上证市值百强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：长盛基金管理有限公司
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：上海证券交易所
上市时间：2013年5月31日
公告日期：2013年5月28日

一、重要声明与提示

上证市值百强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，长盛基金管理有限公司（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”）、上海证券交易所（以下简称“上交所”）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。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

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2013年3月27日《上海证券报》、上海证券交易所网站（www.sse.cn）以及本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《上证市值百强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”或“本合同”）和《上证市值百强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：百强ETF
2、二级市场交易代码：510700
3、基金申购赎回简称：百强申赎
4、申购赎回代码：510701
5、标的指数简称：上证市值百强指数
6、标的指数代码：000155
7、2013年5月24日基金份额总额：346,213,677.00份
8、2013年5月24日基金份额净值：1.842元
9、本次上市交易份额：346,213,677.00份
10、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
11、上市交易日期：2013年5月31日
12、申购赎回开放起始日：2013年5月31日
13、基金管理人：长盛基金管理有限公司
14、基金托管人：中国银行股份有限公司
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
16、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：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、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、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、恒泰证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、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、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、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、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、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司等44家证券公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、本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〔2013〕125号。
2、基金运作方式：交易型开放式。
3、基金存续期：不定期。
4、发售日期：2013年4月1日至2013年4月17日。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购以及网下股票认购三种方式认购本基金。其中，网下现金认购的日期为2013年4月1日起至2013年4月17日，网下股票认购的日期为2013年4月1日起至2013年4月17日，网上现金认购的日期为2013年4月15日起至2013年4月17日。
5、发售价格：1.00元人民币
6、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。
7、发售机构：

（1）网下现金发售直销机构
长盛基金管理有限公司直销中心

（2）网下现金及网下股票发售代理机构

光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、中航证券有限公司、华福证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、信达证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、华泰证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、招商证券股份有限公司等。

（3）网上现金发售代理机构

本基金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证券公司。具体名单为：

爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、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、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、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、恒泰证券有限责任公司、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、华泰证券股份有限公司、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、中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、万和证券经纪有限公司、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、中国国际金融有限公司、中国中投证券有限责任公司、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、中信证券（浙江）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、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、国开证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、开源证券有限责任公司等。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
9、募集资金总额及入账情况：

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（包含所募集股票市值）为622,671,073.00元人民币，折合基金份额622,671,073.00份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计9,450.00元人民币，折合基金份额9,450.00份。本次募集所有资金已于2013年4月23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上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金托管专户，所募集股票已于2013年4月22日过户至本基金开立在中国证券登记结算有限责任公司的本基金证券账户。

按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计622,680,523.00份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。其中本基金基金管理人用固有资金认购本基金的基金份额总额为0.00份，占本基金总份额的比例为0%；基金管理人的基金从业人员认购持有的基金份额总额为0.00份，占本基金总份额的比例为0%。基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0份。本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费等费用，不从基金财产中列支。

10、基金备案情况

根据相关法律法规和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金已符合基金备案条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2013年4月24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。

11、基金合同生效日：2013年4月24日
12、基金合同生效日的基金总份额：622,680,523.00份。
13、基金份额折算情况

基金管理人以2013年5月15日为本基金的基金份额折算日。当日上证市值百强指数收盘值为1791.807点，基金资产净值为620,348,678.96元，折算前基金份额总额为622,680,523.00份，折算前基金份额净值为0.996元。根据《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.55600584（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346,213,677.00份，折算后基金份额净值为1.792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2013年5月16日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产）。投资者可以自2013年5月17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）基金份额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：上海证券交易所上证基字【2013】128号
2、上市交易日期：2013年5月31日
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。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基金二级市场交易
4、基金二级市场交易简称：百强ETF
5、二级市场交易代码：510700
6、基金申购赎回简称：百强申赎
7、申购赎回代码：510701
8、本次上市交易份额：346,213,677.00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情况

（一）基金份额持有情况

截至2013年5月24日，本基金基金份额持有人户数为5395户，平均每户持有的基金份额为64,173.06份。

机构投资者持有的基金份额为118,698,357.00份，占基金总份额的34.28%；个人投资者持有的基金份额为227,515,320.00份，占基金总份额的65.72%。

（二）截至2013年5月24日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例
1	未来资产基金管理有限公司-未来资产中国A	25,020,262.00	7.23%
2	祁丽君	22,240,234.00	6.42%
3	光大证券股份有限公司	10,023,393.00	2.90%
4	平安证券有限责任公司	8,341,839.00	2.41%
5	中国国际金融有限公司	8,340,088.00	2.41%
6	中国银河证券股份有限公司	8,340,088.00	2.41%
7	中信证券股份有限公司	8,340,088.00	2.41%
8	上海证券有限责任公司	8,340,088.00	2.41%
9	中航证券有限公司	8,340,088.00	2.41%
10	中国对外经济贸易信托有限公司-伏牛1期(汇富130号)结构化证券	8,340,088.00	2.41%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息
名称：长盛基金管理有限公司
住所：深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元
办公地址：北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层
邮政编码：100088
法定代表人：凤良志
总经理：周兵
成立时间：1999年3月26日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]6号
组织形式：有限责任公司
注册资本：15000万元
存续期间：持续经营
信息披露负责人：叶金松
电话：（010）82019988
传真：（010）82255988
工商登记注册的法人营业执照文号：440301501120401
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。

2、经营概况

本基金管理人经中国证监会证监基金字［1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。截至目前，基金管理人股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。截至2013年5月24日，基金管理人共管理两只封闭式基金、二十六只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

公司目前下设二十四个部门、分公司及营销中心，分别是：权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、金融工程与量化投资部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、营销策划部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部。

权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理；研究部主要负责行业与上市公司研究，投资备选库建立、维护与更新；交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令；国际业务部主要负责QDII产品的投资运作管理及QFII投资顾问服务；金融工程与量化投资部主要负责数量化投资、基金产品的业绩评价等；社保业务管理部主要负责公司社保组合的投资管理工作；固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作；专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作；产品开发部主要负责基金新产品的开发报批及产品维护工作；市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等；营销策划部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划；北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作；业务运营部主要负责基金核算与估值、开放式基金注册与登记，以及资金清算等工作；信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护，以及相关系统的规划与开发等；财务会计部主要负责公司财务管理工作；人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理；总经理办公室主要负责公司行政事务的管理；监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。

截至2013年4月底，公司共有员工162人，其中具有硕士及以上学历的员工占62%，具有本科学历的员工占35%。研究员和基金经理98%以上拥有硕士及以上学历，公司员工平均年龄为33岁，平均金融从业年限8年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。

3、本基金基金经理

赵宏宇先生，1972年6月出生。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007年8月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理、现任首席产品开发师和金融工程与量化投资部副总监，上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（本基金）基金经理，长盛上证市值百强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

1、基本情况
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
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
行长：李礼辉
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
托管部门信息披露联系人：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

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，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

3、证券投资基金托管情况

截至2013年3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LOF、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、海富通精选或号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、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、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日盈债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、汇添富理财21天债券型发起式、国泰国证房地产业指数分级、招商央视财经50指数、嘉实中证中期企业债指数、大成中证100交易型开放式指数、长盛纯债债券型、华夏双债增强债券型、泰达宏利信用合利定期开放债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(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）、华宝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）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）、易方达标普全球高端消费品指数增强型（QDII）、建信全球资源股票型（QDII）、恒生交易型开放式指数（QDII）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接（QDII）、广发纳斯达克100指数（QDII）等197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：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
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：汪棣、张晓艺

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附录：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（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

本基金截至2013年5月24日的资产负债表如下：

单位：人民币元

资　产	期末数	负债和所有者权益	期末数
资产：		负债：	
银行存款	15,345,192.16	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	611,216,231.12	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	611,216,231.12	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	207,044.27
基金投资	-	应付托管费	41,408.86
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	567,702.98
应收证券清算款	11,482,695.50	应付税费	-
应收利息	179,593.68	应付利息	-
应收股利	225,777.00	应付利润	-
		其他负债	43,788.13
		负债合计	859,944.24
		所有者权益：	
		实收基金	622,680,523.00
		未分配利润	14,909,022.22
		所有者权益合计	637,589,545.22
资产合计：	638,449,489.46	负债与持有人权益总计：	638,449,489.46

附注：本报告期自合同生效日2013年4月24日起至2013年5月24日止，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2013年5月24日，本基金的投资组合如下：

（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	611,216,231.12	95.73
	其中：股票	611,216,231.12	95.73
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	15,345,192.16	2.40
6	其他资产	11,888,066.18	1.86
7	合计	638,449,489.46	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A农、林、牧、渔业	1,330,560.00	0.21
B采矿业	64,168,830.00	10.06
C制造业	134,463,911.12	21.09
D电力、热力、燃气及水的生产和供应业	11,680,680.00	1.83
E建筑业	24,480,390.00	3.84
F批发和零售业	9,241,980.00	1.45
G交通运输、仓储和邮政业	13,161,390.00	2.06
H住宿和餐饮业	-	-
I信息传输、软件和信息技术服务业	9,302,370.00	1.46
J金融业	315,519,270.00	49.49
K房地产业	16,789,740.00	2.63
L租赁和商务服务业	1,610,400.00	0.25
M科学研究和技术服务业	-	-
N水利、环境和公共设施管理业	-	-
P教育	-	-
Q卫生和社会工作业	-	-
R文化、体育和娱乐业	1,522,950.00	0.24
S综合	7,943,760.00	1.25
合计	611,216,231.12	95.86

注：本基金截止本报告期末所持有股票投资均为指数投资。

（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

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	4,422,000	46,121,460.00	7.23
2	600036	招商银行	2,772,000	37,449,720.00	5.87
3	601166	兴业银行	1,485,000	27,368,550.00	4.29
4	601318	中国平安	660,000	26,129,400.00	4.10
5	600000	浦发银行	2,178,000	22,215,600.00	3.48
6	601328	交通银行	3,828,000	18,183,000.00	2.85
7	600837	海通证券	1,584,000	17,820,000.00	2.79
8	600030	中信证券	1,353,000	17,156,040.00	2.69
9	601088	中国神华	660,000	13,774,200.00	2.16
10	601288	农业银行	4,917,000	13,423,410.00	2.11

注：本基金截止本报告期末所持有股票投资均为指数投资。

（四）按券种分类的债券投资组合：

注：本基金截止本报告期末未持有债券投资。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细：

注：本基金截止本报告期末未持有债券投资。

（六）投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期内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	-
2	应收证券清算款	11,482,695.50
3	应收股利	225,777.00
4	应收利息	179,593.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,888,066.18

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5月24日，本基金未持有可转换债券。

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5月24日，本基金持有的前十名股票中无流通受限情况。

6、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

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生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

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（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）在知悉可能对基金份额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、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所

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的申购与赎回。

目前本基金的一级交易商包括：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、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、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、恒泰证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、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、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、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、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、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司等44家证券公司。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、申购与赎回的开始时间

自2013年5月31日起，本基金开始办理申购、赎回业务。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所交易日，开放时间为上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。投资者应当在开放日办理申购和赎回申请，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。

若出现上海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并公告。

（三）申购与赎回的数额限制

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100万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在中国证监会指定媒体公告。

（四）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《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；
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权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据申购赎回清单备足申购对价。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，否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。

2、申购与赎回申请的确认

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。

投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点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，否则，如因申请未得到登记结算机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

（3）申购与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