上证企债30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

博时基金管理有限公司

一、重要声明与提示

上证企债30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，博时基金管理有限公司（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。本基金托管人中国工商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2013年6月20日刊登于《上海证券报》和博时基金管理有限公司网站（www.bosera.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：企债ETF。
2、二级市场交易代码：511210。
3、基金申购赎回简称：企债申赎。
4、申购赎回代码：511211。
5、2013年8月9日基金份额总额：34,248,975.00份。
6、2013年8月9日基金份额净值：99.5318元。
7、本次上市交易份额：34,248,975.00 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8月16日。
10、基金管理人：博时基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
12、上市推荐人：招商证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、？光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司共10家证券公司。

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：2013年1月5日中国证监会证监许可〔2013〕15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2013年6月24日起至2013年7月5日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金认购的日期为2013年6月24日起至2013年7月5日，网下债券认购的日期为2013年6月24日起至2013年7月5日，网上现金认购的日期为2013年7月3日起至2013年7月5日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售10个工作日，网上现金发售3个工作日，网下债券认购10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债券认购3种方式。
8、发售机构
（1）直销机构
投资者可通过本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债券认购。
（2）代销机构
本基金的网下现金认购与网下债券认购的发售代理机构：国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、国元证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、第一创业证券股份有限公司、中航证券有限公司、德邦证券有限责任公司、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、中国中投证券有限责任公司、江海证券有限公司、天源证券有限公司、国金证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司。

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。

（二）基金合同生效

上证企债30交易型开放式指数证券投资基金自2013年6月24日起向全社会公开募集，于2013年7月5日募集工作顺利结束。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3,424,859,705.00元人民币（含所募集债券市值），折合基金份额3,424,859,705.00份；经基金注册登记机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计37,666.00元人民币，折合基金份额37,666.00份。本次募集所有资金已于2013年7月11日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的本基金托管专户，所募集债券已于2013年7月10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。

本次募集有效认购总户数为6070户，按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算，本次募集期间募集金额（含所募集债券市值）和利息结转的基金份额共计3,424,897,371.00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。博时基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）及本公司的基金从业人员没有认购本基金。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，不从基金财产中列支。

按照《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》、《上证企债30交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金已符合基金合同生效条件，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2013年7月11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《上证企债30交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证企债30交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）确定2013年7月29日为上证企债30交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

基金份额折算方法为：折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/100

折算后的基金份额四舍五入计算至整数位，尾差计入基金财产。

本基金管理人已根据上述折算方法于2013年7月29日对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算。本基金折算前基金份额总额为3,424,897,371.00份，折算前基金份额净值为0.9956元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后基金份额总额为34,248,975.00份，折算后基金份额净值为99.5572元。

本基金的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2013年7月30日进行了变更登记。基金份额持有人可以自2013年7月31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。

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债字〔2013〕151号。
2、上市交易日期：2013年8月16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：企债ETF。
5、二级市场交易代码：511210。

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：企债申赎。
7、申购赎回代码：511211。

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东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司共10家证券公司。

8、本次上市交易份额：34,248,975.00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8月9日，本基金份额持有人户数为6070户，平均每户持有的基金份额为5,642.00份。

（二）持有人结构

截至2013年8月9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29,935,485.00份，占基金总份额的87.41%；个人投资者持有的基金份额为4,313,490.00份，占基金总份额的 12.59%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2013年8月9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	招商证券股份有限公司	10,186,480.00	29.74%
2	海通证券股份有限公司	5,924,043.00	17.30%
3	东方证券股份有限公司	2,585,109.00	7.55%
4	光大证券股份有限公司	1,033,686.00	3.02%
5	方正证券股份有限公司	1,016,440.00	2.97%
6	信诚人寿保险有限公司	844,600.00	2.47%
7	华泰证券股份有限公司	787,088.00	2.30%
8	光证资管-光大-光大阳光北斗星集合资产管理计划	672,231.00	1.96%
9	长江证券股份有限公司	501,000.00	1.46%
10	合众人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	500,060.00	1.46%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：博时基金管理有限公司
2、法定代表人：杨鹏
3、总经理：吴姚东
4、注册资本：2.5亿元人民币
5、注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
6、设立批准文号：中国证监会证监基金字〔1998〕26号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103465194号
8、经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务（涉及行政许可的凭许可证经营）
9、股权结构：招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；璟安股权投资有限公司，持有股份6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份6%；上海丰益股权投资基金有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。
10、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。公司设立了投资决策委员会。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。

公司下设三大总部和十一个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、产品规划部、董事长办公室、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部和国际组。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。国际组负责公司海外投资业务中与权益类资产管理和研究相关的工作。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。市场销售总部负责公司全国范围内的客户、销售和服务工作。市场销售总部下设机构与零售两大业务线和营销服务部。机构业务线含战略客户部、机构-上海、机构-南方三大区域和养老金部、券商业务部两个部门。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售业务线含零售-北京、零售-上海、零售-南方三大区域，以及电子商务部、客户服务中心。其中，零售三大区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。电子商务部负责公司电子商务业务的发展、各部门使用公司官方网站营销资源的归口管理和公司直销网上交易平台的建设与管理工作。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。营销服务部负责营销策划、总行渠道维护和销售支持等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。董事长办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。总裁办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳、郑州和成都处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司：博时基金（国际）有限公司。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

11、人员情况：

截至2013年6月30日，博时共有员工365名，其中拥有博士19人、硕士214人、学士113人，大中专19人。

12、信息披露负责人：孙麒清

电话：0755-83169999

13、基金管理业务情况简介：

截至2013年6月30日，博时基金管理有限公司旗下共管理37只开放式基金和2只封闭式基金。旗下管理的封闭式基金有裕阳证券投资基金和裕隆证券投资基金。开放式基金有博时价值增长混合、博时裕富沪深300指数、博时现金收益货币、博时精选股票、博时主题行业股票（LOF）、博时稳定价值债券、博时平衡配置混合、博时价值增长贰号混合、博时第三产业股票、博时新兴成长股票、博时特许价值股票、博时信用债券、博时策略混合、博时上证超大盘ETF及联接基金、博时创业成长股票、博时大中华亚太精选股票（QDII）、博时宏观回报债券、博时转债增强债券、博时行业轮动股票、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）、博时卓越品牌股票（LOF）、博时深证基本面200ETF及联接基金、博时裕祥分级债券、博时回报混合、博时天颐债券、博时上证自然资源ETF及联接基金、博时医疗保健行业股票、博时信用债纯债债券、博时标普500指数（QDII）、博时理财30天债券、博时亚洲票息收益债券（QDII）、博时安盈债券、博时安心收益债券、博时岁岁增利一年定期开放债券。

14、本基金基金经理

杨水光先生，硕士。1989年至1993年在湖南大学电气工程系学习，获学士学位；1999年至2002年在广西大学金融学专业学习，获硕士学位。1993年9月至1995年3月在桂林电器科学研究所仪表室工作，任助理工程师；1995年6月至1997年1月在深圳迈瑞医疗仪器公司工作，任工程师；2001年10月至2011年3月在国海证券债券投资部工作，任高级投资经理。2011年3月14日加入博时基金管理有限公司，任固定收益部投资经理。现任博时天颐债券基金和博时上证企债30ETF的基金经理。

赵云阳先生，硕士。1997年至2001年在中国石油大学计算数学及其应用软件专业学习，获学士学位。2001年至2004年在广州大学应用数学系学习，获硕士学位。2003年12月至2010年8月在Morningstar晨星中国基金研究中心工作，任量化组负责人兼资深分析师。2010年8月31日加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化分析师、量化分析师兼任基金经理助理。现任博时深证基本面200基金及其联接基金和博时上证企债30ETF的基金经理。

（二）基金托管人

1、名称：中国工商银行股份有限公司
2、住所：北京市西城区复兴门内大街55号
3、成立时间：1984年01月01日
4、法定代表人：姜建清
5、基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字〔1998〕3号
6、注册资本：人民币349,018,545,827元
7、存续期间：持续经营
8、电话：010-66105799
9、资产托管部信息披露负责人：赵会军
10、基金托管部人员情况：

截至2013年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工163人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

11、基金托管业务情况简介：

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年3月，中国工商银行共托管证券投资基金305只，其中封闭式10只，开放式295只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的37项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）上市推荐人

1、名称：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
法定代表人：宫少林
电话：0755-82960223
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务电话：400-8888-111；95565
网址：http://www.newone.com.cn/

（四）一级交易商

1、名称：招商证券股份有限公司
住所：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：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务电话：400-8888-111；95565
网址：http://www.newone.com.cn/
2、名称：中信证券股份有限公司
住所：深圳市深南路7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
电话：010-84588888
传真：010-84865560
联系人：陈忠
客户服务电话：010-84588888
网址：http://www.cs.ecitic.com/
3、名称：海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
电话：021-23219275
传真：021-63602722
联系人：金芸、李笑鸣
客户服务电话：95553
网址：www.htsec.com
4、名称：中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层法定代表人：沈强
电话：0571-86087713
传真：0571-85783771
联系人：姚锋
客户服务电话：0571-95548
网址：http://www.bigsun.com.cn/
5、名称：华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
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
电话：025-84457777
传真：025-84579763
联系人：庞晓芸
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
6、名称：中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
客户服务电话：0532）96577
网址：www.zxwt.com.cn
7、名称：东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：王益民
电话：021-63325888-3108
传真：021-63326173
联系人：吴宇
客户服务电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn
8、名称：方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
电话：0731-85832503
传真：0731-85832214
联系人：郭军瑞
客户服务电话：95571
网址：http://www.foundersc.com
9、名称：光大证券股份有限公司
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
电话：021-22169081
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：4008888788；95525
网址：http://www.ebscn.com/
10、名称：东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
电话：021-50586660
传真：021-58319590
联系人：汪汇
客户服务电话：95531；4008888588
网址：http://www.longone.com.cn

（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：上海市浦东新区东昌路568号
办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
电话：021-61238888
传真：021-61238800
经办注册会计师：薛竞、陈宇

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8月9日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2013年8月9日
资 产：	
银行存款	203,160,514.36
结算备付金	17,907,388.65
存出保证金	70,725.46
交易性金融资产	2,560,648,422.50
其中：股票投资	-
债券投资	2,560,648,422.50
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	572,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	57,441,283.46
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	128,165.90
资产总计	3,411,356,500.33
负债和所有者权益	本报告期末
	2013年8月9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	1,989,305.01
应付赎回款	-
应付管理人报酬	336,327.78
应付托管费	84,081.95
应付销售服务费	-
应付交易费用	-534.17
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	86,100.61
负债合计	2,495,281.18
所有者权益：	
实收基金	3,424,897,371.00
未分配利润	-16,036,151.85
所有者权益合计	3,408,861,219.15
负债和所有者权益总计	3,411,356,500.33

注：1、截至2013年8月9日，基金份额净值99.5318元，基金份额总额34,248,975.00份。

2、本报告期自2013年7月11日起至2013年8月9日止。本基金合同于2013年7月11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8月9日，本基金的投资组合情况如下：

（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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,560,648,422.50	75.06
	其中：债券	2,560,648,422.50	75.06
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	572,000,000.00	16.77
	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	221,067,903.01	6.48
6	其他资产	57,640,174.82	1.69
7	合计	3,411,356,500.33	100.00

（二）按券种分类的债券投资组合

序号	券种类别	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	2,560,648,422.50	75.12
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,560,648,422.50	75.12

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	122033	09富力债	2,950,000	301,490,000.00	8.84
2	122106	11唐新01	2,978,880	301,462,656.00	8.84
3	122149	12石化01	2,900,000	284,171,000.00	8.34
4	122114	11一重债	2,100,000	209,580,000.00	6.15
5	122660	12石油07	2,000,000	200,400,000.00	5.88

（四）按行业分类的股票投资组合

截至2013 年8月9日，本基金未持有股票。

（五）投资组合报告附注

1、自基金合同生效日至2013 年8月9日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金前十名债券中，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
1	存出保证金	70,725.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,441,283.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	128,165.90
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,640,174.82

4、权证投资情况

截至2013 年8月9日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2013 年8月9日，本基金未投资任何权证。

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2013 年8月9日，本基金未持有可转换债券。

6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至2013 年8月9日，本基金未持有资产支持证券。

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2013年7月29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“（三）基金份额折算”。

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《基金法》、《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。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为招商证券股份有限公司。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

（一）、申购与赎回场所

投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所或按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。

目前本基金一级交易商包括招商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信金通证券股份有限公司、中信万通证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东海证券股份有限公司和华泰证券股份有限公司共10家证券公司。

（二）、申购与赎回的开放日及时间

自2013年8月16日起，本基金开始办理申购、赎回业务。

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，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。

基金合同生效后，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，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、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。

基金管理人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。

（四）、申购与赎回的程序

1、申购与赎回的申请方式

投资人必须根据申购、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。

投资人申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的债券和现金。投资人提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购与赎回申请的确认

在正常情况下，基金投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人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。

3、申购与赎回的清算交收与登记

投资人T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资人办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等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。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《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》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益，并不违背交易所和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

（五）、申购与赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金的最小申购赎回单位为3万份。

2、本基金将根据运作情况，设定可接受的总申购份额及总赎回份额上限。

基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制，并在调整实施3日前在指定媒体上公告（其中上述第2条基金管理人必须于前一交易日设定并在基金管理人网站上公布，而不必在指定媒体上公告也无须报中国证监会备案）。

（六）、申购与赎回的对价和费用

1、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人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。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，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、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照一定标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（七）、申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书规定的原则，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

①）关于可以现金替代

1）适用情形：出于证券停牌等原因导致投资人无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

2）替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该部分证券恢复交易后买入，而实际买入价格（净价加上应计利息）加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金