深证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011年01月11日
公告时间：2011年01月06日

一、重要声明与提示

深证红利交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告依据《证券投资基金法》、《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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。中国农业银行（即基金托管人）保证本上市交易公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、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10月13日登载于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和工银瑞信基金管理有限公司网站（www.icbccs.com.cn）的本基金招募说明书。

二、基金概览

1.基金二级市场交易简称：深红利。
2、二级市场交易代码：159905。
3、基金申购、赎回简称：深红利。
4、申购、赎回代码：159905。
5、标的指数简称：深证红利
6、标的指数代码：399324
7、2011年1月4日基金份额总额：607，443，951.00份。
8、2011年1月4日基金份额净值：1.0158元。
9、本次上市交易份额：607，443，951.00份。
10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
11、上市交易日期：2011年01月11日。
12、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司。
13、基金托管人：中国农业银行股份有限公司。
14、申购赎回代办证券公司：国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司等。

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：2010年6月13日中国证监会证监许可［2010］808号文批准

2、基金运作方式：交易型、开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：自2010年10月18日至2010年10月29日进行发售，其中，网上现金认购的日期为2010年10月18日至2010年10月29日，网下现金发售的日期为2010年10月18日至2010年10月29日，通过发售代理机构进行网下股票认购的日期为2010年10月25日至2010年10月29日，通过基金管理人直销进行网下股票认购的日期为2010年10月29日至2010年10月29日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：2010年10月18日至2010年10月29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

投资者可通过工银瑞信基金管理有限公司的直销网点办理基金的网下现金认购和网下股票认购。

（2）代销机构

本基金网下股票认购的代理机构包括安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、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、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华融证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、联讯证券经纪有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中银国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司等。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的75家证券公司办理，包括安信证券股份有限公司、海证券股份有限公司、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、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、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、国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、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、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、中国民族证券有限责任公司、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、中银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏证券经纪有限责任公司、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、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、中山证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、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等。

（二）基金合同生效

经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的募集金额总额为607，445，724.86元人民币（含募集股票），其中有效认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计49，742.86元人民币，根据本基金基金合同、招募说明书的有关约定，折合为47，969.00份基金份额，1，773.86元为利息折算基金份额的小数部分，归入基金财产。本次募集资金已于2010年11月4日全额划入本基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户，募集股票已于2010年11月4日由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为4，519户。按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集的有效份额为607，395，982.00份基金份额；利息结转的基金份额为47，969份基金份额。两项合计共607，443，951.00份基金份额，已全部记入基金份额持有人基金账户，归各基金份额持有人所有。其中本基金管理人工银瑞信基金管理有限公司基金从业人员没有认购本基金。本次募集期间所发生与本基金有关的律师费、会计师费、信息披露费等费用不从基金资产中列支。

根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）以及《深证红利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》”）、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金募集符合有关条件。工银瑞信基金管理有限公司已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并获书面确认，基金合同自2010年11月05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）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上［2011］1号。

2、上市交易日期：2011年01月11日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：深红利。

5、二级市场交易代码：159905。

投资者在深圳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：深红利。

7.申购、赎回代码：159905

投资者只能通过指定的代办证券公司参与基金申购、赎回。目前，申购赎回代办券商包括招国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司等。

8.本次上市交易份额：607，443，951.00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01月04日，本基金份额持有人户数为4，519户，平均每户持有的基金份额为134，419.99份。

（二）持有人结构

截至2011年01月04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350，035，309份，占基金总份额的57.62%；个人投资者持有的基金份额为257，408，642份，占基金总份额的42.38%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截止2011年01月04日

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	人民人寿保险	50，004，999	8.23
2	太平洋财产保险	40，004，599	6.59
3	民生证券有限责任公司	30，003，600	4.94
4	新华人寿保险	30，002，599	4.94
5	合众人寿保险	20，002，400	3.29
6	平安人寿保险	20，001，799	3.29
7	长城人寿保险	20，001，399	3.29
8	东方证券5号	20，001，399	3.29
9	国信-中行-国信”金理财”经典组合基金集合资产管理计划	20，000，600	3.29
10	招商证券股份有限公司	18，000，540	2.96

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：工银瑞信基金管理有限公司

2、法定代表人：杨凯生

3、总经理：郭特华

4、注册资本：贰亿元人民币

5、注册地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦

6、设立批准文号：中国证监会证监基金字［2005］93号

中国银监会银监复［2005］105号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：企合国副字第001126号

8、经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务

9、股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的55%；瑞士信贷占公司注册资本的25%；中国远洋运输（集团）总公司占公司注册资本的20%。

10、内部组织结构及职能：

公司设立了三个专门机构：执行委员会、风险管理委员会和投资决策委员会。执行委员会负责公司日常经营管理活动中的重要决策，风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

本公司下设十七个部门，分别是：权益投资部、固定收益部、专户投资部、研究部、中央交易室、战略发展部、产品开发部、渠道销售部、营销策划部、客户服务中心、机构客户部、风险管理部、法律合规部、运作部、信息科技部、人力资源及行政部、财务部。权益投资部负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行股票选择和组合管理。固定收益部负责债券选择和组合管理。专户投资部负责管理公司旗下除共同基金外其余资产组合的日常投资管理工作。研究部完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。中央交易室负责投资指令的交易。战略发展部从事公司发展战略研究。产品开发部负责新产品创新与开发。渠道营销部及机构客户部从事市场开发及销售、项目管理、客户服务等工作。风险管理部负责基金投资风险管理及数量研究工作。法律合规部负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算和会计工作。信息科技部负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。人力资源及行政部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核及培训等工作。财务部负责公司财务管理及日常行政事务管理等。

11、人员情况：

截止到2010年12月31日，我公司共有员工165人，其中64%以上人员具有硕士以上学历，43%具有海外工作和学习背景（含短期国外培训）。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

12、信息披露负责人：朱碧艳

电话：010-5869 8918

13、基金管理业务情况简介：

截至目前，工银瑞信基金管理有限公司旗下共管理16只开放式基金，管理的总资产超过600亿元。旗下管理的基金有工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金（QDII基金）、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金（QDII基金）、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金和深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

14、本基金基金经理

樊智先生，毕业于天津大学，获博士学位。2003年4月至2005年6月，任职于中信证券股份有限公司研究部，担任高级研究员。2005年7月加入工银瑞信基金管理有限公司市场营销部从事产品开发工作；2005年12月至今任职于风险管理部，历任业务主管、风险管理部副总监。2009年9月8日至今，担任工银瑞信沪深300基金和工银瑞信上证央企ETF基金经理

（二）基金托管人

1、基本情况

（1）名称：中国农业银行股份有限公司

（2）法定代表人：项俊波

（3）注册资本：32，479，411.7万元人民币

（4）注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

（5）专门基金托管部门的负责人：张健

（6）信息披露负责人电话：李芳菲

电话：010-63201510

（7）基金托管部人员情况：

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（5）基金托管业务情况简介：

截止2010年9月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共80只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长或号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴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、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金（LOF）、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金（LOF）、景顺长城能源基础股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基。

（三）申购赎回代办证券公司

（1）国信证券股份有限公司

注册地址：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：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

法人代表人：何如

注册资本：700000万元

基金业务联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

全国统一客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.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号上海银行大厦29层

法定代表人：祝幼一

联系人：丙敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

（3）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

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134（四）基金验资机构

名　称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住　所：上海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

经办注册会计师：许康玮　王鸣宇

联系电话：（021）23238888

传　真：（021）23238800

联系人：王鸣宇

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

深证红利交易型开放式指数证券投资基金2011年01月04日资产负债表如下：

金额单位：人民币元

	资产期末余额	负债和所有者权益	负债期末余额
资　产：		负债：	
银行存款	32，732，245.28	短期借款	-
结算备付金	4，262，324.30	交易性金融负债	-
存出保证金	500，000.00	衍生金融负债	-
交易性金融资产	320，451，295.72	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	320，451，295.72	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	291，824.49
基金投资	-	应付托管费	58，364.88
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	110，000，018.00	应付交易费用	246，153.99
应收证券清算款	150，194，776.29	应付税费	-
应收利息	63，623.00	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	574，307.79
其他资产	-	负债合计	1，170，651.15
		所有者权益：	
		实收基金	607，443，951.00
		未分配利润	9，589，680.44
		所有者权益合计	617，033，631.44
资产合计	618，204，282.59	负债与持有人权益总计	618，204，282.59

八、基金投资组合

截至公告日前两个工作日当日的基金投资组合情况，包括：

（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	320，451，295.72	51.84
	其中：股票	320，451，295.72	51.84
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	110，000，018.00	17.79
	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	36，994，569.58	5.98
6	其他资产	150，758，399.29	24.39
7	合计	618，204，282.59	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	-	-
B	采掘业	41，708，789.20	6.76
C	制造业	169，544，152.52	27.48
C0	食品、饮料	23，462，140.00	3.80
C1	纺织、服装、皮毛	2，478，960.00	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3，541，440.00	0.57
C4	石油、化学、塑胶、塑料	15，909，348.00	2.58
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	77，121，420.17	12.50
C7	机械、设备、仪表	47，030，844.35	7.62
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10，082，744.00	1.63
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	7，438，805.00	1.21
G	信息技术业	24，552，930.00	3.98
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	8，325，750.00	1.35
J	房地产业	57，998，341.00	9.40
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	799，784.00	0.13
	合计	320，451，295.72	51.93

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

（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：指数基金若兼具积极投资和指数投资的，应分别按积极投资和指数投资列示前五名股票明细。

1、指数投资

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	000002	万　科A	4，997，800	43，980，640.00	7.13
2	000983	西山煤电	884，000	24，513，320.00	3.97
3	000063	中兴通讯	762，200	20，731，840.00	3.36
4	000527	美的电器	987，763	17，236，464.35	2.79
5	000568	泸州老窖	396，000	16，129，080.00	2.61
6	000792	盐湖钾肥	239，960	15，909，348.00	2.58
7	000060	中金岭南	592，000	13，722，560.00	2.22
8	000630	铜陵有色	347，400	12，179，844.00	1.97
9	000039	中集集团	500，000	11，520，000.00	1.87
10	000012	南　玻A	508，000	10，175，240.00	1.65

2、积极投资

本基金报告期末未持有积极投资部分。

（四）按净种类的债券投资组合。

本基金报告期末未持有债券。

（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。

本基金报告期末未持有债券。

（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未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、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500，000.00
2	应收证券清算款	150，194，776.29
3	应收股利	-
4	应收利息	63，623.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150，758，399.29

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末股票投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

本基金本报告期末无积极投资。

九、重大事件揭示

本基金暂无其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

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、基金申购赎回价格的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

自2011年01月11日起，本基金开始办理申购、赎回。

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深圳证券交易所的交易日，开放时间为上午9：30-11：30和下午1：00-3：00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若深圳证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

1、投资人申购的基金份额需为最小申购单位的整数倍。

2、本基金最小申购单位为50万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

3.2 申购费率

投资者在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

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

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组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代等的清算，在T+1日办理基金份额、现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购和赎回的对价、费用及其用途

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深圳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。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

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、登记结算机构等收取的相关费用。

（七）申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公正的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

（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者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×该证券经除权调整的T-1日收盘价×（1+现金替代保证金率）

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，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者收取欠缺的差额。

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保证金率，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者或投资者应补交的款项；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者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳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者或投资者应补交的款项。

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数据发送给登记结算机构，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算；T+2日后第2个工作日（若在特例情况下，则为T日起第22个交易日），登记结算机构办理现金替代多退少补资金的交收。

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者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：

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为n。

（8）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将被剔除，或基金管理人出于保护持有人利益原则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经除权调整的T-1日收盘价。

4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

T日预估现金差额=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日经除权调整的前收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和）

其中，T日经除权调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。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。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额=T日最小申购、赎回单位的基金资产净值-（申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和）。

T日投资者申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2010-12-24
基金名称	深红利
基金管理公司名称	工银瑞信基金管理有限公司
基金代码	159905
标的指数代码	399324

2010年12月23日信息内容

现金差额（单位：元）	¥-1，259.60
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	¥505