

**上证综指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**

**富国基金管理有限公司**

**二〇一一年三月二十二日**

# 目 录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览 .....	4
三、基金的募集与上市交易 .....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	9
五、基金主要当事人简介 .....	10
六、基金合同摘要 .....	14
七、基金财务状况 .....	15
八、基金投资组合 .....	17
九、重大事件揭示 .....	17
十、基金管理人承诺 .....	21
十一、基金托管人承诺 .....	22
十二、基金上市推荐人意见 .....	23
十三、基金份额的申购与赎回 .....	24
十四、备查文件目录 .....	35
附件：基金合同摘要 .....	36

## 一、重要声明与提示

上证综指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，富国基金管理有限公司（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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报告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 2010 年 12 月 27 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及富国基金管理有限公司网站（[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)）上的《上证综指交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

## 二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：综指 ETF。
- 2、二级市场交易代码：510210。
- 3、基金申购、赎回简称：综指申赎。
- 4、申购、赎回代码：510211。
- 5、2011 年 3 月 18 日基金份额总额：109,638,513 份。
- 6、2011 年 3 月 18 日基金份额净值：2.907 元。
- 7、本次上市交易份额：109,638,513 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：2011 年 3 月 25 日。
- 10、基金管理人：富国基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
- 12、上市推荐人：申银万国证券股份有限公司。
- 13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广发华福证券有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中原证券股份有限公司。

### 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：中国证监会证监许可【2010】1379 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 2011 年 1 月 5 日起至 2011 年 1 月 24 日止通过销售机构公开发售。

其中，网上现金认购的日期为 2011 年 1 月 20 日起至 2011 年 1 月 24 日；网下现金认购的日期为 2011 年 1 月 5 日至 2011 年 1 月 24 日；网下股票认购的日期为 2011 年 1 月 20 日起至 2011 年 1 月 24 日。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售期限：网下现金发售 14 个工作日，网上现金发售 3 个工作日，通过发售代理机构进行网下股票认购 14 个工作日。

7、发售方式：投资人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、发售机构

##### (1) 直销机构

网下现金发售和网下股票发售直销机构：富国基金管理有限公司。

##### (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安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广发华福证券有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中原证券股份有限公司。

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、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、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、大通证券股份有限公司、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、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、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、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、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、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、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、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、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、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、兴业证券股份有限公司、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、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、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、中国国际金融有限公司等。

## （二）基金合同生效

上证综指交易型开放式指数证券投资基金自 2011 年 1 月 5 日起向社会公开募集，截至 2011 年 1 月 24 日募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所有限公司验资，此次募集的有效净认购金额为人民币 320,360,047.00 元（含所募集股票市值），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 3,360.00 元人民币。本次募集认购资金已于 2011 年 1 月 28 日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集股票已于 2011 年 1 月 27 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 2,626 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，设立募集期间

募集（含所募集股票市值）及利息结转的基金份额共计 320,363,407.00 份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。其中本基金管理人及本基金管理人的从业人员没有认购本基金。

根据《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》以及《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，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 2011 年 1 月 30 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《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证综指交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人决定 2011 年 3 月 11 日为本基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2011 年 3 月 11 日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011 年 3 月 11 日，上证综合指数收盘值为 2933.796 点，本基金的基金资产净值为 321,657,400.52 元，折算前基金份额总额为 320,363,407 份，折算前基金份额净值为 1.004 元。

根据《上证综指交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.34223209（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 109,638,513 份，折算后基金份额净值为 2.934 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 2011 年 3 月 14 日完成了变更登记。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 2011 年 3 月 15 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。

### （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 [2011] 53 号。
- 2、上市交易日期：2011 年 3 月 25 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：综指 ETF。
- 5、二级市场交易代码：510210。

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：综指申赎。
- 7、申购、赎回代码：510211。

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：安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广发华福证券有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中原证券股份有限公司。

8、本次上市交易份额：109,638,513 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 2011 年 3 月 18 日，本基金份额持有人户数为 2626 户，平均每户持有的基金份额为 41,751 份。

### （二）持有人结构

截至 2011 年 3 月 18 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 72,670,960 份，占基金总份额的 66.28%；个人投资者持有的基金份额为 36,967,553 份，占基金总份额的 33.72%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况：

截至 2011 年 3 月 18 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	红塔证券股份有限公司	17,111,605	15.61%
2	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	6,844,847	6.24%
3	安徽江淮汽车股份有限公司	6,844,642	6.24%
4	中国银河证券股份有限公司	6,844,642	6.24%
5	海通证券股份有限公司	4,107,135	3.75%
6	申银万国证券股份有限公司	3,456,544	3.15%
7	平安证券有限责任公司	3,422,595	3.12%
8	上海证券有限责任公司	3,422,321	3.12%
9	南京证券有限责任公司	3,422,321	3.12%
10	国元证券股份有限公司	3,422,321	3.12%

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：富国基金管理有限公司
- 2、法定代表人：陈敏
- 3、总经理：窦玉明
- 4、注册资本：1.8 亿元人民币
- 5、注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1999】11 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000400214240
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。
- 9、股权结构：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	16.675%

### 10、内部组织结构及职能：

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制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设十七个部门和三个分公司，分别是：权益投资部、固定收益部、另类投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、战略发展部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司、深圳分公司和成都分公司。权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益部：负责固定收益类产品的研究与投资管理；另类投资部：负责FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理；研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责投资交易和风险控制；专户投资部：在固定收益部、权益投资部和另类投资部内设立的虚拟部门，独立负责年金等专户产品的投资管理；机构业务部：负责年金、帐户、社保以及共同

基金的机构客户营销工作；零售业务部：管理北京分公司（华北营销中心）、深圳分公司（华南营销中心）、成都分公司（西部营销中心）、北方营销中心、华中营销中心和华东营销中心，负责共同基金的零售业务；营销策划与产品部：负责产品开发、营销策划和品牌建设等；客服与电子商务部：负责电子商务与客户服务；战略发展部：负责公司战略的研究、规划与落实；监察稽核部：负责监察、风控、法务和信息披露；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；行政管理部：负责文秘、行政后勤等。

#### 11、人员情况：

截止到 2011 年 2 月 16 日，公司有员工 178 人，其中 61%以上具有硕士以上学历。所有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。

#### 12、信息披露负责人：李长伟

电话：68597788

#### 13、基金管理业务情况简介：

截止 2010 年 12 月 31 日，富国基金管理有限公司旗下共管理 19 只基金，资产规模达 621.73 亿元人民币。旗下管理的基金包括：汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金四只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题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、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金十五只开放式证券投资基金。

#### 14、本基金基金经理

李笑薇女士，1970 年出生，北京大学学士，普林斯顿大学硕士，斯坦福大学博士。自 2003 年 1 月开始从事证券行业工作。曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCIBARRA），BARRA 股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司（BarclaysGlobal Investors）大中华主动股票投资总监，高级基金经理及高级研究员。2009 年 6 月加盟富国，2009 年 6 月至今任富国基金管理有限公司另类投资部总经理；2009 年 12 月至今兼任富国沪深 300 增强证券投资基金基金

经理；2011年1月至今兼任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

王保合先生，1977年出生，博士研究生，自2006年7月开始从事证券行业工作。自2006年7月至2009年12月任富国基金管理有限公司研究员；自2010年1月至2011年3月任富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

## （二）基金托管人情况

1、名称：中国工商银行股份有限公司

2、住所：北京市西城区复兴门内大街55号

3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

4、成立时间：1984年1月1日

5、法定代表人：姜建清

6、批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

（国发[1983]146号）

7、注册资本：人民币334,018,850,026元

8、存续期间：持续经营

9、联系人：蒋松云

10、联系电话：021-66105799

11、基金托管部人员情况

截至2010年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工133人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

12、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2010年6月，托管证券投资基金165只，其中封闭式9只，开放式156只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，

中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自 2004 年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得 23 项国内外大奖。

### （三）上市推荐人

申银万国证券股份有限公司

住所：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）54040596

客户服务电话：（021）962505

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

### （四）一级交易商

本基金申购赎回代办券商（一级交易商）名单如下：安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广发华福证券有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中原证券股份有限公司。

### （五）基金验资机构

安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法人代表：葛明

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：蒋燕华

## 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 2011 年 3 月 18 日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
资 产：	
银行存款	4,050,549.28
结算备付金	10,544,245.73
存出保证金	—
交易性金融资产	304,454,325.50
其中：股票投资	304,454,325.50
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	—
应收利息	131,635.12
应收股利	—
应收申购款	—
其他资产	—
资产总计	319,180,755.63
负债和所有者权益	本报告期末
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	79,634.94
应付托管费	15,926.98

应付销售服务费	0.00
应付交易费用	255,366.74
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
其他负债	80,289.92
负债合计	431,218.58
所有者权益：	
实收基金	320,363,407.00
未分配利润	-1,613,869.95
所有者权益合计	318,749,537.05
负债和所有者权益总计	319,180,755.63

注：1、截至 2011 年 3 月 18 日，基金份额净值 2.907 元，基金份额总额 109,638,513 份。

2、本报告期自 2011 年 1 月 30 日起至 2011 年 3 月 18 日止。本基金合同于 2011 年 1 月 30 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 2011 年 3 月 18 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	304,454,325.50	95.39%
	其中：股票	304,454,325.50	95.39%
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	14,594,795.01	4.57%
6	其他资产	131,635.12	0.04%
7	合计	319,180,755.63	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	914,166.00	0.29%
B	采掘业	67,624,758.00	21.22%
C	制造业	76,010,009.00	23.85%
C0	食品、饮料	8,647,979.00	2.71%
C1	纺织、服装、皮毛	3,781,527.00	1.19%
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	954,480.00	0.30%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,105,384.00	2.54%
C5	电子	975,733.00	0.31%
C6	金属、非金属	17,176,526.00	5.39%
C7	机械、设备、仪表	25,609,741.00	8.03%
C8	医药、生物制品	10,758,639.00	3.38%
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,286,114.00	3.85%
E	建筑业	6,339,780.00	1.99%
F	交通运输、仓储业	17,911,793.00	5.62%
G	信息技术业	10,112,307.00	3.17%
H	批发和零售贸易	8,381,427.00	2.63%
I	金融、保险业	83,128,093.00	26.08%
J	房地产业	8,589,901.00	2.69%
K	社会服务业	3,403,383.00	1.07%
L	传播与文化产业	2,287,062.00	0.72%
M	综合类	7,465,532.50	2.34%
	合计	304,454,325.50	95.52%

(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	601857	中国石油	2,598,700	30,066,959.00	9.43%
2	601288	农业银行	5,053,700	13,291,231.00	4.17%
3	601988	中国银行	3,525,400	11,387,042.00	3.57%
4	600028	中国石化	999,300	8,544,015.00	2.68%
5	601088	中国神华	272,100	7,722,198.00	2.42%
6	601628	中国人寿	344,000	7,199,920.00	2.26%
7	600036	招商银行	378,900	5,081,049.00	1.59%
8	601318	中国平安	91,600	4,491,148.00	1.41%
9	600000	浦发银行	308,400	3,978,360.00	1.25%
10	601328	交通银行	705,000	3,884,550.00	1.22%

(四) 按券种分类的债券投资组合

截至 2011 年 3 月 18 日, 本基金未持有债券。

(五) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2011 年 3 月 18 日, 本基金未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

1、自基金合同生效日至 2011 年 3 月 18 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	
2	应收证券清算款	
3	应收利息	131,635.12
4	应收股利	
5	合计	131,635.12

4、权证投资情况

截至 2011 年 3 月 18 日, 本基金未持有权证; 自基金合同生效日至 2011 年 3 月 18 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 2011 年 3 月 18 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 2011 年 3 月 18 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 2011 年 3 月 11 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申银万国证券股份有限公司。

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、赎回办理的场所

投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购、赎回代理券商提供的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：安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广发华福证券有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中原证券股份有限公司。本公司将适时增加或调整申购赎回代办证券公司，并及时公告。

### （二）申购、赎回的开放日和开放时间

#### 1、申购、赎回的开始时间

自 2011 年 3 月 25 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。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。

若上海证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日和具体业务办理时间进行相应调整并公告。

### （三）申购、赎回的数额限制

1、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；

2、基金管理人可以根据市场情况，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告。

### （四）申购、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。

基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的情况下、不违背上海证券交易所相关规则的情况下更改上述原则，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、赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者在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，投资者在提交赎回申请时，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

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

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。申购、赎回发生的现金替代款和现金差额分别于 T+1 日和 T+2 日交收，基金托管人根据注册登记机构的结算通知和基金管理人的划款通知办理资金的划拨。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、赎回的对价和费用

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×该证券参考价格×(1+现金替代溢价比例)

其中：“该证券参考价格”目前确定原则为：(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/跌停时，采用涨停/跌停价格；(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，采用前收盘价(考虑当日的除权除息等因素)。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

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参考价格可能有所差异。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：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格} \times 100\%}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}(\text{IOPV})}$$

参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值，如果上海证券交易所参考基金份额净值

计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### (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。

### 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	2011-3-21
基金名称	上证综指交易型开放式指数基金
基金管理公司名称	富国基金管理有限公司
一级市场基金代码	510211

2011年3月18日信息内容

现金差额	-170.45
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)	1453638.55
基金份额净值(单位:元)	2.907

2011年3月21日信息内容

预估现金部分(单位:元)	246.55
现金替代比例上限	50%
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

成分股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标记	现金替代溢价比例	固定替代金额
600000	浦发银行	1500	允许	10%	0
600006	东风汽车	700	允许	10%	0
600007	中国国贸	400	允许	10%	0
600011	华能国际	700	允许	10%	0
600015	华夏银行	800	允许	10%	0
600016	民生银行	2600	允许	10%	0
600018	上港集团	1100	允许	10%	0
600019	宝钢股份	1100	允许	10%	0
600020	中原高速	1100	允许	10%	0
600021	上海电力	800	允许	10%	0
600027	华电国际	1100	允许	10%	0
600028	中国石化	4700	允许	10%	0
600029	南方航空	700	允许	10%	0
600030	中信证券	800	允许	10%	0

600031	三一重工	400	允许	10%	0
600036	招商银行	1800	允许	10%	0
600048	保利地产	400	允许	10%	0
600050	中国联通	1300	允许	10%	0
600054	黄山旅游	200	允许	10%	0
600058	五矿发展	100	允许	10%	0
600061	中纺投资	300	允许	10%	0
600062	双鹤药业	200	允许	10%	0
600066	宇通客车	100	允许	10%	0
600068	葛洲坝	300	允许	10%	0
600085	同仁堂	100	允许	10%	0
600089	特变电工	200	允许	10%	0
600100	同方股份	200	允许	10%	0
600103	青山纸业	1000	允许	10%	0
600104	上海汽车	700	必须	0%	12915
600109	国金证券	300	允许	10%	0
600111	包钢稀土	100	允许	10%	0
600115	东方航空	800	允许	10%	0
600126	杭钢股份	900	允许	10%	0
600132	重庆啤酒	100	允许	10%	0
600143	金发科技	300	允许	10%	0
600150	中国船舶	100	允许	10%	0
600161	天坛生物	100	允许	10%	0
600166	福田汽车	200	允许	10%	0
600171	上海贝岭	600	允许	10%	0
600176	中国玻纤	100	允许	10%	0
600188	兖州煤业	300	允许	10%	0
600196	复星医药	300	允许	10%	0
600208	新湖中宝	700	允许	10%	0
600220	江苏阳光	600	允许	10%	0
600221	海南航空	500	允许	10%	0
600236	桂冠电力	800	允许	10%	0
600256	广汇股份	200	允许	10%	0
600270	外运发展	500	允许	10%	0
600271	航天信息	100	允许	10%	0
600276	恒瑞医药	100	允许	10%	0
600277	亿利能源	300	允许	10%	0
600282	南钢股份	1000	允许	10%	0
600307	酒钢宏兴	400	允许	10%	0
600309	烟台万华	200	允许	10%	0
600316	洪都航空	100	允许	10%	0
600320	振华重工	500	允许	10%	0
600348	国阳新能	300	允许	10%	0
600350	山东高速	800	允许	10%	0

600362	江西铜业	200	允许	10%	0
600369	西南证券	500	必须	0%	5935
600377	宁沪高速	600	允许	10%	0
600380	健康元	300	允许	10%	0
600395	盘江股份	100	允许	10%	0
600398	凯诺科技	600	允许	10%	0
600406	国电南瑞	100	允许	10%	0
600415	小商品城	200	允许	10%	0
600432	吉恩镍业	100	允许	10%	0
600489	中金黄金	200	允许	10%	0
600497	驰宏锌锗	100	允许	10%	0
600498	烽火通信	100	允许	10%	0
600500	中化国际	200	允许	10%	0
600508	上海能源	100	允许	10%	0
600510	黑牡丹	400	允许	10%	0
600518	康美药业	300	允许	10%	0
600519	贵州茅台	100	允许	10%	0
600535	天士力	100	允许	10%	0
600546	山煤国际	100	允许	10%	0
600547	山东黄金	200	允许	10%	0
600549	厦门钨业	100	允许	10%	0
600550	天威保变	200	允许	10%	0
600551	时代出版	200	允许	10%	0
600569	安阳钢铁	1000	允许	10%	0
600575	芜湖港	200	允许	10%	0
600585	海螺水泥	200	允许	10%	0
600588	用友软件	200	允许	10%	0
600597	光明乳业	400	允许	10%	0
600598	北大荒	300	允许	10%	0
600600	青岛啤酒	100	允许	10%	0
600601	方正科技	800	允许	10%	0
600606	金丰投资	500	允许	10%	0
600619	海立股份	400	允许	10%	0
600626	申达股份	500	允许	10%	0
600629	棱光实业	200	允许	10%	0
600648	外高桥	300	允许	10%	0
600652	爱使股份	700	允许	10%	0
600653	申华控股	900	允许	10%	0
600655	豫园商城	300	允许	10%	0
600660	福耀玻璃	300	允许	10%	0
600663	陆家嘴	200	允许	10%	0
600664	哈药股份	200	允许	10%	0
600665	天地源	800	允许	10%	0
600673	东阳光铝	200	允许	10%	0

600674	川投能源	200	允许	10%	0
600682	南京新百	300	允许	10%	0
600688	S 上石化	700	允许	10%	0
600690	青岛海尔	200	允许	10%	0
600694	大商股份	100	允许	10%	0
600697	欧亚集团	200	允许	10%	0
600703	三安光电	100	允许	10%	0
600718	东软集团	200	允许	10%	0
600724	宁波富达	600	允许	10%	0
600733	S 前锋	200	允许	10%	0
600737	中粮屯河	200	允许	10%	0
600739	辽宁成大	100	允许	10%	0
600741	华域汽车	400	必须	0%	5124
600750	江中药业	100	允许	10%	0
600760	中航黑豹	200	允许	10%	0
600770	综艺股份	200	允许	10%	0
600775	南京熊猫	500	允许	10%	0
600780	通宝能源	700	允许	10%	0
600783	鲁信创投	100	允许	10%	0
600787	中储股份	400	允许	10%	0
600795	国电电力	1200	允许	10%	0
600798	宁波海运	800	允许	10%	0
600804	鹏博士	700	允许	10%	0
600809	山西汾酒	100	允许	10%	0
600812	华北制药	300	允许	10%	0
600832	东方明珠	400	允许	10%	0
600859	王府井	100	允许	10%	0
600861	北京城乡	400	允许	10%	0
600871	S 仪化	400	允许	10%	0
600875	东方电气	200	允许	10%	0
600886	国投电力	500	允许	10%	0
600887	伊利股份	100	允许	10%	0
600893	航空动力	100	允许	10%	0
600900	长江电力	1100	允许	10%	0
600970	中材国际	100	允许	10%	0
600987	航民股份	500	允许	10%	0
600998	九州通	300	允许	10%	0
600999	招商证券	300	允许	10%	0
601001	大同煤业	200	允许	10%	0
601005	重庆钢铁	1000	允许	10%	0
601006	大秦铁路	800	允许	10%	0
601008	连云港	700	允许	10%	0
601009	南京银行	800	允许	10%	0
601018	宁波港	1500	允许	10%	0

601088	中国神华	1300	允许	10%	0
601098	中南传媒	300	允许	10%	0
601099	太平洋	400	允许	10%	0
601106	中国一重	600	允许	10%	0
601111	中国国航	800	允许	10%	0
601117	中国化学	500	允许	10%	0
601158	重庆水务	500	允许	10%	0
601166	兴业银行	600	允许	10%	0
601168	西部矿业	300	允许	10%	0
601169	北京银行	1000	允许	10%	0
601179	中国西电	500	允许	10%	0
601186	中国铁建	700	允许	10%	0
601268	二重重装	300	允许	10%	0
601288	农业银行	23800	允许	10%	0
601299	中国北车	600	允许	10%	0
601318	中国平安	400	允许	10%	0
601328	交通银行	3300	允许	10%	0
601369	陕鼓动力	200	允许	10%	0
601377	兴业证券	400	允许	10%	0
601390	中国中铁	1100	允许	10%	0
601398	工商银行	100	必须	0%	426
601588	北辰实业	1100	允许	10%	0
601600	中国铝业	800	允许	10%	0
601601	中国太保	500	允许	10%	0
601607	上海医药	300	允许	10%	0
601618	中国中冶	1200	允许	10%	0
601628	中国人寿	1600	允许	10%	0
601666	平煤股份	200	允许	10%	0
601668	中国建筑	1900	允许	10%	0
601678	滨化股份	300	允许	10%	0
601688	华泰证券	500	允许	10%	0
601699	潞安环能	100	允许	10%	0
601717	郑煤机	100	允许	10%	0
601718	际华集团	700	允许	10%	0
601727	上海电气	800	允许	10%	0
601766	中国南车	800	允许	10%	0
601777	力帆股份	300	允许	10%	0
601788	光大证券	400	允许	10%	0
601801	皖新传媒	200	允许	10%	0
601808	中海油服	300	允许	10%	0
601818	光大银行	4200	允许	10%	0
601857	中国石油	12200	允许	10%	0
601866	中海集运	700	允许	10%	0
601877	正泰电器	200	允许	10%	0

601888	中国国旅	100	允许	10%	0
601898	中煤能源	800	允许	10%	0
601899	紫金矿业	1000	允许	10%	0
601918	国投新集	300	允许	10%	0
601919	中国远洋	500	允许	10%	0
601939	建设银行	2200	允许	10%	0
601958	金钼股份	300	允许	10%	0
601988	中国银行	16600	允许	10%	0
601989	中国重工	600	必须	0%	7914
601991	大唐发电	600	允许	10%	0
601998	中信银行	3000	允许	10%	0

#### （八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购、赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
- 2、因特殊原因（如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、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4、因上海证券交易所、注册登记机构等异常情况无法正常办理申购、赎回；
- 5、接受某些申购或赎回申请将明显损害其他基金份额持有人的利益时；
- 6、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。

在发生上述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 1-4 项情形之一时，基金管理人应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）基金的非交易过户等其他业务

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

## 十四、备查文件目录

- (一) 中国证监会批准上证综指交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《上证综指交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 注册登记协议
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 富国基金管理有限公司募集设立上证综指交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

富国基金管理有限公司

二〇一一年三月二十二日

## 附件：基金合同摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (17) 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、赎回等注册登记手续；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的

利益；

(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、谨慎勤勉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基金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，不得利用基金财产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) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 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；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

(13) 按《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基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之对价；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托

管人；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 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实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金投资者；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，根据托管协议的约定定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### 4、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，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) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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，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；
- (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予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 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对价；
- (15) 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；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 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；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 5、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、基金销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。

## 6、基金份额持有人的义务

(1) 遵守《基金合同》；

(2) 缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(3) 在其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《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5) 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金（即“富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接

基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

#### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）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）；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- （14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事

项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金管理人、交易所和注册登记机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（含 10%）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。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### （三）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、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

（3）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；

（4）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；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但决定更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者出具的身份证明及持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的身份证明及委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；在法律法规

或监管机构允许的情况下，在符合会议通知载明形式的前提下，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

(4) 上述第（3）项中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代理人，同时提交的身份证明、持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，也可以采用网络、电话或其他方式进行表决。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 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至少 30 天前提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

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。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于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进行解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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，或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。法律法规另有规定除外。

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前 30 日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。

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。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三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并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为

限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，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（若由基金托管人召集，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。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人。

### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。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。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### (一) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；

2、本基金收益分配采用现金方式；

3、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### (二) 基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率，并计算基金净

值增长率与标的指数净值增长率的差额，当差额超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

2、根据前述收益分配原则确定收益评价日本基金的可分配收益、收益分配比例及收益分配数额。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益评价日的基金可分配收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定报刊及基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

在分配方案公布后，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。基金红利发放日距离收益分配基准日（即收益评价日）的时间不得超过 15 个工作日。

## 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数使用费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，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 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （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的最小化。

#### （二）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、基金规模或市场变化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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### （三）投资策略

本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## 1、最优化目标组合的构建

### （1）股票预筛选

由于上证指数包含在上海证券交易所上市交易的所有 A 股和 B 股股票，本基金在最优化抽样前，根据所有股票可投资性、流动性、行业代表性等进行预筛选。

### （2）最优化抽样

结合指数的特点，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素，在长期稳定的风险模型的基础上进行最优化抽样，得到目标组合。

### （3）调整频率

本基金采用最优化抽样复制方法跟踪标的指数，基金所构建的目标组合将根据标的指数成分股及其权重进行相应的调整，以保证基金跟踪偏离和跟踪误差的最小化。

#### 1) 定期半年度调整

本基金构建的目标组合为根据最优化抽样方法得到的最优化抽样组合，将每半年根据上述最优化抽样复制方法对目标组合进行定期调整。

#### 2) 不定期调整

根据上证综合指数编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整。本基金将紧密跟踪标的指数和最优化目标组合之间的差异，如果由于标的指数自身的较大变化或者其他原因引起的较大幅度的偏差时，需要及时根据最优化抽样复制方法调整目标组合。

## 2、其他金融工具投资策略

本基金基于流动性管理的需要，可以少量投资于新股、期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。该部分资产比例不高于基金资产净值的 5% 。

### （四）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

a、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

b、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

c、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、标的指数成分股调整等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

#### （五）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、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债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

对于因上述 5、6 项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

#### （一）基金资产净值的计算方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

（2）交易所上市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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生

了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市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得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据基金法，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## （二）基金资产净值的公告方式

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当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。

基金管理人应当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款规定的市场交易日的次日，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媒体和基金管理人网站上。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和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：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，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清算。

2、基金财产清算小组组成：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、基金财产清算小组职责：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。

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意

见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

(三) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

(四) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(五) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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进行公告。

(六) 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。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。