上证红利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

友邦华泰基金管理有限公司

一、重要声明与提示

《上证红利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》(以下简称“本上市交易公告书”)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(2004年修订)》的规定编制,友邦华泰基金管理有限公司(即基金管理人)的董事会及董事保证本上市交易公告书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。

招商银行股份有限公司(即基金托管人)保证本上市交易公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。

中国证监会、上海证券交易所对上证红利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,请投资者详细查阅刊登在10月24日、10月25日、10月30日《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》上并在友邦华泰基金管理有限公司网站(www.aig-huatai.com)、招商银行网站(www.cmbchina.com)上公告的《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称:红利ETF。

2、二级市场交易代码:510880。

3、基金申购、赎回简称:红利申赎。

4、申购、赎回代码:510881。

5、2007年1月11日基金份额总额:1,456,675,703份。

6、2007年1月11日基金份额净值:2.018元。

7、本次上市交易份额:1,456,675,703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:2007年1月18日。

10、基金管理人:友邦华泰基金管理有限公司。

11、基金托管人:招商银行股份有限公司。

12、上市推荐人:华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。

13、申购赎回代办证券公司(简称“一级交易商”):华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)基金募集

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会2006年9月26日证监基金字[2006]196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:自2006年10月30日至2006年11月10日进行发售,其中,网下现金发售的日期为2006年10月30日至2006年11月10日,网上现金发售和网下股票发售的日期为2006年11月8日至2006年11月10日。

5、发售价格:人民币1.00元。

6、发售期限:10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3种方式。

8、发售协调人

主协调人:华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。

副主协调人:中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司。

9、发售机构

(1)直销机构

投资者可通过友邦华泰基金管理有限公司的直销网点办理基金的网下现金认购。

(2)代销机构

本基金网下现金认购和网下股票认购的代理机构包括华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信万通有限责任公司、中原证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、金通证券股份有限公司、天和证券经纪有限公司、财通证券经纪有限责任公司、兴业证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、南京证券有限责任公司和万联证券有限责任公司等41家证券公司。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理,现有华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、广东证券股份有限公司、西南证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、民生证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、北京证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、大鹏证券有限责任公司、金通证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、金信证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、天和证券经纪有限公司、南京证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、泰阳证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、第一证券有限公司、国都证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华西证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、西北证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、金元证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、财通证券经纪有限责任公司等68家证券公司。

(二)基金合同生效

截至2006年11月10日,基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集金额总额为2,222,985,094.00元人民币(含募集股票以及募集期间利息22,275元)。募集资金已于2006年11月16日划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户,募集股票已于2006年11月15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。

本次募集有效认购户数为29,193户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,募集基金份额总额为2,222,985,094份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《上证红利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”)的有关规定,友邦华泰基金管理有限公司(以下简称“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2006年11月17日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(三)基金份额折算

根据《基金合同》和《招募说明书》的有关规定,本基金管理人确定2007年1月10日为基金份额折算日。当日上证红利指数收盘值为2074.803点,基金资产净值为3,022,309,942.98元,折算前基金份额总额为2,222,985,094份,折算前基金份额净值为1.360元。

根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为0.65527799,折算后基金份额总额为1,456,675,703份,折算后基金份额净值为2.075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2007年1月11日进行变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位。投资者可以自2007年1月12日起在其上海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《关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易及申购赎回的通知》上证债字[2007]4号。

2、上市交易日期:2007年1月18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:红利ETF。

5、二级市场交易代码:510880。

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基金二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称:红利申赎。

7、申购、赎回代码:510881。

投资者只能通过指定的代办证券公司(一级交易商)参与基金申购、赎回。目前,一级交易商包括华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

8、本次上市交易份额:1,456,675,703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2007年1月11日,本基金份额持有人户数为29,193户,平均每户持有的基金份额为49,898份。

(二)持有人结构

截至2007年1月11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550,361,426份,占基金总份额的37.78%;个人投资者持有的基金份额为906,314,277份,占基金总份额的62.22%。

(三)前十名基金份额持有人情况

截至日期:2007年1月11日

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例(%)
1	中国人寿保险(集团)公司	65,528,946	4.50
2	中国人寿保险股份有限公司	65,528,946	4.50
3	华泰证券-招行-华泰紫金2号集合资产管理计划	39,316,679	2.70
4	中国平安保险(集团)股份有限公司	32,764,145	2.25
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司	32,764,145	2.25
6	中国太平洋保险公司	32,764,145	2.25
7	长江证券有限责任公司	19,658,340	1.35
8	太平人寿保险有限公司-传统-普通保险产品-022L-CT001沪	19,658,225	1.35
9	宝钢集团有限公司	19,658,225	1.35
10	万向财务有限公司	13,106,281	0.90

五、基金主要当事人情况

(一)基金管理人

1、基本情况

名称:友邦华泰基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼
法定代表人:齐亮
总经理:陈国杰
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
法人营业执照文号:企合国字第001088号
经营范围:基金管理业务;发起设立基金;及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

2、股权结构

AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)49%、华泰证券有限责任公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

3、内部组织

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。

目前,公司下设10个部门,并在北京设立了分公司。

(1)投资研究部:负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资、行业和上市公司研究,下设基金经理室、研究部和中央交易室,分别负责基金管理、投资研究和交易指令执行与监督。

(2)渠道销售部:负责基金销售。

(3)市场服务部:负责公司品牌、基金产品的市场推广及客户服务。

(4)机构理财部:负责机构客户的业务拓展。

(5)业务发展部:负责基金产品研发等新业务拓展。

(6)基金事务部:负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

(7)信息技术部:负责公司信息系统的日常运行与开发。

(8)法律监察部:负责内部法律事务咨询,处理外部法律事务,检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况,并研究公司风险管理政策与方针,协调各部门处理公司层面风险事项。负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性,检查公司内部控制制度的执行情况,并提出改进意见。

(9)人力资源部:负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务,负责后勤服务等综合事务管理。

(10)公司财务部:负责公司财务事项。

4、人员情况

截至2006年12月,我公司共有员工62人,获得基金从业资格的有47人。所有人员在最近3年内均没有受到有关监管部门的处罚。

5、信息披露负责人:陈晖
电话:021-50479200
传真:021-50478668

6、基金管理业务情况

截至2007年1月11日,公司管理资产规模39.80亿元人民币,旗下共有友邦华泰盛世中国股票型基金、友邦华泰中短期债券基金和上证红利ETF等3只开放式基金。

7、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。

(二)基金托管人情况

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:122.79亿元
法定代表人:秦晓
行长:马蔚华
托管部门负责人:夏博辉
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【2002】83号
资产托管部信息披露负责人:姜然
电话:0755—83195226
传真:0755—83195201

2、基金托管部门

2002年11月6日,招商银行股份有限公司经中国证券监督委员会和中国人民银行批准,取得证券投资基金托管人资格,是国内第一家取得基金托管人资格的上市银行。除基金托管资格外,招商银行现已取得受托投资管理托管业务资格,合格境外机构投资者托管人资格(QFII),全国社会保障基金托管资格和企业年金基金托管人资格和保险资金托管资格。

招商银行总行设立资产托管部负责证券投资基金托管业务,内设综合管理室、核算清算室、稽核监察室三个职能部门,并在上海设立了分部。招商银行资产托管部拥有安全可靠的财务核算计价、交易监督系统及高效快捷的先进的“网银通”电子化资金清算服务体系,现有员工20人。

3、托管业务情况

截至2006年6月30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(含招商安泰股票投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券投资基金),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和友邦华泰中短期债券投资基金及其它托管资产,托管资产总规模已近400亿元人民币。

(三)上市推荐人

1、华泰证券有限责任公司
法定代表人:吴万善
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
联系人:李金龙、张小波
联系电话:(025)84579897

2、国泰君安证券股份有限公司
法定代表人:祝幼一
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
联系人:芮敏祺
联系电话:(021)62580818

(四)申购赎回代办证券公司(一级交易商)

1、华泰证券有限责任公司
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
电话:(025)84457777-882、721
传真:(025)84579879
联系人:袁红彬、李金龙
客服电话:(025)84579897
公司网址:www.htsc.com.cn

2、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:上海市延平路135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:800-820-6888
公司网址:www.gtja.com

3、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
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦21楼
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:800-810-8868
公司网址:www.guosen.com.cn

4、中国银河证券有限责任公司
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

5、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:马国强
电话:(0755)82493561
传真:(0755)82492062
联系人:盛宗凌
客服电话:400-8888-555
公司网址:www.lhzq.com

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:021-68816770
传真:021-68817271
联系人:张琦
客服电话:10108998
公司网址:www.ebscn.com

7、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

8、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

9、广发证券股份有限公司
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

10、财通证券经纪有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号
办公地址:杭州市解放路111号
法定代表人:陈海晓
电话:(0571)87828146
传真:(0571)87828033
联系人:叶毓蔚
客服电话:(0571)87828018
公司网址:www.goodyou.com.cn

11、万联证券有限责任公司
注册地址:广州市东山区东风东路836号东峻广场34-34层
办公地址:广州市东山区东风东路836号东峻广场34-34层
法定代表人:李舫金
电话:(020) 87691530
传真:(020) 87691530
联系人:邸亚娟
客服电话:(020)87691530
公司网址:www.wlzq.com.cn

12、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

13、长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特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

14、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:黎晓宏
电话:(010)65183888
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客服电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com

15、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

16、中原证券股份有限公司
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、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

18、山西证券有限责任公司
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:吴晋安
电话:(0351) 8686766、8686708
传真:(0351) 8686709
联系人:张治国
客服电话:(0351)8686868
公司网址:www.i618.com.cn

19、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

(五)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:汪棣、陈宇
电话:021-61238888
传真:021-61238800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

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

截至2007年1月11日,本基金的资产负债表如下:(单位:元)

项　目	金　额	项　目	金　额
资产:		负债:	
银行存款	15,839,112.01	应付证券清算款	-
清算备付金	33,700,000.00	应付赎回款	-
交易保证金	-	应付赎回费	-
应收证券清算款	-	应付管理人报酬	417,312.40
应收股利	-	应付托管费	83,462.48
应收利息	155,168.04	应付佣金	2,619,600.90
应收申购款	-	应付利息	-
其他应收款	-	应付收益	-
股票投资市值	2,892,970,124.76	未交税金	-
其中:股票投资成本	2,246,480,940.66	其他应付款	-
债券投资市值	-	卖出回购证券款	-
其中:债券投资成本	-	预提费用	65,560.32
权证投资	-	其他负债	-
其中:权证投资成本	-	负债合计	3,185,936.10
买入返售证券	-	持有人权益:	
待摊费用	-	实收基金	2,222,985,094.00
其他资产	-	未实现利得	646,489,184.10
		未分配收益	70,004,190.61
		持有人权益合计	2,939,478,468.71
资产合计	2,942,664,404.81	负债及持有人权益合计	2,942,664,404.81

八、基金投资组合

截至2007年1月11日,本基金的投资组合情况如下:

(一)基金资产组合情况

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例(%)
1	股票投资	2,892,970,124.76	98.31
2	债券投资	-	-
3	权证投资	-	-
4	银行存款和清算备付金合计	49,539,112.01	1.68
5	应收证券清算款	-	-
6	其他资产	155,168.04	0.01
	合计	2,942,664,404.81	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	48,816,488.92	1.66
B	采掘业	400,455,470.51	13.62
C	制造业	1,646,086,968.48	56.00
C0	其中:食品、饮料	44,987,329.44	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	126,064,733.33	4.29
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	99,483,484.82	3.38
C5	电子	15,918,750.43	0.54
C6	金属、非金属	1,011,805,433.62	34.42
C7	机械、设备、仪表	315,190,566.84	10.72
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他	32,636,670.00	1.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	278,747,574.95	9.48
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	87,469,683.24	2.98
G	信息技术业	16,945,303.95	0.58
H	批发和零售贸易	41,825,876.66	1.42
I	金融、保险业	120,270,091.76	4.09
J	房地产业	172,035,053.31	5.85
K	社会服务业	80,317,612.98	2.73
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合　计	2,892,970,124.76	98.42

(三)按市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)	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	51,662,456	484,593,837.28	16.49
2	600028	中国石化	35,244,052	364,775,938.20	12.41
3	600005	武钢股份	30,830,693	228,763,742.06	7.78
4	600104	上海汽车	19,326,305	178,188,532.10	6.06
5	600015	华夏银行	16,520,617	120,270,091.76	4.09
6	600642	申能股份	14,207,889	120,198,740.94	4.09
7	600177	雅戈尔	10,510,011	105,100,110.00	3.58
8	600001	邯郸钢铁	16,470,180	83,174,409.00	2.83
9	600383	金地集团	4,584,482	82,474,831.18	2.81
10	600688	S上石化	9,578,048	65,801,189.76	2.24

(四)期末按券种分类的债券投资组合

截至2007年1月11日,本基金未持有债券。

(五)投资组合报告附注

1、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	应收利息	155,168.04

4、权证投资情况

截至2007年1月11日,本基金未持有权证;自基金合同生效日至2007年1月11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2007年1月11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2007年1月11日,本基金未持有资产支持证券。

九、重大事件揭示

2007年1月10日,本基金进行了基金份额折算,具体内容详见第三条第(三)款“(三)基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(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、上海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

基金托管人就基金上市交易之后履行托管人职责做出承诺:

(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、基金申购赎回价格的复核、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华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。上市推荐人华泰证券有限责任公司是本基金管理人的股东,国泰君安证券股份有限公司与本基金管理人、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(2004年修订)》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2007年1月18日起,本基金开始办理申购、赎回。

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。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。

(二)申购和赎回场所

投资者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。

目前,基金申购、赎回代办证券公司(一级交易商)包括华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

(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50万份,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。

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。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前3个工作日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与通知

基金投资者申购、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。投资者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

投资者T日申购、赎回成功后,登记结算机构在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,并最迟于开始实施前3个工作日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、费用及价格

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。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。

2、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、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。

4、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0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(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,采用前一交易日收盘价(考虑当日的除权除息等因素)。

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:若自T日起,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。

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)、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动,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:

[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。

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、赎回的投资者的相应资金,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日现金差额=T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。

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	2007-1-8
基金名称	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	友邦华泰基金管理有限公司
一级市场基金代码	510881

2007年1月5日信息内容

现金差额(单位:元)	¥-4,625.19
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)	¥622,700.81
基金份额净值(单位:元)	¥1.245

2007年1月8日信息内容

预估现金部分(单位:元)	¥-552.19
现金替代比例上限	20%
是否需要公布IOPV	是
最小申购、赎回单位(单位:份)	500,000
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
600001	邯郸钢铁	3800	禁止		
600005	武钢股份	7100	禁止		
600008	首创股份	2000	禁止		
600011	华能国际	1500	禁止		
600015	华夏银行	3800	禁止		
600019	宝钢股份	11800	禁止		
600022	济南钢铁	1000	禁止		
600028	中国石化	8100	禁止		
600033	福建高速	1300	禁止		
600059	古越龙山	300	禁止		
600064	南京高科	500	禁止		
600066	宇通客车	600	禁止		
600087	南京水运	800	禁止		
600096	云天化	500	禁止		
600098	广州控股	1900	禁止		
600104	上海汽车	4400	禁止		
600126	杭钢股份	600	禁止		
600151	航天机电	700	禁止		
600153	建发股份	700	禁止		
600177	雅戈尔	2400	禁止		
600189	吉林森工	400	禁止		
600210	紫江企业	2300	禁止		
600231	凌钢股份	700	禁止		
600236	桂冠电力	900	禁止		
600282	南钢股份	1100	禁止		
600300	维维股份	600	禁止		
600302	标准股份	400	禁止		
600303	曙光股份	300	禁止		
600307	酒钢宏兴	800	禁止		
600317	营口港	300	禁止		
600323	南海发展	400	禁止		
600327	大厦股份	400	禁止		
600383	金地集团	1000	禁止		
600418	江淮汽车	1600	禁止		
600508	上海能源	600	禁止		
600510	黑牡丹	500	禁止		
600533	栖霞建设	300	禁止		
600548	深高速	600	禁止		
600563	法拉电子	300	禁止		
600569	安阳钢铁	2300	禁止		
600581	八一钢铁	700	禁止		
600598	北大荒	1100	禁止		
600621	上海金陵	900	禁止		
600626	申达股份	600	禁止		
600642	申能股份	3300	禁止		
600675	中华企业	1100	禁止		
600688	上海石化	2200	禁止		
600808	马钢股份	2100	禁止		
600886	国投电力	1100	禁止		
600971	恒源煤电	200	禁止		

(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、基金管理人开市前未公布申购、赎回清单;

4、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

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。已接受的赎回申请,基金管理人应当足额兑付。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。

在条件允许时,基金管理人也可采取其他合理的申购方式,并于新的申购方式开始执行前的至少三个工作日予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据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。

十四、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所、营业场所,投资者可免费查阅。

(一)中国证监会核准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
(二)《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(五)《证券登记及服务协议》及附加协议
(六)法律意见书
(七)基金管理人业务资格批件、营业执照
(八)基金托管人业务资格批件、营业执照

友邦华泰基金管理有限公司
二〇〇七年一月十五日

附件:基金合同摘要

基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利、义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金投资者自取得依据基金合同发行的基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

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、基金合同规定的其它权利。

2、基金份额持有人的义务

1)遵守基金合同;
2)缴纳基金认购、申购款项及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其他基金份额持有人合法利益的活动;
5)执行生效的基金份额持有人大会决议;
6)法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二)基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

1)自基金合同生效之日起,基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;

2)根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;

3)根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用;

4)根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额;

5)依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;

6)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;

7)自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

8)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;

(下转B8版)