中证南方小康产业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

南方基金管理有限公司

二〇一〇年十月二十七日

一、重要声明与提示

《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称"本公告")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,中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")管理人南方基金管理有限公司的董事会及董事保证本公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公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。

中国证监会、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。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》等报刊及南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)上的《中证南方小康产业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:小康 ETF

2、二级市场交易代码:510160

3、基金申购、赎回简称:小康申赎

4、申购、赎回代码:510161

5、2010 年 10 月 25 日基金份额总额:1,634,057,409 份

6、2010 年 10 月 25 日基金份额净值:0.4666 元

7、本次上市交易份额:1,634,057,409 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:2010 年 11 月 1 日

10、基金管理人:南方基金管理有限公司

11、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

12、上市推荐人:国泰君安证券股份有限公司

13、申购赎回代理券商(以下简称"一级交易商"):华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司。

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:中国证券监督管理委员会 2010 年 6 月 30 日证监许可[2010]892 号。

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:2010 年 7 月 26 日至 2010 年 8 月 20 日。其中,网下现金认购的日期为 2010 年 7 月 26 日至 2010 年 8 月 20 日,网下股票认购的日期为 2010 年 7 月 26 日至 2010 年 8 月 20 日,网上现金认购的日期为 2010 年 8 月 18 日至 2010 年 8 月 20 日。

5、发售价格:人民币 1.00 元。

6、发售期限:网下现金认购 20 个工作日,网下股票认购 20 个工作日,网上现金认购 3 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、发售机构:

(1)直销机构

投资者可以通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。

(2)代销机构

同时办理本基金的网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构为:华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中航证券有限公司(原江南证券有限责任公司)、德邦证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、江海证券有限公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司等。

参与网下现金认购的发售代理机构为:恒泰证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司等。

本基金网上现金发售代理机构为,国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、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、西南证券股份有限公司、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、山西证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、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、国联证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、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、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、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、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、金元证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、中航证券有限公司(原江南证券有限责任公司)、第一创业证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、联讯证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、江海证券有限公司、银泰证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司、爱建证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、天风证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、北京高华证券有限责任公司、华创证券有限责任公司等。

(二)基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2010]892 号文批准,自 2010 年 7 月 26 日起公开募集,截止 2010 年 8 月 20 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,本次募集的募集金额总额为 656,793,485 元人民币(含所募集股票市值),折合基金份额 656,793,485 份;经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计 6,396 元人民币,折合基金份额 6,396 份,归基金份额持有人所有。网上现金认购和通过发售代理券商进行网下现金认购的有效认购资金已登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息共计 40,005.76 元,计入基金财产。募集资金已于 2010 年 8 月 26 日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,募集段票已于 2010 年 8 月 25 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。

本次募集有效认购总户数为 6,855 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算,募集期募集金额(含所募集股票市值)及利息结转的基金份额共计 656,799,881 份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理有限公司基金从业人员没有认购本基金。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,不从基金资产中支付。

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《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于 2010 年 8 月 27 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《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,南方基金管理有限公司(下简称"本基金管理人")确定 2010 年 10 月 15 日为中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。当日中证南方小康产业指数收盘值为 4488.55 点,本基金资产净值为 733,456,297.82 元,折算前基金份额总额为 656,799,881.00 份。

根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 2.48791254,折算后基金份额总额为 1,634,057,409.00 份,折算后基金份额净值为 0.4489 元,基金份额累计净值为 1.1168 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 2010 年 10 月 18 日完成了变更登记,折算后的基金份额计算至整数位(小数部分舍去,舍去部分计入基金财产),投资者可以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[2010]190 号

2、上市交易日期:2010 年 11 月 1 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:小康 ETF

5、二级市场交易代码:510160

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:小康申赎

7、申购、赎回代码:510161

投资者应当在本基金指定的一级交易商(申购赎回代理券商)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华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司。本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商,并及时公告。

8、本次上市交易份额:1,634,057,409 份

9、本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 2010 年 10 月 25 日,本基金份额持有人户数为 6,855 户,平均每户持有的基金份额为 238,374.53 份。

(二)持有人结构

截至 2010 年 10 月 25 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 892,464,225 份,占基金总份额的 54.62%%;个人投资者持有的基金份额为 741,593,184 份,占基金总份额的 45.38%%。

(三)前十名基金份额持有人情况

截至 2010 年 10 月 25 日,前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	平安证券有限责任公司	124,400,602	7.61
2	红塔证券股份有限公司	124,395,627	7.61
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	99,517,991	6.09
4	渤海证券股份有限公司	49,760,738	3.05
5	东莞证券-招行-旗峰 1 号策略精选集合资产	49,760,241	3.05
6	中国银河证券股份有限公司	49,758,250	3.05
7	光大证券-光大银行-光大阳光基中宝(阳光 2 号二期)集合资产管理计划	49,758,250	3.05
8	民生证券有限责任公司	49,758,250	3.05
9	太平人寿保险有限公司-传统-普通保险产品-022L-CT001 沪	49,757,750	3.05
10	安信证券股份有限公司	37,317,690	2.28

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称:南方基金管理有限公司

2、法定代表人:吴万善

3、总经理:高良玉

4、注册资本:1.5 亿元人民币

5、住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

6、设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]4 号

7、工商登记注册的法人营业执照文号:440301103129537

8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

9、股权结构:华泰证券股份有限公司 45%;深圳市投资控股有限公司 30%;厦门国际信托有限公司 15%;兴业证券股份有限公司 10%。

10、内部组织结构及职能:

委员会名称	职责
投资决策委员会	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	研究制定风险管理政策和制度,提出重大风险的解决方案,指导和监督各职能部门开展风险管理工作
部门名称	职能定位
投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户投资管理部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
数量化投资部	负责投资策略的量化测算、数量化投资、投资风险监控与业绩归因分析
养老金业务部	负责企业年金基金的市场开拓与服务
机构业务部	负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务工作
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
营销策划部	开展营销宣传和活动策划;负责营销材料制作;开展媒体宣传和公关维护工作;为销售前台提供营销支持
规划发展部	进行营销战略规划及销售体系规划;负责公司形象 VI 体系的管理和应用;开展公司社会公益事业建设
市场管理部	构建公司渠道营销服务体系,管理和支持区域营销中心的业务开展;进行公募基金、一对多专户产品及其他类型产品的合作渠道开发、维护和管理;促进公司上述基金及其他类型产品的销售
东部营销中心	负责所在区域公募基金、一对多专户等产品的销售工作及区域内代销渠道机构的维护和服务
北部营销中心	
西部营销中心	
广州营销中心	
深圳营销中心	
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
客户服务部	搭建分级客户服务体系;运用多形式服务手段,建立客户沟通平台;编辑服务咨询;为公司营销提供服务支持
合肥分公司	CALL-CENTER 客户营销及服务中心
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理
风险管理部	投资运作风险管理体系的建设;投资运作中的风险识别、评估、控制和应急处理;投资业绩的归因分析及评判
交易管理部	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控
信息技术部	负责信息技术平台建设,保障业务开展
运作保障部	负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露
人力资源部	负责人力资源管理与服务,使公司获取并保持人力资源竞争优势
综合管理部	负责办公管理、财务管理、后勤保障
党群工作部	负责党务及共青团、工会工作
基建办	负责公司办公大楼的基建工作
北京分公司	作为公司在北京地区的业务窗口
上海分公司	作为公司在上海地区的业务窗口

11、人员情况:

截止到 2010 年 9 月底,本公司共有员工 343 人,其中博士 12 人,硕士 176 人,本科 143 人,其他 12 人。

12、信息披露负责人:鲍文革

咨询电话:400-889-8899

13、基金管理业务情况简介:

截至 2010 年 9 月底,南方基金管理有限公司旗下共管理 22 只开放式基金和 2 只封闭式基金及多只社保投资组合和企业年金投资组合,管理总资产规模超过 1700 多亿元人民币,旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳式号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方 300、南方 500、深成 ETF、南方深成、南方全球、南方策略、小康 ETF 和南方小康;封闭式基金有基金开元和基金天元;以及多个全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

7、本基金基金经理简介

杨德龙先生,北京大学经济学硕士、清华大学工学学士,具有基金从业资格。2006 年加入南方基金,现任南方基金研究部高级策略分析师、行业高级研究员。

柯晓先生,美国纽约大学工商管理硕士、13 年证券从业经历,具有基金从业资格。曾先后任职于美国美林证券公司、招商证券。2006 年加入南方基金,现任南方基金首席产品设计师。

(二)基金托管人

1、基金托管人概况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间:1984 年 1 月 1 日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币 334,018,850,026 元

联系电话:010-66105799

联系人:蒋松云

2、主要人员情况

截至 2010 年 6 月末,中国工商银行资产托管部共有员工 121 人,平均年龄 30 岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

3、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"、五届《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

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

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-177

客服电话:4008888666

联系人:芮敏祺

公司网站:http://www.gtja.com

(四)一级交易商

1、华泰证券股份有限公司

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:李杰

联系电话:025-83290838

客服电话:95597

公司网站:www.chinatai.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:上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-177

客服电话:4008888666

联系人:芮敏祺

公司网站:www.gtja.com

3、中国建银投资证券有限责任公司

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 层至 20 层

办公地址: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 层至 20 层

法定代表人:杨明辉

联系人:杨瑞芳

联系电话:0755-82026511

客服电话:400-600-8008

公司网站:www.cjis.cn

4、光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人:徐浩明

联系人:郑晨

联系电话:021-22169999

客服电话:10108998

公司网站:www.ebscn.com

5、渤海证券股份有限公司

办公地址:天津市南开区宾水西道 8 号

注册地址:天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人:张志军

联系人:王兆权

联系电话:022-28451861

客服电话:4006515988

公司网站:www.lhzq.com

6、平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人:杨宇翔

联系人:周鹏

联系电话:0755-22626172

客服电话:4008816168

公司网站:http://www.pingan.com

7、中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区前哨路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)

办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人:张智河

联系人:吴忠超

联系电话:0532-85022326

客服电话:0532-96577

公司网站:www.zxwt.com.cn

8、红塔证券股份有限公司

注册地址:云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址:云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人:况雨林

联系人:刘晓明

联系电话:0871-3577888

公司网站:http:// www.hongtastock.com

9、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

法定代表人:宫少林

联系人:黄健

联系电话:0755-82943666

客服电话:95565 ,4008888111

公司网站:www.newone.com.cn

10、国联证券股份有限公司

注册地址:江苏省无锡市县前东街 168 号

法定代表人:雷建辉

联系人:徐欣

联系电话:0510-82831662

客服电话:0510-82588168

公司网站:www.glsc.com.cn

11、兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路 268 号

办公地址:浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人:兰荣

联系人:谢高得

联系电话:021-38565785

客服电话:4008888123

公司网站:www.xyzq.com.cn

12、齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经十路 128 号

办公地址:山东省济南市经十路 128 号

法定代表人:李玮

联系人:傅咏梅

联系电话:0531-81283728

客服电话:95538

公司网站:www.qlzq.com.cn

13、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:顾伟国

客服电话:4008-888-888

公司网站:www.chinastock.com.cn

14、华泰联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址:深圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦 24、25 楼

法定代表人:马昭明

联系人:庞晓芸

联系电话:0755-82492000

客服电话:95513

公司网站:www.lhzq.com

(五)验资机构

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 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

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

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,不从基金资产中支付。

(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 2010 年 10 月 25 日资产负债表如下:

资 产	期末余额(元)	负债和所有者权益	期末余额(元)
资 产:		负债:	
银行存款	34,371,608.53	短期借款	
结算备付金	9,063,818.92	交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	712,576,738.19	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	712,576,738.19	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	239,284.48
基金投资		应付托管费	47,856.90
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	505,420.57
应收证券清算款	7,192,676.84	应付税费	
应收利息	39,739.28	应付利息	
应收股利	632.80	应付利润	
应收申购款		其他负债	64,357.05
其他资产		负债合计	856,919.00
		所有者权益:	
		实收基金	656,799,881.00
		未分配利润	105,588,414.56
		所有者权益合计	762,388,295.56
资产合计:	763,245,214.56	负债与持有人权益总计:	763,245,214.56

附注:本基金发行在外的基金份额为 1,634,057,409.00 份,基金份额净值为 0.4666 元。

八、基金投资组合

截止到 2010 年 10 月 25 日,本基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占基金资产总值比重(%)
股 票	712,576,738.19	93.36
债 券	0.00	0.00
银行存款及清算备付金合计	43,435,427.45	5.69
其他资产	7,233,048.92	0.95
资产总值	763,245,214.56	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

项目名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	2,469,705.00	0.32
B 采掘业	133,367,620.00	17.49
C 制造业	211,603,707.34	27.76
C0 食品、饮料	0.00	0.00
C1 纺织、服装、皮毛	8,285,638.00	1.09
C2 木材、家具	0.00	0.00
C3 造纸、印刷	0.00	0.00
C4 石油、化学、塑胶、塑料	12,608,836.00	1.65
C5 电子	9,551,904.00	1.25
C6 金属、非金属	98,380,207.94	12.90
C7 机械、设备、仪表	70,458,405.40	9.24
C8 医药、生物制品	12,318,716.00	1.62
C99 其他制造业	0.00	0.00
	0.00	0.00
D 电力、煤气及水的生产和供应业	39,987,863.85	5.25
E 建筑业	59,848,919.00	7.85
F 交通运输、仓储业	36,734,979.00	4.82
G 信息技术业	74,518,222.00	9.77
H 批发和零售贸易	20,054,562.00	2.63
I 金融、保险业	85,457,642.00	11.21
J 房地产业	29,090,658.00	3.82
K 社会服务业	1,551,492.00	0.20
L 传播与文化产业	0.00	0.00
M 综合类	17,891,368.00	2.35
合计	712,576,738.19	93.47

(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

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	市值占净值比(%)
600050	中国联通	11,130,100	59,879,938.00	7.85
601169	北京银行	1,599,900	22,510,593.00	2.95
600005	武钢股份	4,280,800	22,088,928.00	2.90
601939	建设银行	4,026,500	21,139,125.00	2.77
601668	中国建筑	5,190,900	19,413,966.00	2.55
600015	华夏银行	1,330,800	17,819,412.00	2.34
600837	海通证券	1,299,300	16,046,355.00	2.10
600011	华能国际	2,287,600	15,052,408.00	1.97
600362	江西铜业	304,431	14,837,966.94	1.95
601168	西部矿业	691,600	13,693,680.00	1.80

(四)按券种分类的债券投资组合

截至 2010 年 10 月 25 日,本基金未持有债券。

(五)按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2010 年 10 月 25 日,本基金未持有债券。

(六)投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产:

序号	其他资产	金额(元)
1	应收证券清算款	7,192,676.84
2	应收利息	39,739.28
3	应收股利	632.80
合计		7,233,048.92

(4)本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2010 年 10 月 25 日,本基金未持有可转换债券。

(5)按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

截至 2010 年 10 月 25 日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

2010 年 10 月 15 日,本基金进行了基金份额折算,具体情况详见本公告书"基金份额折算"部分。

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、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资产。

(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国泰君安证券股份有限公司。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、赎回

(一)申购、赎回办理的场所

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。

基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构,并予以公告。

目前,本基金申购赎回代理券商的名单如下:华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司。若上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购赎回的,本基金管理人将另行公告。

(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 2010 年 11 月 1 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(基金管理人公告暂停申购或赎回时除外),开放时间为上海证券交易所的交易时间。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实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但此项调整应在实施日前 3 个工作日在至少一家指定媒体公告。

(三)申购、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 200 万份,基金管理人有权对其进行调整,并在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(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。

5、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权益、不违背上海证券交易所相关规则的情况下可更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《证券投资基金信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

(五)申购、赎回的程序

1、申购和赎回的申请的提出

投资者须按申购赎回代理券商规定,在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。投资者申购本基金时,须根据申购、赎回清单备足申购对价。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,否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

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有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况,否则,如因申请未得到登记结算机构的确认而造成的损失,由投资者自行承担。

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登记结算机构的结算规则。

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