

## 上证50交易型开放式指数证券投资基金

## [2012] 第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一二年四月二十三日  
§1 重要提示  
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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品概要。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告告期自2012年1月1日起至3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称 上证50ETF

基金主代码 510050

交易代码 510050

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2004年12月30日

报告期末基金份额总额 12,406,566.757份

投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在因特殊原因(如流动性不足)导致无法获得足量数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

业绩比较基准 上证50指数。

风险收益特征 本基金股票基金,风险与收益高于混合基金,债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -253,294,726.12

2.本期利润 1,198,582,673.30

3.加权平均基金份额本期利润 0.0974

4.期末基金资产净值 21,321,076,816.41

5.期末基金份额净值 1.719

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为期初至本期末公允价值变动收益。

③基金净值表现

④本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑤本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑥本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑦本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑧本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑨本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑩本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑪本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑫本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑬本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑭本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑮本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑯本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑰本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑱本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑲本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

⑳本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉑本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉒本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉓本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉔本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉕本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉖本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉗本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉘本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉙本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉚本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉛本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉜本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉝本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉞本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉟本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

㉟本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较