

上证50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2 0 0 8 年第 2 号

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

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	-	-
B	采掘业	2,771,632,612.86	13.16
C	制造业	2,909,220,846.79	13.82
C0	食品、饮料	818,450,537.64	3.89
C1	纺织、服装、皮毛	218,335,324.88	1.04
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,931,780.00	0.03
C5	电子	165,055.00	0.00
C6	金属、非金属	1,477,111,828.29	7.02
C7	机械、设备、仪表	388,226,120.98	1.84
C8	医药、生物制品	-	-
C09	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,195,274,031.99	5.68
E	建筑业	236,948,176.68	1.13
F	交通运输、仓储业	2,107,861,506.85	10.01
G	信息技术业	808,664,329.03	3.84
H	批发和零售贸易	196,472,256.00	0.93
I	金融、保险业	9,367,497,214.19	44.49
J	房地产业	299,498,878.50	1.42
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	202,515,331.41	0.96
	合计	20,095,585,184.30	95.44

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	112,511,308	1,083,449,246.96	9.42
2	601088	中国神华	49,538,888	1,356,870,142.32	6.44
3	601318	中国平安	37,383,342	1,243,743,788.34	5.91
4	600016	民生银行	195,959,557	1,011,151,314.12	4.80
5	600030	中信证券	38,436,680	951,692,196.80	4.52
6	600000	浦发银行	59,882,596	935,366,149.52	4.44
7	601166	兴业银行	44,493,399	731,026,545.57	3.47
8	600519	贵州茅台	5,406,580	713,073,836.20	3.39
9	600050	中国联通	129,469,579	688,194,597.13	3.36
10	600900	长江电力	47,938,995	687,924,578.25	3.27

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	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	34,439,374.20	0.16
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	34,439,374.20	0.16

5. 报告期末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

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	126014	08国债	282,470	22,897,018.20	0.11
2	126012	08上国债	126,450	11,542,356.00	0.05
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6. 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 投资组合报告附注

(1) 报告期内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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,874.41
2	应收证券清算款	57,484,966.77
3	应收股利	8,536,305.02
4	应收利息	358,447.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,082.96
8	其他	-
9	合计	66,397,676.38

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	687,924,578.25	3.27	控股股东拟实施业务整体上市方案

(6) 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。

2	应收证券清算款		57,484,966.77
3	应收股利		8,536,306.02
4	应收利息		358,447.22
5	应收申购款		
6	其他应收款		
7	待摊费用	15,082.96	
8	其他		
9	合计	66,397,676.38	

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	687,924,578.25	3.27	控股股东拟实施业务整体上市方案

(6)由于四舍五入的原因,公允价值与会计金额之间可能存在差异

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900 长江电力	687,924,578.25	3.27	控股股东拟实施业务整体上市方案

(6) 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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
2004年12月30日至2005年12月31日	-0.10%	0.07%	-0.12%	0.05%	0.02%	0.02%
2005年1月1日至2005年12月31日	-3.29%	1.21%	-5.50%	1.25%	2.21%	-0.04%
2006年1月1日至2006年12月31日	12.78%	1.33%	126.69%	1.39%	1.09%	-0.06%
2007年1月1日至2007年12月31日	135.79%	2.20%	134.13%	2.28%	1.66%	-0.08%
2008年1月1日至2008年6月30日	-46.19%	2.87%	-48.53%	3.06%	2.34%	-0.19%

十三、费用概览

(一)基金运作费用

1. 基金费用的种类

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

(1) 基金管理人的管理费;

(2) 基金托管人的托管费;

(3) 基金上市费及年费;

(4) 证券交易费用;

(5) 基金收益分配中发生的费用;

(6) 基金合同持有人大会费用;

(7) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和信息披露费用;

(8) 其他按照国家有关规定可以列入的费用。

2. 基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

(1) 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:

$H=E \times 0.5\%$ ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:

$H=E \times 0.1\%$ ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金托管人。

(3) 基金管理人性和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

(4) 本基金第(一)款第1项中第(3)至第(8)项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定,按费用实际支出金额支付。

3. 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无事项发生的费用等不列入基金费用。

(二) 基金销售费用

1. 申购、赎回的对价、费用及价格

(1) 申购对价是指投资者申购基金份额时应付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时,基金管理人应付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额确定。

(2) 投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(3) 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。T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。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。

2. 本基金申购、赎回均以份额申请,费用计算公式为:

申购赎回佣金=申购赎回金额×佣金比率

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资者申购、赎回确认时收取,用于市场推广、销售和服务费用,证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

十四、对招募说明书更新部分说明

上证50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《上证50指数交易型开放式指数证券投资基金合同》及其他法律法规的要求,对本基金管理人于2008年8月14日刊登的本基金招募说明书(更新)进行了更新,主要更新内容如下:

(一) 更新了“三、基金管理人”的“主要人员情况”。

(二) 更新了“四、基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况。

(三) 更新了“五、相关服务机构”的“基金份额销售机构”的相关信息,更新了会计师事务所相关信息。

(四) 以2008年12月30日的数据对“十、基金份额的申购与赎回”的“申购、赎回清单的格式”的信息进行了更新。

(五) 更新了“十一、基金的投资”中“投资组合报告,该部分内容均按有关规定编制。

(六) 更新了“十二、基金的业绩”中“基金业绩”的相关内容,并经基金托管人复核。

(七) 更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”的相关内容。

(八) 更新了“二十四、其他应披露事项”,披露了自上次招募说明书截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二〇〇九年二月十三日

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,096,772,351.75	95.31
	其中:股票	20,096,772,351.75	95.31
2	固定收益投资	34,439,374.20	0.16
	其中:债券	34,439,374.20	0.16
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	889,116,468.35	4.22
7	其他资产	66,397,676.38	0.31
7	合计	21,086,725,870.68	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值1,187,167.45元。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	100%
合计	100%

(二) 主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

王东明先生:董事长,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中信基金管理有限公司董事长,中国国际信托投资公司董事、协理,中信控股有限公司董事、中信国际信托投资有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事,北京华远经济建设公司副总经理,加拿大枫叶银行证券公司部门副经理,南方证券公司副总裁,华夏证券公司发行部副总经理等职务。

范勇宏先生:董事,总经理,博士。曾任华夏证券股份有限公司总经理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东西营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王连洲先生:独立董事,学士。现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制管理局工作。

龙涛先生:独立董事,硕士。现任海问投资咨询有限公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计师事务所从事审计和财务分析工作。

陈建先生:独立董事,学士。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾任中国国际贸易促进委员会资产管理委员会资产管理中心主任。

滕天鸣先生:执行副总经理,硕士。曾任华夏证券助理和机构理财部总经理等。

方瑞枝女士:督察长,硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生:监事,硕士。现任西南证券股份有限公司研发中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生:监事,学士,中国注册会计师协会非执业会员。曾任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监。曾任华夏证券股份有限公司并购业务部常务副总经理、计划财务部副总经理,投资银行总部副总经理,中华会计师事务所注册会计师。

瞿福女士:监事,硕士,中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部总经理助理。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

2. 本基金基金经理

方军先生:兴华。1999年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员,华夏成长证券投资基金基金经理助理,兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。现任金融工程部副总经理,上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2004年12月30日起任职)、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理(2006年6月8日起任职)。

3. 本公司投资决策委员会(股票投资)成员

范勇宏先生:华夏基金管理有限公司董事、总经理。

王亚伟先生:华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘文明先生:华夏基金管理有限公司投资总监,共同担任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

程海泳先生:华夏基金管理有限公司国际投资总监,华夏基金管理有限公司基金经理。

张益驰先生:华夏基金管理有限公司投资执行副总监,华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理。

孙建冬先生:华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏复兴股票型证券投资基金基金经理,共同担任华夏红利混合型证券投资基金基金经理。

郭树强先生:华夏基金管理有限公司机构投资总监,华夏基金管理有限公司基金经理。

4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

联系人:蒋松云

(二) 主要人员情况

截至2008年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工117人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三) 基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严谨科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异成绩。截至2008年12月,托管证券投资基金107只,其中封闭式8只,开放式99只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、期货类资产、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2008年初,中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财富》、《证券时报》和《上海证券报》等国际国内媒体评选为2007年度“中国最佳托管银行”,自2004年以来,工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到12项。

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1. 申购赎回代理证券公司(简称“一级交易商”)

(1) 国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人:杨国一

电话:021-38676666

传真:021-38670666

联系人:韩星宇

网址:www.gtja.com

客户服务电话:021-962588,400-888-8666

(2) 中信建投证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳区内大街188号

法定代表人:张佑君

客户服务电话:400-888-8108

传真:010-65182261

联系人:权唐

网址:www.csc108.com

(3) 国信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼

法定代表人:何如

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

联系人:林建国

网址:www.guosen.com.cn

客户服务电话:400-810-8868

(4) 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40层

法定代表人:肖冰

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:黄健

网址:www.newone.com.cn

客户服务电话:400-888-1111,95565

(5) 广发证券股份有限公司

住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广东省广州市天河区北路183号大都会广场36,38,41,42楼

法定代表人:王卫伟

电话:020-87555888

传真:020-87557985

联系人:肖梅

网址:www.gf.com.cn

客户服务电话:020-87558888-875

(6) 中信证券股份有限公司

住所:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

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:010-84588266

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.ccit.com

客户服务电话:各地营业部咨询电话

(7) 中国银河证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金地的金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:肖时庆

客户服务电话:800-82-1868

传真:010-66568536

联系人:李洋

网址:www.chinastock.com.cn

(8) 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:上海市黄浦区广东路689号10楼

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-63410456

联系人:金宏、李笑鸣

网址:www.htsec.com

客户服务电话:021-962503,400-888-8001或拨打各城市营业网点咨询电话

(9) 联合证券有限责任公司

住所:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10,24,25层

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10,24,25层

法定代表人:马昭明

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

联系人:梁宗凌

网址:www.lhzq.com

客户服务电话:400-888-8555,0755-25125666

(10) 申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54030294

联系人:李倩怡

网址:www.sw2000.com.cn

客户服务电话:021-962505

(11) 兴业证券股份有限公司

住所:福建省福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦22楼

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

传真:021-68419867

联系人:谢高得

网址:www.xyzq.com.cn

客户服务电话:021-68419393转1098

(12) 长江证券股份有限公司

住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运训

电话:021-63219281

传真:021-63162970

联系人:李良

网址:www.95579.com

客户服务电话:400-888-8999,027-85808318

(13) 中信金通证券股份有限公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783715

传真:0571-85783771

联系人:王勤

网址:www.69598.com.cn

客户服务电话:0571-96598

(14) 国元证券股份有限公司

住所:合肥市寿春路179号

办公地址:合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良忠

电话:0551-2207938

传真:0551-2634400-1171

联系人:祝蔚萍

网址:www.gyzq.com.cn

客户服务电话:全国:400-888-8777,安徽地区:96888

(15) 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:025-84457777-893

传真:025-84579879

联系人:程高峰

网址:www.htsec.com.cn

客户服务电话:400-888-8168,025-84579897

(16) 中信万通证券股份有限公司

住所:青岛市崂山区秦岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

电话:0532-85020206

传真:0532-85020206

联系人:丁韶燕

网址:www.zwt.com.cn

客户服务电话:0532-96577

(17) 东方证券股份有限公司

住所: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

传真:021-63326173

联系人:吴宇

网址:www.dfqz.com.cn

客户服务电话:95503

(18) 光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闻路1508号

办公地址:上海市静安区新闻路1508号

法定代表人:徐浩明

电话:021-68816000

传真:021-68815009

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

客户服务电话:10108998或拨打各城市营业网点咨询电话

(19) 南京证券股份有限公司

住所:南京市鼓楼区大钟亭8号

办公地址:南京市鼓楼区大钟亭8号

法定代表人:张华东

客户服务电话:025-83364032

传真:025-83364032

联系人:石健

网址:www.njqz.com.cn

(20) 上海证券有限责任公司

住所:上海市西藏中路336号

办公地址:上海市西藏中路336号

法定代表人:蒋元真

电话:021-51539888

传真:021-65217206

联系人:谢秀峰

网址:www.962518.com

客户服务电话:021-962518

(21) 平安证券有限责任公司

住所:深圳福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法人代表:陈敬达

电话:0755-82450826

传真:0755-82433794

联系人:袁月

网址:www.pa18.com

客户服务电话:400-886-6338

(22) 国海证券股份有限公司

住所:广西南宁市滨湖路46号

办公地址:广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅萍

电话:0771-5539262

传真:0771-5539033

联系人:覃清芳

网址:www.gkhz.com.cn

客户服务电话:全国:400-888-8100,广西:96100

(23) 中原证券股份有限公司

住所:许昌市南关大街38号

办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸大厦11楼

法定代表人:石保上

电话:0371-65585670

传真:0371-65585670

联系人:程月艳

网址:www.ccnew.com, www.zyqz.cn

客户服务电话:0371-967218

(24) 国都证券有限责任公司