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）

2015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。

本基金简称自2010年4月30日起,由“友邦华泰上证红利ETF”更名为“华泰柏瑞上证红利ETF”,基金名称、代码保持不变。基金管理人更名等的详细内容见我公司2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

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2015年11月16日,有关财务和业绩表现数据截止日为2015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:华泰柏瑞基金管理有限公司
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
办公地址: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:汪莹白
联系电话:400-888-0001,021-38601777

2、股权结构: PineBridge Investments LLC 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。

杨智雅女士:董事,硕士,曾就职于升强工业股份有限公司,华之杰国际商业顾问有限公司,1992年4月至1996年12月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理,1997年1月至2001年7月任AIG友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理,2001年7月至2010年2月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理,2010年2月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

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。

Rajeev Mittal先生: 董事,学士,1992年加入美国国际集团,2009—2011年担任柏瑞投资(欧洲分公司)总经理,新兴市场投资主管,全球固定收益研究团队主管和行政总裁(欧洲分公司),2011年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁(亚洲,日本除外)、总经理、新兴市场投资总管,全球固定收益研究团队主管。

韩勇先生:董事,博士,曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会,2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

朱小平先生:独立董事,硕士,1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生:独立董事,1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生:独立董事,博士,1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师,1997-1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理,1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理,2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁,2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

杨科先生:独立董事,学士,2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。

2、监事会成员

严玉珍女士: 监事长, 学士,1987年1月至1988年9月任罗兵咸永道 (前容永道会计)高级稽核员,1988年12月至1990年4月任香港电讯(前大东电报)管理会计,1990年5月至1996年11月任宝达证券(施罗德集团)副财务总监,1996年12月至2007年9月任施罗德投资管理(香港)有限公司财务董事,2007年9月至2008年6月任交银施罗德基金管理有限公司高级总经理顾问,2008年7月至2012年9月任施罗德投资管理 (香港)有限公司首席营运官,2012年9月至今任柏瑞投资亚洲有限公司首席财务官。

王桂芳女士:监事,硕士,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年至今任华泰证券有限责任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月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,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基金经理,2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证 500 ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。

童辉先生: 监事, 硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员,1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理,2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,现任信息技术与电子商务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生:总经理,博士,曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会,2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

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月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士:副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司(BGI)担任投资经理,2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年8月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理,2013年10月起任公司副总经理,2014年12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学, MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

高山先生:副总经理,博士。2001.5-2013.7任职于全国社会保障基金理事会投资部,任处长;2013.7起加入华泰柏瑞基金管理有限公司。本科毕业于山东大学经济管理学院,硕士毕业于中国人民银行研究生部, 博士毕业于财政部财政科学研究所研究生部。

4、本基金基金经理

柳军先生:简历同上。

龚丽丽女士,上海交通大学数学系硕士。2011年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任指数投资部研究员、基金经理助理。2015年6月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

历任本基金基金经理:

张娅女士,2006年11月17日至2015年6月12日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主席:总经理韩勇先生;

成员:副总经理王溯舸先生;副总经理田汉卿女士;副总经理高山先生;总经理助理董元星先生;投资部总监方伦煜先生;投资部总监吕慧建先生。

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:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[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,2015年6月30日,本集团总资产5.2212万亿元人民币,高级法下资本充足率12.40%,权重法下资本充足率11.77%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工60人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格, 成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行, 拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

经过十三年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截止9月末新增托管公募开放式基金38只,新增首发公募开放式基金托管规模755.66亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入27.90亿元,同比增长61.43%,托管资产余额5.91万亿元,同比增长100.07%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约“壹基金”公益资金托管,为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖;四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长。大学本科毕业,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行长助理、副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行长助理,2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2015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(含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金)、招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞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、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银保本二号混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德新成长股票投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型投资基金、宝盈瑞祥养老混合型证券投资基金和银华永益分级债券型证券投资基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、中银新经济灵活混合型证券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金、嘉实全球互联网股票型证券投资基金、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金、博时上证50交易型开放式指数证券投资基金、博时上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时新趋势灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金成立、鹏华中证新能源指数分级证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、博时证金宝货币市场基金、汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金、国金通用众赢货币市场证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、中银互联网+股票型证券投资基金、鹏华新丝路指数分级证券投资基金、鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金共128只开放式基金及其它托管资产,托管资产为59,100.930亿元人民币。

(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层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室,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、分行资产托管业务主管部门,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,及时发现内部控制缺陷,提出整改方案,跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,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。

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。内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5)适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要,并能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修订和完善。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。业务营运、稽核监察等相关室,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。

(7)重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8)制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

(9)成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的成本实现有效控制。

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》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度,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采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备,同时,每日实时对托管业务数据库进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理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。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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、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,基金托管人应报告中国证监会。

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)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
电话:(0755)82825551
传真:(0755)82558355
客服电话:400-800-1001
公司网址:www.essence.com.cn

2)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
联系人:王星
电话:(022)28451922
传真:(022)28451892
客服电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com

3)财通证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
联系人: 夏吉慧
电话:(0571)87925129
传真:(0571)87818329
客服电话:96336(浙江),400-869-6336(全国)
公司网址:www.ctsec.com

4)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:奚博宇
电话:(021)68751860
传真:(021)68751151
客服电话:95579或4008-888-999
公司客服网址:www.95579.com

5)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市福山路500号26楼
办公地址:上海市福山路500号26楼
法定代表人:姚文平
联系人:朱磊
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客服电话:400-888-8128
公司网址:www.tebon.com.cn

6)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:胡月茹
电话:(021)63325888
传真:(021)63327888
客服电话:95503
公司网址:www.dfzq.com.cn

7)东莞证券股份有限公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心22楼
法定代表人:张运勇
联系人:唐俊
电话:(0769)22119348
传真:(0769)22119423
客服电话:95328
公司网址:www.dgzq.com.cn

8)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
联系人:王一彦
电话:021-20333333
传真:021-50498825
客服电话: 95531或400-8888-588
公司网址:www.longone.com.cn

9)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
办公地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:(0512)65581136
传真:(0512)65588021
客服电话:400-860-1555或96288
公司网址:www.dwzq.com.cn

10)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:(010)66555316
传真:(010)66555246
客服电话:400-888-8993
公司网址:www.dxzq.net

11)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:郭军瑞
电话:(0731)85832503
传真:(0731)85832214
客服电话:95571
公司网址:www.foundersc.com

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:薛峰
联系人:周洁瑾
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
客服电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

13)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:(020)87555888
传真:(020)87555305
客服电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

14)国都证券股份有限公司
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
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:(010)84183333
传真:(010)84183311-3389
客服电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com

15)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:万建华
联系人: 芮敏祺
电话:(021)38676666
传真:(021)38670666
客服电话:95521
公司网址:www.gtja.com

16)国信证券股份有限公司
注册地址:广东省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:广东省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:周杨
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133952
客服电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

17)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:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:(021)23219000
传真:(021)23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com

18)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编:830002)
法定代表人:李季
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085195
客服电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com

19)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
联系人:刘闻川
电话:68778790
传真:68777992
客服电话:4008209898
公司网址:www.cnhbstock.com

20)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
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:庞晓云
电话:(0755)82569143
传真:(0755)82492962
客服电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

21)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:李铮
电话:(025)52310585
传真:(025)52310586
客服电话:400-828-5888
公司网址:www.njzq.com.cn

22)平安证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:广东省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:杨宇翔
联系人:吴琼
电话:(0755)22621866
传真:(0755)82400862
客服电话:95511*8
公司网址:stock.pingan.com

23)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:(0531)68889155
传真:(0531)68889752
客服电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn

24)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:郭熠
电话:(0351)8686659
传真:(0351)8686619
客服电话:400-666-1618、(0351)95573
公司网址:www.i618.com.cn

25)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
办公地址:上海市西藏中路336号华旭大厦
法定代表人:郁忠民
联系人:许曼华
电话:(021)53519888
传真:(021)53519888
客服电话:400-891-8918,(021)962518
公司网址:www.962518.com

26)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:黄莹
电话:(021)33389888
传真:(021)33388224
客服电话:95523或4008895523
公司网址:www.swhysc.com

27)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:甘蕾
电话:(020)38286026
传真:(020)37865008
客服电话:400-888-8133
公司网址:www.wlzq.com.cn

28)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:(023)63786141
传真:(023)63810422
客服电话:400-809-6096
公司网址:www.swsc.com.cn

29)湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com

30)新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:卢珊
电话:(010)83561072
传真:(010)83561094
客服电话:400-698-9898
公司网址:www.xsdzq.cn

31)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:鹿馨方
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com

32)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼
法定代表人:兰荣
联系人:夏中苏
电话:(0591)38281963
客服电话:400-888-8123
公司网址:www.xyzq.com.cn

33)招商证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:广东省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:林生迎
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82960141
客服电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn

34)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:李凌芳
电话:(021)64718888
传真:(0571)87901913
客服电话:(0571)95345
公司网址:www.stocke.com.cn

35)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:陈有安
联系人:宋明
电话:(010)66568450
传真:(010)66568990
客服电话:400-888-8888
公司网址:www.chinastock.com.cn

36)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:王宜四
联系人:戴蕾
电话:(0791)86768681
传真:(0791)86770178
客服电话:400-886-6567
公司网址:www.avicsec.com

37)中国国际金融股份有限公司
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:丁学东
联系人:罗文雯
电话:(021)58763575
传真:(021)68875123
客服电话:(021)58796226-3736
公司网址:www.cicc.com.cn

38)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
联系人:刘毅
电话:(0755)82023442
传真:(0755)82026539
客服电话:95532
公司网址:www.china-invs.cn

39)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市安立路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:王常青
联系人:权唐
电话:400-8888-108
传真:(010)65182261
客服电话:400-888-8108
公司网址:www.csc108.com

40)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:(0532)85022326
传真:(0532)85022605
客服电话:95548
公司网址:www.citicssd.com

41)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:腾艳
电话:(010)60838888
传真:(010)60833739
客服电话:95558
公司网址:www.cs.ecitic.com

42)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程月艳、范春艳
电话:(0371)69099882
传真:(0371)65585899
客服电话:95377
公司网址:www.ccnew.com

(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:金颖
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)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888传真:(021)23238800联系人:单峰
经办注册会计师:薛竞、单峰

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2015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	614,502,609.15	97.69
	其中:股票	614,502,609.15	97.69
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	14,395,275.64	2.29
7	其他资产	134,713.71	0.02
8	合计	629,032,598.50	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	–	–
B	采掘业	51,044,039.83	8.13
C	制造业	173,076,959.65	27.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,485,754.26	14.25
E	建筑业	10,390,262.06	1.65
F	批发和零售业	21,477,916.64	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	71,055,389.37	11.31
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	181,252,107.08	28.86
K	房地产业	16,720,180.26	2.66
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	614,502,609.15	97.84

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	600507	方大特钢	7,393,689	38,668,993.47	6.16
2	601010	文峰股份	3,234,626	21,477,916.64	3.42
3	601398	工商银行	4,916,387	21,238,791.84	3.38
4	600000	浦发银行	1,112,579	18,502,188.77	2.95
5	601328	交通银行	2,860,900	17,394,272.00	2.77
6	600036	招商银行	964,055	17,131,257.35	2.73
7	600795	国电电力	4,235,782	17,070,201.46	2.72
8	600177	雅戈尔	1,372,757	16,720,180.26	2.66
9	600481	双良节能	2,038,810	16,718,242.00	2.66
10	601988	中国银行	4,489,860	16,702,279.20	2.66

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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	116,146.18
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,443.37
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	15,124.16
8	其他	–
9	合计	134,713.71

4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

5)报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

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2015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	95.58%	2.16%	94.33%	2.17%	1.25%	-0.01%
2010年	-21.07%	1.45%	-22.41%	1.46%	1.34%	-0.01%
2011年	-16.83%	1.16%	-18.47%	1.17%	1.64%	-0.01%
2012年	9.63%	1.13%	7.06%	1.14%	2.57%	-0.01%
2013年	-8.85%	1.52%	-11.78%	1.53%	2.93%	-0.01%
2014年	56.60%	1.14%	51.52%	1.15%	5.08%	-0.01%
自基金合同生效以来	89.40%	2.05%	82.55%	2.07%	6.85%	-0.02%

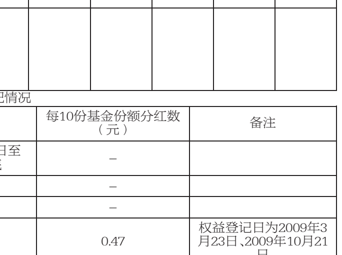
2、基金的收益分配情况

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	0.47	权益登记日为2009年3月23日、2009年10月21日
2010年	0.41	权益登记日为2010年7月14日、10月21日
2011年	0.35	权益登记日为2011年10月21日
2012年	0.41	权益登记日为2012年12月17日
2014年	0.59	权益登记日为2014年1月20日
2015年	0.80	权益登记日为2015年1月19日
合计	3.03	

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



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:

$H = E \times 0.50\% \div 当年天数$

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:

$H = E \times 0.10\% \div 当年天数$

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:

[illegible]

[illegible]

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

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、总经理及其他高级管理人员、本基金基金经理、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、“五、相关服务机构”部分,更新了“一级交易商”的相关信息;

4、“十、基金的投资”部分,对基金投资组合报告作了更新。

5、“十一、基金的业绩”部分,对基金投资业绩作了更新。

6、“二十四、其他应披露事项”部分,根据前次招募说明书(更新)公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一五年十二月三十日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加农业银行定期定额申购费率优惠活动的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)将自2016年1月1日起参加中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)定期定额申购费率优惠活动。具体事宜公告如下:

一、 适用基金

序号	基金名称	基金代码
1	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金	460001
2	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	460005
3	华泰柏瑞货币市场证券投资基金A级	460006
4	华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金	460007
5	华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金	460009
6	华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金	460010
7	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	460220
8	华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	460300

二、 适用投资者范围

凡在农业银行办理上述基金定期定额申购业务的投资者。

三、 适用期限

2016年1月1日至2016年12月31日。

四、 活动内容

2016年1月1日至12月31日期间, 通过农业银行任一渠道新签约办理上述基金定投(含智能定投)的客户,在定投(或智能定投)申购成功扣款一次后,从第二次申购开始享有申购费率5折优惠。基金申购费率为固定金额的不享受此费率优惠。具体业务办理规定及优惠活动相关规定以农业银行的公告为准。

五、重要提示

投资者若有疑问,可通过以下途径咨询有关情况:

1、中国农业银行股份有限公司
客服电话:95599
公司网址:www.abchina.com
2、华泰柏瑞基金管理有限公司
公司网址:www.huatai-pb.com
客服电话:400-888-0001、(021)38784638

风险提示:本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于上述基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015年12月30日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加浙商银行网上银行与定期定额申购费率优惠活动的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)将自2016年1月1日起参加浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)网上银行与定期定额申购费率优惠活动。具体事宜公告如下:

一、 适用基金

序号	基金代码	基金全称简称
1	460001	华泰柏瑞盛世中国混合
2	460002	华泰柏瑞积极成长混合
3	460005	华泰柏瑞价值增长混合
4	460007	华泰柏瑞行业领先混合
5	460009	华泰柏瑞量化先行混合
6	460010	华泰柏瑞亚洲领导企业混合
7	460220	华泰柏瑞中小盘ETF联接
8	460300	华泰柏瑞沪深300ETF联接
9	519519	华泰柏瑞稳本增利A

二、适用投资者范围

凡在浙商银行各网点柜面办理上述基金定期定额申购业务,或通过浙商银行网上银行办理上述基金的申购或定期定额申购业务的投资者。

三、适用期限

2016年1月1日至2017年12月31日(截至前述期间内上海、深圳证券交易所最后一个交易日的法定交易时间)。

四、活动内容

1、投资者通过浙商银行网上银行申购或定期定额申购上述基金,若基金申购费率高于0.6%的,按4折优惠,最低可优惠至0.6%;基金申购费率原已达到或低于0.6%的,则按原费率执行,不再享有费率折扣。

2、投资者通过浙商银行柜面定期定额申购上述基金,若基金申购费率高于0.6%,按8折优惠,最低可优惠至0.6%;基金申购费率原已达到或低于0.6%,则按原费率执行,不再享有费率折扣。

五、重要提示

投资者若有疑问,可通过以下途径咨询有关情况:

1、浙商银行股份有限公司
公司网址: www.czbank.com
客服电话: 95527
2、华泰柏瑞基金管理有限公司
公司网址:www.huatai-pb.com
客服电话:400-888-0001、(021)38784638

风险提示:本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于上述基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015年12月30日

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行股票的公告

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理的华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金参加了二六三(002467)、劲胜精密(300083)非公开发行股票的认购。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关规定,本公司现将华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金获配非公开发行股票情况披露如下:

基金名称	华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金	
获配股票	二六三(002467)	劲胜精密(300083)
获配数量(股)	9,433,962	8,147,916
总成本(元)	119,999,996.64	259,999,999.56
总成本占基金净资产(%)	2.95%	6.40%
账面价值(元)	120,283,015.50	260,488,874.52
账面价值占基金净资产(%)	2.96%	6.41%
限售期	12个月	12个月

注:基金资产净值、账面价值为2015年12月28日数据。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015 年12月30日