华泰柏瑞中证500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：华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一五年六月九日

一、重要声明与提示

华泰柏瑞中证500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，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）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，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2015年4月11日刊登在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站(www.huatai-pb.com)上的《华泰柏瑞中证500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：ETF500。
2、二级市场交易代码：512510。
3、基金申购、赎回简称：ETF申赎。
4、申购、赎回代码：512511。
5、2015年6月5日基金份额总额：434,429,801份。
6、2015年6月5日基金份额净值：2.2266元。
7、本次上市交易份额：434,429,801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：2015年6月12日。
10、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国银行股份有限公司。
12、上市推荐人：华泰证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、天风证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司。

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：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]508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2015年4月15日起至2015年5月6日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2015年4月15日起至2015年5月6日，网上现金发售日期为2015年5月4日至2015年5月6日，网下股票认购的发售期间为2015年4月15日至2015年5月6日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售15个工作日，网上现金发售3个工作日，网下股票认购15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三种方式。
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：华泰柏瑞基金管理有限公司。

（2）代销机构

ETF500的网下现金发售和网下股票发售代理机构为爱建证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司。

网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的96家证券公司：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、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、诚信证券有限责任公司、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、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、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、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、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、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、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、开源证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、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、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、天源证券有限公司、万和证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、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、浙商证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、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、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券（浙江）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、中邮证券有限责任公司和中原证券股份有限公司等。

（二）基金合同生效

截至2015年5月6日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集确认的募集金额总额为873,820,061.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额873,820,061份；其中募集期间认购资金利息折合基金份额的共计48,140份。募集资金已于2015年5月12日全额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；募集股票已于2015年5月12日由中国证券登记结算有限责任公司过户至本基金的证券账户。

本次募集有效认购总户数为10,878户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额合计873,820,061份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金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《华泰柏瑞中证500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2015年5月13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《华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定2015年6月3日为本基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与基金份额折算日标的指数收盘值的五千分之一基本一致。2015年6月3日，中证500指数收盘值为10979.99点，基金资产净值为954,008,363.68元，折算前基金份额总额为873,820,061份，折算前基金份额净值为1.0918元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.49716235，折算后基金份额总额为434,429,801份，折算后基金份额净值为2.1960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上海分公司于2015年6月4日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法计算保留到整数位。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2015]236号。
2、上市交易日期：2015年6月12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：ETF500。
5、二级市场交易代码：512510。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：ETF申赎。
7、申购、赎回代码：512511。

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：

序号	一级交易商	电话	网址
1	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net.cn
2	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
3	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
4	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
5	齐鲁证券有限公司	95538	www.qlzq.com.cn
6	天风证券股份有限公司	400-800-5000	www.tfzq.com
7	信达证券股份有限公司	400-800-8899	www.cindasc.com
8	中国国际金融有限公司	021)58796226-3736	www.cicc.com.cn
9	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
10	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
11	中国中投证券有限责任公司	400-600-8008	www.china-invs.cn
12	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com

8、本次上市交易份额：434,429,801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2015年6月5日，本基金份额持有人户数为10,878户，平均每户持有的基金份额为39,936.55份。

（二）持有人结构

截至2015年6月5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114,596,989份，占基金总份额的26.38%；

个人投资者持有的基金份额为319,832,812份，占基金总份额的73.62%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2015年6月5日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称 (仓称)	持有基金份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	赵熙逸	49,732,641	11.45%
2	新华人寿保险股份有限公司	24,861,100	5.72%
3	华宝信托有限责任公司-宝钢1号单一资金信	14,916,760	3.43%
4	信诚人寿保险有限公司	14,914,870	3.43%
5	东方证券股份有限公司	9,944,440	2.29%
6	中信证券股份有限公司	9,943,247	2.29%
7	都邦财产保险股份有限公司	9,943,247	2.29%
8	王荣成	9,943,247	2.29%
9	天风证券股份有限公司	7,457,435	1.72%
10	中信建投证券有限责任公司	4,495,514	1.03%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
2、注册地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
3、法定代表人：齐亮
4、总经理：韩勇
5、成立日期：2004年11月18日
6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会
7、批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178号
8、工商登记注册的法人营业执照文号：310000400404609
9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
10、组织形式：有限责任公司
11、注册资本：贰亿元人民币
12、存续期间：持续经营
13、信息披露负责人：陈晖
联系电话：400-888-0001，（021）38601777
14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。
15、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。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设24个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资。
固定收益部：负责公司固定收益的投资管理。
专户理财部：负责专户的投资管理。
海外投资部：负责公司QDII的投资管理。
指数投资部：负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。
量化投资部：负责量化产品的投资管理。
研究部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行行业和上市公司研究。
交易部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。
北京分公司、深圳分公司、第一营销中心、第二营销中心：负责基金销售。
机构业务一部、机构业务二部：负责机构客户的业务拓展。
市场营销部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员，同时负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。
客户服务部：负责公司的客户服务。
产品与业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。
基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。
信息技术与电子商务部：负责公司信息系统的日常运行与开发。
法律监察部：负责内部法律事务咨询、处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。
风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。
人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。
行政管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理。
财务部：负责公司财务事项。

16、人员情况：

截止2015年4月30日，本公司共有员工148人。其中，投资研究团队共有人员47名，取得CFA资格7名，占15%，全公司取得基金从业资格的有139人。其中，公司高级管理人员和从事研究、投资、估值、营销、监察稽核等业务的主要业务人员都已取得基金从业资格。在所有公司人员中，研究生及以上学历的占66%，本科学历的占26%。

17、基金管理业务情况简介：

截止2015年3月31日，公司共管理24只基金，包括11只股票型基金，分别是华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金和华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金；5只混合型基金，华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金；6只债券型基金，华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金和华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金；1只货币型基金，华泰柏瑞货币市场证券投资基金和1只QDII基金，华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金。截至2015年3月31日，公司管理的基金资产规模为人民币615.16亿元，总份额规模为353.98亿份。

18、本基金基金经理

柳军先生：硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理，2010年10月起担任投资资源副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。

（二）基金托管人

1、名称：中国银行股份有限公司
2、注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
3、首次注册登记日期：1983年10月31日
4、法定代表人：田国立
5、注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾伍万叁仟壹佰玖拾伍元整
6、托管部门信息披露联系人：王永民
7、客服电话：95566；传真：(010)66594942
8、主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

9、基金托管业务经营情况

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

截至2014年12月31日，中国银行已托管307只证券投资基金，其中境内基金282只，QDII基金25只，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）上市推荐人

名称：华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：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：庞晓云
电话：(07525)82492193
传真：(0755)82492962
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（四）一级交易商

序号	一级交易商	电话	网址
1	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net.cn
2	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
3	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
4	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
5	齐鲁证券有限公司	95538	www.qlzq.com.cn
6	天风证券股份有限公司	400-800-5000	www.tfzq.com
7	信达证券股份有限公司	400-800-8899	www.cindasc.com
8	中国国际金融有限公司	021)58796226-3736	www.cicc.com.cn
9	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
10	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
11	中国中投证券有限责任公司	400-600-8008	www.china-invs.cn
12	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com

（五）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：单峰、张勇

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2015年6月5日的资产负债表如下：

资产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资产：		负债：	
银行存款	84,176,059.07	短期借款	-
结算备付金	6,824,870.87	交易性金融负债	-
存出保证金	363,590.18	衍生金融负债	-
交易性金融资产	880,887,178.52	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	880,887,178.52	应付证券清算款	4,425,054.64
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	63,819.11
基金投资	-	应付托管费	12,763.82
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	696,126.04
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	291,696.3	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	51,939.35
其他资产	-	负债合计	5,249,702.96
		所有者权益：	
		实收基金	873,820,061.00
		未分配利润	93,473,630.98
		所有者权益合计	967,293,691.98
资产合计：	972,543,394.94	负债与持有人权益总计：	972,543,394.94

注：1、截至2015年6月5日，基金份额净值2.2266元，基金份额总额434,429,801份。
2、本报告期自2015年5月13日起至2015年6月5日止。本基金合同于2015年5月13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2015年6月5日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
权益投资	880,887,178.52	90.58
其中：股票	880,887,178.52	90.58
固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	91,000,929.94	9.36
其他各项资产	655,286.48	0.07
合计	972,543,394.94	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	14,201,840.00	1.47%
B	采掘业	23,668,128.00	2.45%
C	制造业	494,113,956.81	51.08%
C0	食品、饮料	17,584,189.00	1.82%
C1	纺织、服装、皮毛	8,927,851.00	0.92%
C2	木材、家具	4,472,072.00	0.46%
C3	造纸、印刷	4,037,512.50	0.42%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,586,573.40	2.65%
C5	电子	26,485,063.56	2.74%
C6	金属、非金属	22,374,290.35	2.31%
C7	机械、设备、仪表	64,617,629.74	6.68%
C8	医药、生物制品	23,750,124.00	2.46%
C9	其他制造业	296,278,651.26	30.63%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,735,608.00	2.45%
E	建筑业	27,426,419.14	2.84%
F	交通运输、仓储业	59,700,274.04	6.17%
G	信息技术业	33,120,952.57	3.42%
H	批发和零售贸易	1,195,724.00	0.12%
I	金融、保险业	65,631,834.00	6.79%
J	房地产业	17,698,817.00	1.83%
K	社会服务业	69,948,938.70	7.23%
L	传播与文化产业	16,249,326.60	1.68%
M	综合类	34,195,359.66	3.54%
	合计	880,887,178.52	91.07%

（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	300059	东方财富	181,400	16,761,360.00	1.73
2	300168	万达信息	55,900	7,826,000.00	0.81
3	601099	太平洋	408,500	6,572,765.00	0.68
4	600635	大众公用	326,400	5,202,816.00	0.54
5	600820	隧道股份	259,500	5,151,075.00	0.53
6	002030	达安基因	63,300	5,062,101.00	0.52
7	600219	南山铝业	374,900	5,057,401.00	0.52
8	600601	方正科技	362,800	4,999,384.00	0.52
9	600037	歌华有线	115,500	4,965,345.00	0.51
10	002183	怡亚通	67,800	4,959,570.00	0.51

（四）按债券品种分类的债券投资组合

截止2015年6月5日，本基金未持有债券。

（五）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

截止2015年6月5日，本基金未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1 自本基金合同生效日至2015年6月5日，本基金前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2 本基金投资的前十名股票中，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	名称	金额 (元)
1	应收股利	-
2	应收利息	291,696.30
3	其他资产	363,590.18
	合计	655,286.48

4 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细

截止2015年6月5日，本基金未持有资产支持证券。

5 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细

截止2015年6月5日，本基金未持有权证。自基金合同生效日至2015年6月5日，本基金未投资任何权证。

6 本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2015年6月5日，本基金未持有可转换债券。

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2015年6月3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“三、基金的募集与上市交易”的“（三）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出如下承诺：

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）侵占、挪用基金财产；
（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
（8）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；
（2）违反基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
（6）玩忽职守、滥用职权；
（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以抬高自己；
（10）以不正当手段谋求业务发展；
（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；
（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

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。

（二）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。

（三）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。

（四）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

本基金上市推荐人华泰证券股份有限公司。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、基金份额的申购和赎回

本基金的基金份额分为场内份额与场外份额两种，分别适用不同的申购赎回办法。

（一）申购与赎回的场所

1、场内申购赎回

投资者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。

基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

2、场外申购赎回

对于在场外申购赎回的投资人，应当在基金管理人或其指定的其他销售机构办理本基金的申购和赎回，基金管理人在开始场外申购、赎回业务前公告有关场外申购赎回的具体办法，包括但不限于：适用场外申赎方式的条件、开放日场外申赎的截止时间、业务规则等等。

在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可根据市场情况停止办理场外申购赎回业务。在决定停止场外申购赎回业务情况下，基金管理人应采取适当措施对原有场外份额持有人作出妥善安排并提前公告。

3、特殊申购

在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的深市成份股，本基金联接基金可以采用实物方式或“深市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通的场内申购。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

场内投资人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、深圳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基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

场外投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间见基金管理人届时的相关公告。基金管理人可根据实际情况需要进行调整，具体办理时间以基金管理人的规定为准；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。本基金场外申购赎回的开放时间与场内申购赎回的开放时间存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。

场外投资人在基金合同约定之外的时间和日期提出申购、赎回等申请，且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，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介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2015年6月12日起同时开放场内、场外的申购、赎回业务。

（三）申购与赎回的原则

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；本基金的场外份额采用金额申购、份额赎回的方式，即申购以金额申请、赎回以份额申请。

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；本基金场外份额的申购对价、赎回对价为现金。

3、场外份额申购赎回遵循“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

4、场外份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

5、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。

6、场内申购、赎回申请提交后不得撤销；当日的场外申购、赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销。

7、场内申购赎回应遵守《业务规则》的规定；场外申购赎回应遵守基金管理人的相关业务规则。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、场内申购与赎回的程序

（1）申购与赎回的申请方式

基金投资者须按申购赎回代理券商的规定，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，其必须有足够的基金份额余额和现金。

（2）申购与赎回申请的确认

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。

（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，对于本基金的申购业务采用净额结算