）4008–888–888
公司网址：www.chinastock.com.cn

4）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人：祝幼一
联系人：芮敏祺
电话：（021）38676666
传真：（021）38670666
客服电话：400-888-8666
公司网址：www.gtja.com

5）申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：王序微
电话：（021）54033888
传真：（021）54038844
客服电话：（021）962505
公司网址：www.sw2000.com.cn

6）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦10楼
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：（021）63410340
传真：（021）63410456
客服电话：400-888-8001，（021）95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com

7）中信证券股份有限公司
注册地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：（010）84588888
传真：（010）84865560
客服电话：95558
公司网址：www.cs.ecitic.com

8）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：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
电话：（010）85130577
传真：（010）65182261
客服电话：400-888-8108，（010）65186758
公司网址：www.csc108.com

9）广发证券股份有限公司
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
联系人：肖中梅
电话：（020）87555888
传真：（020）87555305
客服电话：（020）961133
公司网址：www.gf.com.cn

10）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：（0755）82130833
传真：（0755）82133302
客服电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

11）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
联系人：黄新波
电话：（0755）82940764
传真：（0755）82960141
客服电话：95565、400-888-8111
公司网址：www.newone.com.cn

12）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨
电话：（021）22169999
传真：（021）22169134
客服电话：400-888-8788、10108998
公司网址：www.ebscn.com

13）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
联系人：徐翔
电话：（025）83367888-4201
传真：（025）83320066
客服电话：400-828-5888
公司网址：www.njzq.com.cn

14）兴业证券股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼
法定代表人：兰荣
联系人：杨盛芳
电话：（021）68419974
传真：（021）68419867
客服电话：400-8888-123
公司网址：www.xyzq.com.cn

15）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北武汉新华路特8号
办公地址：湖北武汉新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：（021）68751929
传真：（021）51062920
客服电话：400-800-8999或027-85808318
公司网址：www.95579.com

16）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经十路128号
办公地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：（0531）81283728
传真：（0531）81283735
客服电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

17）财通证券有限责任公司
注册地址：杭州市解放路111号
办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
电话：(0571) 87925129
传真：(0571) 87925129
客服电话：（0571）96336、上海地区962336
公司网址：www.ctsec.com

18）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：张治国
电话：(0351) 8686703
传真：(0351) 8686619
客服电话：400-666-1618
公司网址：www.i618.com.cn

19）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市八卦三路平安大厦三楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼8楼
法定代表人：陈敬达
联系人：袁月
电话：（0755）22627802
传真：（0755）82433794
客服电话：95511
公司网址：www.pa18.com

20）中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人：石保上
联系人：程月艳 耿铭
电话：（0371）65585670 65585550
传真：（0371）65585670 65585550
客服电话：（0371）967218
公司网址：www.ccnew.com

21）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号华旭大厦6楼
办公地址：上海市西藏中路336号华旭大厦6楼
法定代表人：蒋元真
联系人：黄枫
电话：（021）62470157
传真：（021）62470244
客服电话：（021）962518
公司网址：www.962518.com

22）国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）
办公地址：北京市东东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）
法定代表人：王少华
联系人：黄静
电话：(010) 84183389
传真：(010) 64482090
客服电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com

23）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510)
办公地址：青岛市市南区东海西路28号
法定代表人：史洁民
联系人：丁韶燕
电话：（0532）85022026
传真：（0532）85022511
客服电话：（0532）96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

24）宏源证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：李巍
电话：（010）62294608
传真：（010）62296854
客服电话：（010）62294600
公司网址：www.hysec.com

25）东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼
法定代表人：朱科敏
联系人：李涛
电话：（021）50586660-8966
传真：（021）50819897
客服电话：（021）52574550、（0519）88166222、（0379）64902266、免费服务热线：400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

26）万联证券有限责任公司
注册地址：广州市中山二路18号广东电信广场36–37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36–37层
法定代表人：李舫金
联系人：罗创斌
电话：（020）37865017
传真：（020）37865008
客服电话：400-888-8133
公司网址：www.wlzq.com.cn

27）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市河西区宾水道3号
法定代表人：张志军
联系人：王兆权
电话：（022）28451861
传真：（022）28451892
客服电话：400-651-5988
公司网址：www.bhzq.com.cn

28）德邦证券有限责任公司
注册地址：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
联系人：罗芳
电话：（021）68761616
传真：（021）68767981
客服电话：400-888-8128
公司网址：www.tebon.com.cn

29）江南证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市抚河北路291号
办公地址：江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人：姚江涛
联系人：余雅娜
电话：（0791）6768763
传真：（0791）6789414
客服电话：（0791）6768763
公司网址：www.scstock.com

30）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
联系人：耿德健
电话：（021）58878465
传真：（021）68875123
客服电话：（021）58796226-3670
公司网址：www.cicc.com.cn

（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
电话：（021）58872625
传真：（021）68870311

（三）律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市浦东南路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
经办律师：秦悦民、王利民

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、单峰
电话：021-61238888
传真：021-61238800

四、基金的名称

上证红利交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金的主要投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、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%。

八、基金的投资策略

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

特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。

在法律法规许可时，基金管理人可运用股票期货、期权等相关金融衍生工具，以提高投资效率，更好达到本基金的投资目标。

基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的，不得将之应用于投机目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1）研究：依托公司整体研究平台，金融工程小组整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

2）投资决策：投资决策委员会依据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，基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

4）交易执行：集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5）投资绩效评估：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，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

十、基金的风险收益特征

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，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。同时，本基金相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为2009年9月30日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,391,007,100.35	98.88
	其中：股票	4,391,007,100.35	98.88
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	47,381,480.09	1.07
6	其他资产	2,501,529.58	0.06
7	合计	4,440,890,110.02	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

2、报告期末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	76,999,707.51	1.74
B	采掘业	805,887,855.56	18.16
C	制造业	1,864,773,011.87	42.03
C0	食品、饮料	63,960,546.16	1.44
C1	纺织、服装、皮毛	146,501,461.85	3.30
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	150,894,337.16	3.40
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	952,262,511.16	21.46
C7	机械、设备、仪表	379,908,367.97	8.56
C8	医药、生物制品	109,449,629.73	2.47
C99	其他制造业	61,796,157.84	1.39
D	电力、煤气及水的生产和供应业	441,693,039.00	9.95
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	575,144,436.05	12.96
G	信息技术业	69,142,841.93	1.56
H	批发和零售贸易	146,282,709.45	3.30
I	金融、保险业	187,834,244.40	4.23
J	房地产业	106,669,124.56	2.40
K	社会服务业	116,564,169.76	2.63
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	4,390,991,140.09	98.96

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600028	中国石化	38,499,959	435,049,536.70	9.81
2	601006	大秦铁路	36,004,673	333,763,318.71	7.52
3	600019	宝钢股份	48,671,054	314,415,008.84	7.09
4	600104	上海汽车	12,159,187	240,143,943.25	5.41
5	600005	武钢股份	29,169,159	202,142,271.87	4.56
6	600015	华夏银行	18,415,122	187,834,244.40	4.23
7	600011	华能国际	25,015,376	176,858,708.32	3.99
8	600348	国阳新能	4,493,563	160,060,714.06	3.61
9	600642	申能股份	13,361,694	139,228,851.48	3.14
10	600177	雅戈尔	10,310,183	126,505,945.41	2.85

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	–	–

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	
3	应收股利	2,443,294.92
4	应收利息	12,187.02
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	46,047.64
8	其他	–
9	合计	2,501,529.58

4）本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5）报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2009年9月30日。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
2006年	19.30%	1.44%	34.03%	1.84%	–14.73%	–0.40%
2007年	154.82%	2.67%	160.59%	2.69%	–5.77%	–0.02%
2008年	–68.29%	3.18%	–68.93%	3.20%	0.64%	–0.02%
2009年前9个月	59.23%	2.29%	58.20%	2.30%	1.03%	–0.01%
自基金合同生效以来	53.52%	2.75%	71.67%	2.77%	–18.15%	–0.02%
自建仓完毕起至本报告期末	12.88%	2.79%	10.42%	2.80%	2.46%	–0.01%

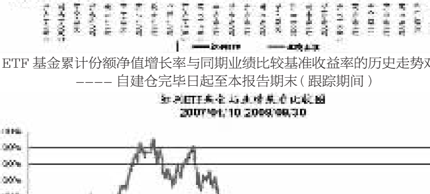
2、基金的收益分配情况

期间	每10份基金份额分红数（元）	备注
基金合同生效日至2006年年底	–	
2007年	–	
2008年	–	
2009年前9个月	0.24	权益登记日为2009年3月23日
合计	0.24	

3、图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

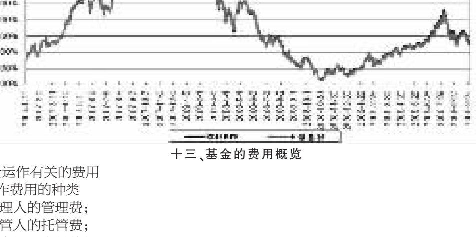
红利ETF基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图一

———— 自基金合同生效以来至本报告期末



红利ETF基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图二

———— 自建仓完毕日起至本报告期末（跟踪期间）



十三、基金的费用概览

（一）基金运作有关的费用

1、基金运作费用的种类

1）基金管理人的管理费；
2）基金托管人的托管费；
3）基金财产划拨支付的银行费用；
4）基金上市费及年费；
5）基金收益分配中发生的费用；
6）基金的证券交易费用；
7）基金合同生效以后的信息披露费用；
8）基金份额持有人大会费用；
9）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
10）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

1）基金管理人的基金管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费由基金管理人每日计算，每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起二个工作日内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当日从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2）基金托管人的基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费由基金管理人每日计算，每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起二个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、本条第1款第3）至第10）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金募集过程中所发生的会计师费和律师费从基金认购费用中列支，招募说明书、发售公告等信息披露费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率和托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金管理费率和托管费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施3个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、认购费用

1）投资人在认购本基金时，需按照本招募说明书第六条第（九）款的规定，交纳一定的认购费用或佣金。

2）认购费用计算公式

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用＝认购份额×认购费率

认购金额＝认购份额×（1＋认购费率）

（2）通过发售代理机构进行网上现金认购、网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算公式为：

认购佣金＝认购份额×佣金比率

认购金额＝认购份额×（1＋佣金比率）

（3）通过发售代理机构进行网下股票认购的投资人，认购以单只股票股数申请，认购佣金和净认购份额的计算公式为：

认购份额＝$\sum$(第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量)/1.00

认购佣金＝认购份额×佣金比率

认购佣金由发售代理机构在投资人认购确认时以现金方式收取，但在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择基金份额的方式支付认购佣金。如投资人选择以基金份额支付佣金，则：

净认购份额＝认购份额－认购佣金/基金份额面值

3）收取方式和使用方式

本基金认购费由基金管理人在投资人认购确认时收取，用于市场推广、销售服务等各项费用。

本基金认购佣金由发售代理机构在投资人认购确认时收取，用于市场推广、销售服务等各项费用。在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

2、申购、赎回费用

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条第（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：

申购/赎回佣金＝申购/赎回份额×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资产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金资产中列支。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，国家另有规定可以将指数使用费列入基金费用的，从其规定。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

我司旗下的上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同于2006年11月17日生效，至2009年11月16日运作满3年。本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、“三、基金管理人”部分，对监事会成员、基金经理、投资决策委员会成员的相关信息作了更新。
2、“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
3. 在“五、相关服务机构”部分，更新了“一级交易商”的相关信息及经办注册会计师情况；
4. 在“九、基金份额的交易”更新了“一级交易商”的相关描述；
5. 在“十、基金份额的申购、赎回”部分，更新了申购赎回清单的格式举例和成份股信息内容。
6. 在“十一、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
7. 在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金的投资业绩及收益分配情况。
8. 在“十九、基金风险的揭示”部分，更新部分风险情况的描述。
9. 更新了“二十四、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书截止日以来涉及本基金的相关公告。

友邦华泰基金管理有限公司
二〇〇九年十二月二十九日