深证电子信息传媒产业（TMT）50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：招商基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
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9月1日
公告时间：2011年8月29日

一、重要声明与提示

《深证电子信息传媒产业（TMT）50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》（以下简称"本公告书"）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《上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人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、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，请投资者详细查阅刊登在2011年5月12日《证券时报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）上公告的《深证电子信息传媒产业（TMT）50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：深TMT
2、二级市场交易代码：159909
3、基金申购赎回简称：深TMT
4、申购赎回代码：159909
5、标的指数简称：TMT50指数
6、标的指数代码：399610
7、2011年8月25日基金份额总额：106,771,449份
8、2011年8月25日基金份额净值：3.085元
9、本次上市交易份额：106,771,449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9月1日
12、基金管理人：招商基金管理有限公司
13、基金托管人：中国银行股份有限公司
14、申购赎回代理券商：
①代销机构：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
办公地址：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
电话：0755-82960223
传真：0755-82960141
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
②代销机构：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
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
联系人：余江
客服电话：4008001001
地址：www.essence.com.cn
③代销机构：国海证券有限责任公司
注册地址：南宁市滨湖路46号
办公地址：深圳市福田区竹子林光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
联系人：牛孟宇
客户服务电话：4008888100
网址：www.ghzq.com.cn
④代销机构：广州证券有限责任公司
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人：吴志明
电话：020-87322668
传真：020-87325036
联系人：林洁茹
客服电话：020-961303
网址：www.gzs.com.cn
⑤代销机构：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
客户服务电话：95553
网址：www.htsec.com
⑥代销机构：华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
电话：021-50122222
传真：021-50122200
联系人：宋歌
客户服务电话：4008209898
网址：www.cnhbstock.com
⑦代销机构：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
电话：010-66555316
传真：010-66555246
联系人：汤漫川
客户服务：4008888993
网址：www.dxzq.net
⑧代销机构：山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
联系人：郭婧
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn
⑨代销机构：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
电话：010-66568430
传真：010-66568532
联系人：田薇
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn
⑩代销机构：宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号、北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

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 2011年4月27日证监许可【2011】605号
2、基金合同生效日：2011年6月27日。
3、基金运作方式：交易型开放式。
4、基金合同期限：不定期。
5、发售日期：本基金自2011年5月16日至2011年6月21日进行发售。其中，网下现金认购的日期为2011年5月16日至2011年6月21日，网下股票认购的日期为2011年6月10日至2011年6月21日，网上现金认购的日期为2011年5月16日至2011年6月21日。
6、发售价格：人民币1.00元。
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网下现金发售直销机构
招商基金管理有限公司
②网上现金发售代理机构
本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，基金份额发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。包括：国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、联讯证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、厦门证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、宏源证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、华泰联合证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、天风证券有限责任公司、五矿证券有限公司、中银国际证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、万和证券经纪有限公司、中信金通证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、恒泰长财证券有限责任公司、财达证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中邮证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、国盛证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、江海证券有限公司、中天证券有限责任公司、北京高华证券有限责任公司、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、安信证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司等（排序不分先后）。

③网下股票认购的证券公司：招商证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、中航证券有限公司、华融证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司等（排序不分先后）。

9、验资机构名称：德勤华永会计师事务所
10、募集资金总额及入账情况
本基金于2011年5月16日起公开募集，基金募集工作已于2011年6月21日顺利结束。经德勤华永会计师事务所验资，本次募集的募集金额总额为347,195,545.00元人民币（含所募集股票市值）。有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计48,272.00元人民币。募集资金已于2011年6月27日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为3,075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347,195,545.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本基金管理人招商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。

11、本基金募集备案情况
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《深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《深证电子信息传媒产业（TMT）50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2011年6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。

（二）本基金份额折算
根据《深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，招商基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）确定2011年8月10日为深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。当日深证电子信息传媒产业（TMT）50指数收盘值为3000.286点，基金资产净值为320,349,496.44元，折算前基金份额总额为347,195,545份，折算前基金份额净值为0.923元。

根据《深证电子信息传媒产业（TMT）50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0.30752983（以四舍五入的方法保留小数点后8位），折算后基金份额总额为106,771,449份，折算后基金份额净值为3.000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深圳分公司于2011年8月11日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位（小数点后面的部分舍去，舍去部分计入基金财产）。投资者可以自2011年8月12日起在其深圳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。

（三）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2011】261号
2、上市交易日期：2011年9月1日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。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交易。
4、基金简称：深证TMT50ETF
基金场内简称：深TMT
5、交易代码：159909
6、本次上市交易份额：106,771,449份
7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况
（一）场内基金份额持有人户数
截至2011年8月25日，本基金场内份额持有人户数为3,075户，平均每户持有的场内基金份额为34722.42份。
（二）场内基金份额持有人结构
截至2011年8月25日，场内机构投资者持有的本基金份额有90,140,962份，占本基金场内总份额的84.42%；场内个人投资者持有的基金份额有16,630,487份，占本基金场内总份额的15.58%。
（三）本基金场内份额前十名持有人情况（截至2011年8月25日）

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	12,303,837	11.52%
2	宏源证券-建行-宏源3号红利成长集合资产管理计划	9,226,962	8.64%
3	红塔证券股份有限公司	9,226,535	8.64%
4	永安财产保险股份有限公司	6,151,707	5.76%
5	东海证券-兴业-东风2号集合资产管理计划	6,151,642	5.76%
6	太平人寿保险有限公司-投连-银保	6,151,519	5.76%
7	东兴证券-光大-东兴1号优选基金集合资产管理计划	6,150,904	5.76%
8	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2009ZX002	5,883,353	5.51%
9	山西证券股份有限公司	3,690,921	3.46%
10	招商证券股份有限公司	3,690,682	3.46%
合计		68,628,062	64.28%

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、公司概况
名称：招商基金管理有限公司
法定代表人：马蔚华
代总经理：杨奕
设立日期：2002年12月27日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
注册资本：人民币2.1亿元
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立批准文号：中国证监会证监基金字【2002】100号
工商登记注册的法人营业执照文号：企合国字第000976
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
存续期间：持续经营
电话：0755-83196351
传真：0755-83076974
联系人：曾倩
2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	33.4%
招商证券股份有限公司	33.3%
ING Asset Management B.V.	33.3%

3、内部组织结构及职能
公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置董事会办公室、股票投资部、固定收益投资部、交易部、研究部、专户资产投资部、渠道管理部、市场部、产品研发部、国际业务部、华东机构理财中心、华南机构理财中心、华北机构理财中心、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等21个职能部门，并设有北京分公司、上海分公司等分支机构。
各部门主要职能如下：
董事会办公室：负责公司董事会相关工作。
股票投资部：根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
固定收益投资部：负责固定收益产品的投资。
交易部：负责公司所有产品的交易管理工作。
研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。
专户资产投资部：负责专户产品的投资。
渠道管理部：负责基金的渠道销售工作。
市场部：负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。
产品研发部：负责产品研发、申报等工作。
国际业务部：负责海外基金产品的投资研究。
华东机构理财中心、华南机构理财中心、华北机构理财中心：负责机构销售业务。
信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
基金核算部：负责公司基金的会计核算、估值。
基金事务部：负责公司基金的注册登记、资金清算。
法律合规部：负责对公司和基金运作合规性监察、稽核审计、法务支持及日常信息披露事宜。
风险管理部：负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查；负责投资业绩评价。
总经理办公室：负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。
人力资源部：负责公司人力资源管理工作。
财务部：负责公司财务管理、会计核算等相关工作。
各分公司：负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
4、人员情况
截至2011年6月30日，公司共有员工180人，其中107人具有硕士学历，8人具有博士学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。
5、信息披露负责人及咨询电话：
吴武泽，0755-83196384。
6、基金管理业务情况
本基金管理公司目前管理二十一只基金，其中封闭式基金一只；招商信用添利债券型证券投资基金；开放式基金二十只，包括：招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票基金、招商安泰平衡型基金、招商安泰债券基金）、招商现金增值开放式证券投资基金、招商先锋混合型证券投资基金、招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）、招商安本增利债券型证券投资基金、招商核心价值混合型证券投资基金、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金、招商安心收益债券型证券投资基金、招商行业领先股票型证券投资基金、招商中小盘精选股票型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）、招商深证100指数证券投资基金、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）、招商安瑞进取债券型证券投资基金、深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。
7、本基金基金经理简介
王平，男，中国国籍，中南大学管理科学与工程专业硕士。2006年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理、副总监，主要从事投资风险管理、金融工程与数量化投资策略研究、股指期货投资策略研究等工作。王平先生同时兼任本公司招商深证100指数证券投资基金的基金经理，管理时间为2009年6月22日至今。王平先生同时兼任本公司上证消费80交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，管理时间为2010年12月08日至今。王平先生同时兼任本公司深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金及联接基金的基金经理，管理时间为2011年6月27日至今。
（二）基金托管人
1、基金托管人概况
名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门联系人：唐州徽
电话：010-66594855
传真：010-66594942
2、主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。
3、证券投资基金托管情况
截至2011年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或弓混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宏兴业大盘精选股票、华宏兴业动力组合股票、华宏兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、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、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业基金、大成精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宏兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）等119只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（三）基金验资机构
名称：德勤华永会计师事务所有限公司
注册地址：上海市延安东路222号30楼
法定代表人：卢伯卿
电话：021-61418888
传真：021-63350177
经办注册会计师：陶坚、汪芳
联系人：陶坚
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
截至公告前两个工作日即2011年8月25日，本基金的资产负债表如下：

资产负债表

会计主体：深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2011年8月25日　　单位：人民币元

资产	本报告期末 2011年8月25日
资产：	
银行存款	2,040,868.30
结算备付金	8,797,865.05
存出保证金	500,000.00
交易性金融资产	318,892,272.78
其中：股票投资	318,892,272.78
债券投资	–
资产支持证券投资	–
基金投资	–
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	94,527.67
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	–
资产合计	330,325,533.80
负债和所有者权益	
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	112,737.10
应付托管费	22,547.41
应付销售服务费	–
应付交易费用	264,858.18
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	583,605.93
负债合计	983,748.62
所有者权益：	
实收基金	347,195,545.00
未分配利润	−17,853,759.82
所有者权益合计	329,341,785.18
负债与持有人权益总计	330,325,533.80

注：截至2011年8月25日，基金份额净值3.085元，基金份额总额106,771,449份。
八、基金投资组合
截至公告前两个工作日即2011年8月25日，本基金的投资组合如下：
（一）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	318,892,272.78	96.54
	其中：股票	318,892,272.78	96.54
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	10,838,733.35	3.28
6	其他资产	594,527.67	0.18
7	合计	330,325,533.80	100.00

（二）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	–	–
C	制造业	202,581,470.18	61.51
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	122,202,625.22	37.11
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	79,327,734.96	24.09
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	1,051,110.00	0.32
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	73,605,421.28	22.35
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	19,723,168.12	5.99
M	综合类	22,982,213.20	6.98
合计		318,892,272.78	96.83

（三）报告期末按市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	000527	美的电器	1,091,300	17,733,625.00	5.38
2	000651	格力电器	819,915	17,480,587.80	5.31
3	000063	中兴通讯	898,000	16,729,740.00	5.08
4	000725	京东方A	6,500,000	15,665,000.00	4.76
5	000100	TCL集团	5,841,200	14,194,116.00	4.31
6	002106	莱宝高科	568,700	14,029,829.00	4.26
7	000970	中科三环	450,000	12,429,000.00	3.77
8	000839	中信国安	1,183,400	12,082,514.00	3.67
9	300027	华谊兄弟	590,933	10,081,316.98	3.06
10	002008	大族激光	932,775	9,486,321.75	2.88

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
（五）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
本基金本报告期末未持有债券。
（六）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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
（七）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
本基金本报告期末未持有权证。
（八）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未有被监管部门立案调查，不存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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。
3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	94,527.67
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	594,527.67

（九）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。
（十）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

九、重大事件揭示

以2011年8月10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"（二）本基金份额折算"。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：
1、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。
2、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。
3、在知悉可能对基金份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：
1、严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。
2、根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、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等行为进行监督和核查。
3、基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。
4、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，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金份额申购、赎回

（一）申购与赎回的场所
基金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份额的申购与赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减申购赎回代理券商的名单。
（二）申购、赎回的开放日期及办理时间
1、申购与赎回的开始时间
自2011年9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。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。
若深圳证券交易所交易时间更改或依据实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日及具体业务办理时间进行相应调整并公告。
（三）申购与赎回的原则
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《深圳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实质利益的前提下调整上述原则，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。
（四）申购与赎回的程序
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申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。
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）、配股等权益变动，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数据发送给注册登记机构，注册登记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），注册登记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：

（5）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经除权调整的T-1日收盘价。
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、赎回的投资者的相应资金，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