易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

易方达基金管理有限公司

二〇一三年三月二十日

一、重要声明与提示

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《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，易方达基金管理有限公司（以下简称“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。本基金托管人中国建设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，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定信息披露媒体和易方达基金管理有限公司网站（www.efunds.com.cn）上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：HS300ETF。
2.二级市场交易代码：510310。
3.基金申购、赎回简称：沪深申赎。
4.申购、赎回代码：510311。
5.2013年3月18日基金份额总额：1,104,307,415份。
6.2013年3月18日基金份额净值：0.9973元。
7.本次上市交易份额：1,104,307,415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：2013年3月25日。
10.基金管理人：易方达基金管理有限公司。
11.基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
12.上市推荐人：申银万国证券股份有限公司。
13.目前，本基金的申购、赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）如下：广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，我司将另行公告。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

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：2012年12月31日中国证监会证监许可［2012］1762号文。
2.基金运作方式：契约型开放式。
3.基金合同期限：不定期。
4.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三种方式。
5.发售日期：本基金自2013年2月18日至2013年2月28日进行发售。其中，网下现金认购的日期为2013年2月18日至2013年2月28日，网上现金认购和网下股票认购的日期为2013年2月26日至2013年2月28日。
6.发售价格：1.00元人民币。
7.发售期限：网下现金发售9个工作日，网上现金发售和网下股票发售3个工作日。
8.发售机构

①）直销机构

投资者可通过基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。

②）代销机构

本基金网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为：广发证券股份有限公司、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、第一创业证券股份有限公司、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、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、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、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、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、申银万国证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

本基金的网上现金发售代理机构：具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可［2012］1762号文批准，自2013年2月18日起向全社会公开募集，截至2013年2月28日，募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为1,104,263.810元人民币（含募集股票市值），有效净认购金额产生的利息共计43,605元人民币。本次募集所有资金已于2013年3月6日划入本基金在基金托管人中国建设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7,051户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，设立募集期间募集的有效份额为1,104,263,810份基金份额；利息结转的基金份额为43,605份基金份额。两项合计共1,104,307,415份基金份额，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本公司及本公司基金从业人员投有认购本基金。

本基金于2013年3月6日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于2013年3月6日正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费用由基金管理人承担。

（三）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基字［2013］87号。
2.上市交易日期：2013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：HS300ETF。
5.二级市场交易代码：510310。

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：沪深申赎。
7.申购、赎回代码：510311。

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广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，我司将另行公告。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

8.本次上市交易份额：1,104,307,415份。
9.未上市交易份额的流通规定：

本基金包括场内份额与场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额。

在本基金开始办理场外申购赎回业务之后，本基金除场内份额外还将增加一类场外份额。条件许可情况下，本基金场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管，也可跨系统转托管为场内份额，但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

本基金场内份额可直接在上海证券交易所上市交易，场外份额应由基金份额持有人通过申请办理跨系统转托管将基金份额转为场内份额后，方可进行场内赎回和上市交易。场外申赎及跨系统转托管的具体业务规定和规则另行公告。

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2013年3月18日，本基金份额持有人户数为7,051户，平均每户持有的基金份额为156,617.13份。

（二）持有人结构

截至2013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719,401,724份，占基金总份额的65.15%；个人投资者持有的基金份额为384,905,691份，占基金总份额的34.85%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2013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）	占场内总份额比例（%）
1	易方达基金公司-交行-易方达-交通银行优选1号资产管理计划	111,565,617	10.10
2	佛山市美的投资管理有限公司	100,000,000	9.06
3	全国社保基金四零二组合	52,869,600	4.79
4	易方达基金公司-交行-广发证券股份有限公司	49,985,997	4.53
5	易方达基金公司-交行-平安证券有限责任公司	49,985,997	4.53
6	易方达基金公司-交行-招商证券股份有限公司	49,985,997	4.53
7	易方达基金公司-交行-申银万国证券股份有限公司	49,985,997	4.53
8	中信证券股份有限公司	40,000,000	3.62
9	中国银河证券股份有限公司	36,000,000	3.26
10	中信建投证券股份有限公司	33,766,304	3.06

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1.名称：易方达基金管理有限公司
2.法定代表人：叶俊英
3.总裁：刘晓艳
4.注册资本：壹亿贰仟万元人民币
5.注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
6.设立批准文号：证监基金字［2001］4号
7.工商登记注册的法人营业执照文号：440000000002868
8.经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务。
9.股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份25%；广发证券股份有限公司，持有股份25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份8.33%。
10.内部组织结构及职能：

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设二十五个部门：基金投资部、机构理财部、固定收益总部、指数与量化投资部、研究部、投资发展部、集中交易室、投资风险管理部、养老金部、市场部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、南京分公司、机构客户部、系统研发部、技术运营部、核算部、注册登记部、宣传策划部、综合管理部、人力资源部、监察部、北京代表处。

各部门的主要职责概述如下：

基金投资部负责公募基金资产的日常管理和运作。
机构理财部负责社保基金、企业年金和其他受托资产的投资管理工作。
固定收益总部负责公司管理的固定收益资产的投资、研究及交易工作。
指数与量化投资部主要负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。
研究部的主要工作职责是对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种进行研究。
投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发；为市场营销工作提供专业支持。
集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作，保存交易记录，备份交易数据。
投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估，负责投资研究系统建设相关的工作，以及与投资研究跨部门流程相关的支持性工作。
养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。
市场部主要负责公司市场营销和销售支持工作，为渠道、机构客户、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持，研究和开发设计基金行业电子商务模式等。
宣传策划部负责制作宣传材料，传播公司信息，管理媒体关系，管理广告投放及维护公司网站等。
北京分公司负责组织实施以北京为中心的华北和西北地区的销售工作。
上海分公司负责组织实施以上海为中心的华东地区及西南、东北部分地区的销售工作。
广州分公司负责组织实施以广州为中心的华南地区的销售工作。
成都分公司负责组织实施以四川省为中心的销售工作。
南京分公司负责组织以江苏省为中心的销售工作。
机构客户部负责公司机构客户的销售和服务工作。
系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。
技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设，公司日常运营的技术支持与服务，保障公司信息系统安全可靠高效运行。
核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作，负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作，以及各银行账户的管理工作。
注册登记部主要工作是进行开放式基金和特定多个客户资产管理计划的注册登记业务。
综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作，负责公司财务会计、行政保卫和文书档案等工作。
人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施，具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。
监察部独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督，协助并督促各部门履行内控职责，确保公司各项经营活动稳健合规，实现公司经营目标。
北京代表处负责与在京监管部门的日常联系工作。

11.人员情况

截止到2013年2月28日，本公司有员工392人，其中220人具有硕士学历，22人具有博士学历。93%的公司员工具有基金从业资格。

12.信息披露负责人：张南
电话：020-85102688
13.基金管理业务介绍

截至2013年2月28日，本公司旗下共管理40只开放式基金和1只封闭式基金，公募基金资产管理规模1896.83亿元。旗下管理的封闭式基金有科瑞证券投资基金。开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达信息产业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型基金、易方达量化行种股票型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金。

14.本基金基金经理

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深300指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理和易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理，兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

林祚斌先生，经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人情况

1.基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码：100033
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年9月17日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］12号
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

2.组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
3.主要人员情况

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海各分中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

（三）上市推荐人

申银万国证券
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
联系人：曹晔
联系电话：021-54033888
客户服务电话：95523.4008895523
传真：021-54038844
网址：www.sywg.com

（四）一级交易商

①）广发证券

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5.18.19.36.38.41.42.43楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
开放式基金业务传真：020-87555305
网址：www.gf.com.cn

②）东方证券

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
联系电话：021-63325888
客户服务电话：95503
传真：021-63326173
网址：www.dfzq.com.cn

③）光大证券

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：刘晨、李芳芳
联系电话：021-22169999
客户服务电话：400-8888-788、10108998
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com

④）华安证券

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市南二环959号财智中心B1座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
联系电话：0551-5161666
客户服务电话：96518、400-80-96518
开放式基金业务传真：0551-5161672
网址：www.hazq.com

⑤）平安证券

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：郑舒丽
客户服务电话：95511-8
开放式基金业务传真：0755-82400862
网址：www.pingan.com

⑥）申银万国证券

注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
联系人：曹晔
联系电话：021-54033888
客户服务电话：95523.4008895523
传真：021-54038844
网址：www.sywg.com

⑦）银河证券

注册地址：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：田薇
客户服务电话：4008-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

⑧）中信建投证券

注册地址：北京市朝阳区安立路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
开放式基金咨询电话：400-8888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
网址：www.csc108.com

（五）基金验资机构

会计师事务所：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：沈兆杰
经办会计师：薛竞、庄贤

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

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

（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2013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	885,171,230.54
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	216,397,790.65
其中：股票投资	215,801,790.65
债券投资	596,000.00
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	13,909.84
应收利息	28,608.73
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	146,654.69
资产总计	1,101,758,194.45
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	181,892.01
应付托管费	36,378.39
应付销售服务费	-
应付交易费用	142,399.69
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	25,850.14
负债合计	386,520.23
所有者权益：	
实收基金	1,104,307,415.00
未分配利润	-2,935,740.78
所有者权益合计	1,101,371,674.22
负债和所有者权益总计	1,101,758,194.45

八、基金投资组合

截至2013年3月18日，本基金的投资组合情况如下：

（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	215,801,790.65	19.59
	其中：股票	215,801,790.65	19.59
2	固定收益投资	596,000.00	0.05
	其中：债券	596,000.00	0.05
	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	885,171,230.54	80.34
6	其他各项资产	189,173.26	0.02
	合计	1,101,758,194.45	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	1,044,549.56	0.09
B	采掘业	19,468,207.45	1.77
C	制造业	74,512,355.50	6.77
C0	食品、饮料	12,676,248.73	1.15
C1	纺织、服装、皮毛	521,923.93	0.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,683,139.74	0.43
C5	电子	6,373,419.54	0.58
C6	金属、非金属	14,340,191.72	1.30
C7	机械、设备、仪表	21,064,671.76	1.91
C8	医药、生物制品	14,558,187.50	1.32
C99	其他制造业	294,572.58	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,061,553.00	0.55
E	建筑业	6,911,400.68	0.63
F	交通运输、仓储业	6,171,569.60	0.56
G	信息技术业	5,250,220.89	0.48
H	批发和零售贸易	4,255,019.08	0.39
I	金融、保险业	73,573,876.94	6.68
J	房地产业	13,216,298.60	1.20
K	社会服务业	1,911,128.00	0.17
L	传播与文化产业	994,429.35	0.09
M	综合类	2,431,182.00	0.22
	合计	215,801,790.65	19.59

（三）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	600016	民生银行	917,200	9,217,860.00	0.84
2	600036	招商银行	643,540	8,031,379.20	0.73
3	601166	兴业银行	309,900	5,733,150.00	0.52
4	601318	中国平安	136,400	5,541,932.00	0.50
5	600000	浦发银行	455,100	4,769,448.00	0.43
6	000002	万 科A	393,724	4,208,909.56	0.38
7	600276	恒瑞医药	126,000	4,058,460.00	0.37
8	600837	海通证券	367,700	3,982,191.00	0.36
9	600030	中信证券	313,000	3,950,060.00	0.36
10	601328	交通银行	798,100	3,719,146.00	0.34

（四）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	596,000.00	0.05
8	其他	-	-
9	合计	596,000.00	0.05

（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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	5,960	596,000.00	0.05

截至2013年3月18日，本基金仅持有以上债券。

（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

截至2013年3月18日，本基金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

截至2013年3月18日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1.自基金合同生效日至2013年3月18日，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.其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	13,909.84
3	应收股利	-
4	应收利息	28,608.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	146,654.69
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,173.26

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2013年3月18日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2013年3月18日，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

无。

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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

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。

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。

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，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

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、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为申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

本节所指的基金份额的申购与赎回适用于本基金的场内申购、赎回业务，本基金场外申购、赎回的具体业务规定和规则另行公告。

（一）申购、赎回办理的场所

对于在场内申购赎回的投资者，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本基金的申购和赎回。

目前，基金申购、赎回代办证券公司（一级交易商）包括广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。本公司将适时增加或调整申购赎回代办券商，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2013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

场内投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所的正常交易日的交易时间；但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若上海证券交易所交易时间变更或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）申购、赎回的数额限制

场内投资者申购、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200万份基金份额。

基金管理人有权对最小申购赎回单位进行更改，并在调整生效前按照相关法律法规的要求在至少一种指定媒体上公告。

（四）申购、赎回的原则

1.本基金的场内份额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.本基金场内份额的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
3.场内申购、赎回申请提交后不得撤销；
4.场内申购赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》和《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》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，或依据上海证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整上述规则，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。

7.4申购与赎回的程序

1.场内申购和赎回的申请方式

投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时，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，必须有足够的基金份额余额和现金。投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

2.场内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，则申购申请失败而不予成交。如投资者持有的符合要求的可用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，则赎回申请失败而不予成交。

投资者可在申请当日及时通过其办理申购、赎回的销售网点或以销售网点规定的其他方式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。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；投资者赎回获得的股票当日可卖出。即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。

3.场内申购和赎回的清算交收与登记

本基金场内申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定，对于本基金的场内申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购当日并卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后，登记结算机构在T日收市后办理上交所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记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。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资者T日赎回成功后，登记结算机构在T日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在T+1日办理上交所上市的成份股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。基金管理人不迟于T+3日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

登记结算机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒体公告。

7.5 其他与申购赎回相关的事项

其他与场内申购赎回相关的事项如下：

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）申购费用由申购基金份额的投资者承担，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。

④）当发生限制申购或暂停申购的情形时，除另有公告外，定期定额申购与日常申购按相同的原则确认。

⑤）定期定额申购业务的其它具体办理程序请遵循融通农村商业银行的有关规定。

二、投资者可通过以下途径咨询有关详情

1.顺德农村商业银行

注册地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
办公地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人：吴海恒
联系人：林见玲
联系电话：0757-22388030
客户服务电话：