

## 上证50交易型开放式指数证券投资基金

[2011] 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:二〇一一年四月二十二日  
§ 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基金合同规定，于2011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内容，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其未来表现。投资有风险，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。  
§ 2 基金产品概况

基金简称:华夏上证50ETF  
基金代码:510050  
交易场所:上海证券交易所  
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:9,633,566,757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:本基金主要采用完全复制法,即基金按照标的指数的成份股构成及其权重长期持有基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动情况定期调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法完全复制标的指数时,基金管理人将根据具体情况使用其他方法进行投资。  
业绩比较基准:本基金业绩比较基准为“上证50指数”。

风险收益特征:本基金属股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为交易型开放式基金,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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -235,478,829.46

2.本期利润 1,020,436,974.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.103

4.期末基金份额净值 19,968,817,155.93

5.期末基金份额净值 2.073

(注:本基金业绩比较基准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将低于所列数字。  
②本公司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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
③基金的净值表现

3.2.1报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 红利收益率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

① ② ③ ④

过去三个月 5.12% 1.28% 5.38% -0.26% 0.00%

3.2.2本基金合同生效以来基金份额净值增长率和净值增长率历史走势对比图

上证50交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2004年1月30日至2011年3月31日)

3.4 管理人报告

4.1基金管理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

方军 本基金的基金经理 2004-12-30 - 12年 哲学硕士。1999年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、兴华证券投资基金经理助理和兴华回报证券投资基金基金经理助理。

注:①上述任职日期,即任本基金基金经理的日期;②离任日期,即停止担任本基金基金经理的日期。  
③证券从业的含义指在行业协会、证券业协会从业人员资格管理办法的相关规定。

④管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑤公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下所有的基金和组合,制定并严格执行公平的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易行为。

⑥关联交易公平的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑦公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下所有的基金和组合,制定并严格执行公平的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易行为。

⑧关联交易公平的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑨公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下所有的基金和组合,制定并严格执行公平的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易行为。

⑩公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑪公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑫公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑬公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑭公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑮公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑯公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑰公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑱公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑲公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

⑳公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉑公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉒公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉓公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉔公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉕公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉖公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉗公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉘公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉙公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉚公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉛公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉜公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉝公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉞公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

㉟公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、监管当局的有关规定,诚实信用、勤勉尽责、安全高效的履行职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。