

# 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

2007 年第 2 号

(摘要)

### 【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 2007 年 11 月 16 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2007 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：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

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：柳军

联系电话：021-50472222

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%。

### (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。

魏欧林 (Oliver Wethington) 先生：董事，博士，曾在美国商务部和财政部任职多年，2006 年 3 月至今担任美国国际集团 (AIG) 中国成员公司主席。

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，2002 年至今任香港华高金融服务有限公司行政总裁。

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

李达安先生：监事长，总精算师，学士，美国友邦保险有限公司资深副总裁暨中国区域营运总监。

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 年任华泰证券有限责任公司西藏南路营业部总经理，2003 年至今任华泰证券有限责任公司上海总部副总经理。

梁丰先生：监事，硕士，1994-2007 年历任中信集团大中投资管理有限公司证券投资部总经理、总经理助理、中信基金基金经理、股权投资部总监。现任友邦华泰基金管理有限公司投资部总监兼友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金经理。

## 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。

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。

## 4、本基金经理

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。

## 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；研究总监张净女士；投资部总监梁丰先生；基金经理汪晖先

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) 基本情况

#### 1、概况

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：147.03亿元

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—83195226

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：姜然

#### 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2007年6月30日，招商银行总资产1.108万亿元人民币，核心资本净额577.94亿元人民币。

### (二) 主要人员情况

秦晓先生，英国剑桥大学经济学博士，高级经济师。第十届全国政协委员，招商局集团有限公司董事长，招商银行董事长，清华大学管理学院和中国银行研究生部兼职教授。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，国家外汇管理局外汇政策顾问，国际商会中国国家委员会副主席，亚太经济合作组织工商咨询理事会(ABAC)2001年主席，第九届全国人大代表。

马蔚华先生，经济学博士，高级经济师。第十届全国人大代表，政协深圳市第四届委员会常委。招商银行董事、行长。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、招商局集团有限公司董事、TOM 在线有限公司独立董事。同时担任中国企业家协会副会长、深圳市国内银行同业公会会长、深圳上市公司协会会长、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和北京大学、南京大学、吉林大学、西南财经大学等十多所高校兼职教授等职。曾任中国人民银行办公厅副主任，中国人民银行计划资金司副司长，中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长。曾经获评"2001-CCTV 中国经济年度人物"、英国《银行家》杂志(The Banker)"2004 年度银行业希望之星"(Rising Stars of Banking)。

张光华先生，1957 年 3 月出生，1983 年吉林大学经济系本科毕业，1986 年获吉林大学经济学硕士学位，2000 年获西南财经大学经济学博士学位，高级经济师。同时担任中国金融学会常务理事，广东金融学会副会长，广东商业联合会副会长。1986 年 7 月至 1992 年 10 月任国家外汇管理局政研室副主任、计划处处长，1992 年 10 月至 1994 年 6 月任中国人民银行海南省分行行长助理，1994 年 6 月至 1998 年 11 月任中国人民银行海南省分行副行长兼国家外汇管理局海南分局副局长，1998 年 11 月至 2002 年 9 月，任中国人民银行广州分行副行长，2002 年 9 月至 2007 年 4 月任广东发展银行行长。

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2007年9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(含招商安泰股票型投资基金、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、友邦华泰中短期债券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大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及其它托管资产，托管资产为1233.56亿元人民币。

### (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、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) 84457777-248

传真：(025) 84579763

联系人：樊昊

客服电话：400-888-8168, (025) 84579897

公司网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

## 2、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

办公地址：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：马昭明

电话：(0755) 82492062

传真：(0755) 82492187

联系人：盛宗凌

客服电话：400-888-8555, (0755) 25125666

公司网址：[www.lhzq.com](http://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：肖时庆

电话：(010) 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](http://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：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818

传真：(021) 62152814

联系人：芮敏祺

客服电话：400-888-8666

公司网址：[www.gtja.com](http://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

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54038844

联系人：王序微

客服电话：(021) 962505

公司网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

#### 6、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：北京市朝阳区新源南路 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：95558

公司网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

#### 7、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

电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

联系人：魏明

客服电话：400-888-8108，(010) 65186758

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

#### 8、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

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87555305

联系人：肖中梅

客服电话：(020) 87555888 转各营业网点

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

#### 9、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

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](http://www.guosen.com.cn)

#### 10、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

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82960141

联系人：黄健

客服电话：400-888-8111，(0755) 26951111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

#### 11、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 15-16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦 15-16 楼

法定代表人：王明权

电话：(021) 68816000

传真：(021) 68815009

联系人：刘晨

客服电话 : 10108998

公司网址 : [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

#### 12、长江证券有限责任公司

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

法定代表人 : 胡运钊

电话 : (021) 63296362

传真 : (021) 51062920

联系人 : 甘露

客服电话 : 400-800-8999

公司网址 : [www.95579.com.cn](http://www.95579.com.cn)

#### 13、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)87925129

传真 : (0571)87925129

联系人 : 乔骏

客服电话 : (0571) 96336

公司网址 : [www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

#### 14、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

办公地址 : 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心

法定代表人 : 吴晋安

电话 : (0351)8686703

传真 : (0351)8686709

联系人 : 张治国

客服电话 : (0351) 8686868

公司网址 : [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

#### 15、平安证券有限责任公司

注册地址 : 北京

办公地址 : 深圳市八卦三路平安大厦三楼

法人代表：陈敬达

电话：(0755) 22627802

传真：(0755) 82433794

联系人：袁月

客服电话：95511

公司网址：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

#### 16、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：025-83320066

联系人：胥春阳

客服电话：025-83613112

公司网站：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

#### 17、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) 65081069

联系人：谢秀峰

客服电话：(021) 962518

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

#### 18、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) 65585670

传真：(0371) 65585670

联系人：陈利民

客服电话：(0371) 967218

公司网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

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](http://www.zxwt.com.cn)

20、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 3 座 5、34、35 楼

办公地址：广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 3 座 5、34、35 楼

法定代表人：李舫金

电话：(020) 87691111

传真：(020) 87691530

联系人：何勇峰

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.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：汪棣、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 2007 年 9 月 30 日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	资产组合	金额(元)	占基金资产总值比例(%)
1	股票投资	5,731,171,011.56	99.86
2	债券投资	898,420.50	0.02
3	权证投资	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	银行存款和清算备付金合计	5,286,604.96	0.09
6	应收证券清算款	1,958,951.38	0.03
7	其他资产	25,790.56	0.00
	合计	5,739,340,778.96	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	66,736,687.53	1.16
B 采掘业	575,194,168.25	10.03
C 制造业	3,116,590,794.39	54.34
C0 食品、饮料	46,851,419.22	0.82
C1 纺织、服装、皮毛	289,092,022.37	5.04
C2 木材、家具	-	-
C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	204,342,953.73	3.56
C5 电子	20,285,488.36	0.35
C6 金属、非金属	1,887,053,719.20	32.90
C7 机械、设备、仪表	586,198,025.35	10.22
C8 医药、生物制品	-	-
C99 其他制造业	82,767,166.16	1.44

D 电力、煤气及水的生产和供应业	811,339,123.22	14.14
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	156,955,559.71	2.74
G 信息技术业	34,192,472.01	0.60
H 批发和零售贸易	81,374,249.88	1.42
I 金融、保险业	282,632,487.99	4.93
J 房地产业	439,261,786.44	7.66
K 社会服务业	166,893,682.14	2.91
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	5,731,171,011.56	99.92

### 3、报告期末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)	占基金资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	47,451,022	863,134,090.18	15.05
2	600028	中国石化	24,222,307	458,770,494.58	8.00
3	600011	华能国际	24,395,802	424,974,870.84	7.41
4	600104	上海汽车	13,358,809	394,619,217.86	6.88
5	600005	武钢股份	21,287,907	376,157,316.69	6.56
6	600015	华夏银行	14,281,581	282,632,487.99	4.93
7	600177	雅戈尔	9,035,721	252,729,116.37	4.41
8	600383	金地集团	3,946,446	211,845,221.28	3.69
9	600642	申能股份	9,824,757	189,224,819.82	3.30
10	600001	邯郸钢铁	19,076,603	169,400,234.64	2.95

### 4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债券	-	-
3	央行票据	-	-
4	企业债券	-	-

5	可转换债券	898,420.50	0.02
6	短期融资券	-	-
	合 计	898,420.50	0.02

### 5、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	估值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110971	恒源转债	6,450	898,420.50	0.02

### 6、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，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2) 基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 3) 权证投资情况

本报告期内，本基金未获权证。截至期末，本基金未持有权证。

#### 4) 基金的其他资产构成

项目	金额(元)
应收利息	1,997.28
待摊费用	23,793.28
合计	25,790.56

### 5) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

### 7) 本基金自 9 月 10 日起，基金份额申购赎回的记帐日由 T+1 变更为 T+0。

## 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 2007 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2007年上半年	74.43%	2.89%	77.16%	2.92%	-2.73%	-0.03%
2007 年前 9 个月	167.64%	2.73%	172.81%	2.75%	-5.71%	-0.02%
自基金合同生效以来	219.30%	2.57%	265.65%	2.63%	-46.35%	-0.06%
自建仓完毕起至本报告期末	134.84%	2.74%	135.19%	2.75%	-0.35%	-0.01%

### 2、基金的收益分配情况

本基金尚未实施收益分配。

### 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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$\text{认购费用} = \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

(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：

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

(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：

$$\text{认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

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：

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金} / \text{基金份额面值}$$

### 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：

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

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2007年11月16日运作满一年。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. 在“三、基金管理人”部分，更新了监事的介绍和投资决策委员会人员情况。
2. 在“四、基金托管人”部分，根据托管人最新资料进行了更新。
3. 在“五、相关服务机构”部分，更新了“一级交易商”和“经办注册会计师”的相关信息。
4. 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。
5. 在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容，在“6、投资组合报告附注”中增加了“7) 本基金自9月10日起，基金份额申购赎回的记帐日由T+1变更为T+0”。
6. 在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金的投资业绩。
7. 在“十四、基金财产的估值”部分，根据中国证监会《关于基金实施<企业会计准则>后修改原有基金合同相关条款的通知》要求（基金部通知[2007]26号）和我公司2007年9月29日《友邦华泰基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金估值方法和会计政策的公告》更新了相关内容。
8. 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 七年十二月二十八日