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

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）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：中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-分红-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

富国基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的双汇发展股票估值方法的提示性公告

鉴于双汇发展（证券代码：000895）股票因重大事项临时停牌，为使本基金管理人旗下持有该股票的基金估值更加公平、合理，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（【2008】38号文）的相关原则和要求，经与托管银行商定，决定自2011年3月21日起，对旗下基金持有的双汇发展（证券代码：000895）股票按照公允价值进行估值调整。

为切实维护基金份额持有人利益，在双汇发展（证券代码：000895）股票停牌期间，本基金管理人将与河南双汇投资发展股份有限公司保持密切沟通。

待该股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告

富国基金管理有限公司

二〇一一年三月二十二日

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，先后被美国《全球托管人》和香港《财资》杂志为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》杂志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

中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

（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、江海证券股份有限公司、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）股资组合报告附注

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中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、江海证券股份有限公司、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账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：[i]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