华宝兴业现金添益交易型货币市场基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

华宝兴业基金管理有限公司

2013年1月23日

一、重要声明与提示

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金（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（试行）》和《华海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华宝兴业基金管理有限公司（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2012年12月15日刊登于《证券日报》、《证券时报》和华宝兴业基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）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：华宝添益。
2、二级市场交易代码：511990。
3、基金申购赎回简称：添益申赎。
4、申购赎回代码：511991。
5、2013年1月18日基金份额总额：18,026,280.00份。
6、2013年1月18日基金份额净值：100元。
7、本次上市交易份额：18,026,280.00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1月28日。
10、基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
12、上市推荐人：海通证券股份有限公司。
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、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、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、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、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司。若有新增代办券商，我司将另行公告。

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10日中国证监会证监许可【2012】1651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、发售日期：本基金自2012年12月19日起至2012年12月21日发售。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网上现金发售3个工作日。
7、发售方式：投资者可选择网上现金认购方式。
8、发售机构

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，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位：海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、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、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、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、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、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、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、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、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、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

（二）基金合同生效

截至2012年12月21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，本次募集确认的净认购金额为1,802,628,000.00元人民币，有效认购户数为10,558户，按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算，本次募集资金折合基金份额总计1,802,628,000.00份。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产，并由发行协调人划入基金托管专户，具体金额以银行实际结息金额为准。本次募集认购确认资金已于2012年12月27日全额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华宝兴业现金添益交易型货币市场基金托管专户。本基金管理人及本基金管理人的基金从业人员没有认购本基金。

根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）等法律法规以及《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，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2012年12月27日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。

（三）基金份额折算

根据《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金在基金合同生效当日，本基金管理人将为本基金办理份额折算，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。折算后每份基金份额对应的面值为100元，基金份额持有人持有的基金份额对应为折算前基金份额持有人持有的基金份额/100。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

本基金的份额折算日为2012年12月27日。本次募集认购金额为1,802,628,000.00元，折算前基金份额总额为1,802,628,000.00份，折算前基金份额净值为1.00元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法，本基金折算后的基金份额总额为18,026,280.00份，折算后基金份额净值为100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2012年12月27日进行了变更登记。投资者可以自2012年12月28日起在其上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

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：上海证券交易所上证基字【2013】17号。
2、上市交易日期：2013年1月28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：华宝添益。
5、二级市场交易代码：511990。

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：添益申赎。
7、申购赎回代码：511991。

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、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、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、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、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、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、中信证券股份有限公司。

8、本次上市交易份额：18,026,280.00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

（一）持有人户数

截至2013年1月18日，本基金份额持有人户数为10,558户，平均每户持有的基金份额为1,707份。

（二）持有人结构

截至2013年1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10,661,170份，占基金总份额的59.14%；个人投资者持有的基金份额为7,365,110份，占基金总份额的40.86%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2013年1月18日：

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	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2	3,600,000.00	19.97%
2	海通证券股份有限公司	2,000,000.00	11.09%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普	2,000,000.00	11.09%
4	华宝投资有限公司	500,000.00	2.77%
5	申银万国证券股份有限公司	500,000.00	2.77%
6	银河证券-光大-银河安心收益1号集合资产	500,000.00	2.77%
7	光大证券股份有限公司	499,980.00	2.77%
8	江海证券有限公司	200,000.00	1.11%
9	中信证券股份有限公司	200,000.00	1.11%
10	东兴证券-工行-东兴2号优质成长集合资产	150,000.00	0.83%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华宝兴业基金管理有限公司
2、法定代表人：郑安国
3、总经理：裴长江
4、注册资本：1.5亿元人民币
5、注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼
6、批准设立机关及批准设立文号：中国证监基金字【2003】19号
7、经营范围：在中国境内从事基金管理、发起设立基金；中国证监会批准的其它业务
8、股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东法国兴业资产管理有限公司持有49%的股份。
9、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设风险控制及合规委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责，下设投资决策委员会和内部控制委员会两个专业委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投研大部下设国内投资部、海外投资管理部、固定收益部、机构投资部、量化投资部、策略部及研究部。市场大部下设产品开发部、机构及海外销售部、专户销售部、营销策划部、市场支持部、电子商务部、七大投资服务中心、北京分公司及深圳分公司。营运大部下设交易部、清算登记部、财务部、信息技术部和人事行政部。此外，公司设有风险管理部、监察稽核部，由督察长协同总经理直接管理。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

10、人员情况：

截止到2012年12月31日，公司有员工180人，其中58%的员工具有硕士以上学历。

11、信息披露负责人：刘月华

电话：021-38505888

12、基金管理业务情况简介：

截至2012年12月31日，华宝兴业基金管理有限公司旗下共管理25只开放式基金，资产管理规模为376.61亿元。旗下管理的基金有华宝兴业宝康消费品证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金、华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金、华宝兴业中证100指数证券投资基金、华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金、上证180价值交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、上证180成长交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金、华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金、华宝兴业资源优选股票型证券投资基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金。

13、本基金基金经理

陈昕先生，2003年毕业于湖南大学，获经济学学士学位。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作，2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理，2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理，2012年6月兼任华宝兴业中证短融50债券基金基金经理，2012年12月兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

（二）基金托管人

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
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12号
联系人：田青
联系电话：（010）6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2012 年9月30日，中国建设银行资产总额132,964.82亿元，较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,585.19亿元，较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%，年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元，较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%，净利息收益率为2.74%，分别较上年同期提高0.01 和0.06 个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元，较上年同期增长1.64%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年“全球银行1000强”中位列第6，较去年上升2位；在美国《财富》世界500强中排名77位，较去年上升31位；在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位，较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”的上市公司，并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的“中国最佳银行”、“卓越管理及公司管治”与“2011年度最具社会责任金融机构”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工209人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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2012年9月30日，中国建设银行已托管267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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续三年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖。

（三）上市推荐人

海通证券股份有限公司
注册地址：上海淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
服务热线：95553、400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话
联系人：李笑鸣
公司网址：www.htsec.com

（四）一级交易商

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金（“华宝添益”）申购赎回代办券商名单如下：安信证券股份有限公司、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、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、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、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、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、中信证券股份有限公司。

（五）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233 号汇亚大厦1604-1608 室
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：刘颖
经办注册会计师：汪棣、刘颖

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2013年1月18日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2013年1月18日
资 产：	
银行存款	1,712,834,398.54
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	49,896,380.23
其中：股票投资	
债券投资	49,896,380.23
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	39,200,178.80
应收证券清算款	
应收利息	6,029,016.39
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	1,807,959,973.96
负债和所有者权益	本报告期末
	2013年1月18日
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	311,545.71
应付托管费	80,111.74
应付销售服务费	222,532.65
应付交易费用	453.80
应交税费	
应付利息	
应付利润	208,748.89
其他负债	13,808.16
负债合计	837,200.95
所有者权益：	
实收基金	1,807,122,773.01
未分配利润	
所有者权益合计	1,807,122,773.01
负债和所有者权益总计	1,807,959,973.96

注：本报告期自2012年12月27日起至2013年1月18日止。本基金合同于2012年12月27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2013年1月18日，本基金的投资组合情况如下：

1 、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	固定收益投资	49,896,380.23	2.76
	其中：债券	49,896,380.23	2.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,200,178.80	2.17
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,712,834,398.54	94.74
4	其他资产	6,029,016.39	0.33
5	合计	1,807,959,973.96	100.00

2 、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况：

截至2013年1月18日，本基金未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

3、基金投资组合平均剩余期限

①投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	37
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

②报告期内投资组合平均剩余期限超过120天的情况说明

截至2013年1月18日，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

③报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	85.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	5.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	8.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.71	-

4 、报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	49,896,380.23	2.76
	其中：政策性金融债	49,896,380.23	2.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	49,896,380.23	2.76
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120228	12国开28	500,000	49,896,380.23	2.76

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0005%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0001%

7、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1月18日，本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8 、投资组合报告附注

①）基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

②）截至2013年1月18日，本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

③）截至2013年1月18日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

④）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	-
3	应收利息	6,029,016.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,029,016.39

九、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、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。

十一、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为海通证券股份有限公司。上市推荐人与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。

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。

十二、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的开放日及时间

1、申购与赎回的开始时间

自2013年1月28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。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。

（二）申购和赎回场所

投资者应当在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。

目前本基金一级交易商包括：安信证券股份有限公司、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、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、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、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、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、中信证券股份有限公司。

（三）申购和赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制为：申购和赎回为10份或10份的整数倍。
2、上海证券交易所可根据基金管理人的要求对当日的赎回申请进行总量控制。
3、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购份额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

（四）申购和赎回的原则

1、“确定价”原则，即申购、赎回价格以每份基金份额净值为基准进行计算；
2、“份额申购、份额赎回”的方式，即申购以份额申请，赎回以份额申请；
3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
4、本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户。投资者赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。收益账户内高于100元以上的整百元收益将兑付为基金份额转入投资人的证券账户，投资人可在基金管理人网站查询收益账户明细。
5、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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体上公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的销售机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。

（六）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。

2.证券交易所或其他投资标的的交易市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4.基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5.基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6.上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理申购的情形。

7.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第4项以外的暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（七）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。

2.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.当日超出基金管理人规定的总量控制的赎回申请。

4.上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理赎回的情形。

5.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生除上述3以外的其他情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

（八）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2. 上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近1个开放日的每百份基金已实现收益和七日年化收益率。

3. 基金管理人可以根据暂停申