

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

2008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

重要提示

上证50交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2004年11月22日证监基金字[2004]196号文批准募集。本基金基金合同于2004年12月30日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,本基金的特定风险等。本基金属股票基金,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。投资者申购基金时,应认真阅读本招募说明书,全面了解本基金的基金投资特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其承认基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《暂行办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2008年12月30日,有关财务数据截止日为2008年9月30日,净值表现数据截止日为2008年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:华夏基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座3层
设立日期:1998年4月9日
法定代表人:凌新源
总经理:范勇宏
联系人:滕为
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-88066511
华夏基金管理有限公司注册资本为13800万元,公司股权结构如下:

| 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党委书记,中国国际信托投资公司董事,协理,中信控股有限责任公司董事,中国国际金融控股有限公司董事,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、代总经 理,北京华远经济建设(集团)有限公司董事,加拿大银行(香港)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裁助理,华夏业务总监,华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理,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。

龙海先生: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。
涂建宁先生: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管理咨询委员会资产管理中心主任。
滕天鸣先生:执行副总经理,硕士。曾任公司总经理助理和机构理财部副总经理等。方耀枝女士:督察长,硕士。曾在中国金融出版社工作。
周伟明先生:督察长,硕士。现任西南证券股份有限公司研发中心高级经理,证券研究员,副经理。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。
张鸣藏先生: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。
翟晓女士: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:基金经理,1999年加入华夏基金管理公司,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 股票投资决策委员
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:华夏大蓝筹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。

刘文功先生: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。
程海澜先生: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。
张益群先生: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。

孙建生先生: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。
郭晓晖先生: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
成立日期: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:蒋晓青

(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学位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以“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格按照着资产托管人的责任和义务,依靠严密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、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》、《财资》、《证券时报》和《上海证券报》等国内国际媒体评选为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)基金代销销售机构
1.申银万国证券股份有限公司(简称“一级交易商”)
① 国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道168号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:祝一凡
电话:021-38676666
传真:021-38670660
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:北京市朝阳门内大街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:权鹏
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:0755-82113083
传真:0755-82133302
联系人:林建润
网址:www.guosen.com.cn
客户服务电话:800-810-8868
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:宫少林
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:400-888-8111,95565
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:王志伟
电话:020-87558888
传真:020-87557985
联系人:闫梅
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:北京市朝阳区新源南路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:010-84585660
联系人:陈忠
网址:www.ccit.com.cn
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:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:尚时庆
客户服务电话:800-820-1868
传真:010-66585636
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:金雯、李荣鸣
网址:www.htsc.com.cn
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:李清怡
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
电话:021-68419974
传真:021-68419867
联系人:谢高波
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:胡运武
电话:021-63219781
传真:021-51062920
联系人:李良
网址:www.95579.com
客户服务电话:400-888-8999,027-85808318
⑬ 中信证券(浙江)有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯法院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯法院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:0571-85783713
传真:0571-85783771
联系人:王勤
网址:www.96598.com.cn
客户服务电话:0571-96598
⑭ 湘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:吴良志
电话:0551-2207938
传真:0551-2634400-1171
联系人:祝丽萍
网址:www.xzq.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:程海峰
网址:www.htsc.com.cn
客户服务电话:400-888-8168,025-84579897
⑯ 中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市东海西路28号
办公地址:北京市中山东路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁韶磊
网址:www.zxw.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:刘晖
网址:www.dfsc.com.cn
客户服务电话:10108899或拨打各城市营业网点咨询电话
⑱ 南京证券有限责任公司
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:025-8364032
传真:025-8364032
联系人:石健
网址:www.njzq.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:蒋元元
电话:021-51598888
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(八卦三路)平安大厦三樓
办公地址:深圳福田区八卦(八卦三路)平安大厦三樓
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:张维群
电话:0771-5539262
传真:0771-5539033
联系人:覃芳芳
网址:www.gzhq.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.zyqj.cn
客户服务电话:0371-967218
㉔ 招商证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4028号安联大厦26层11,12
办公地址:北京东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:王少华
电话:010-84183389
传真:010-64482090
联系人:黄静
网址:www.guodu.com
客户服务电话:400-818-8118
㉕ 渤海证券股份有限公司
住所:常州延陵西路59号常信大厦18,19楼
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中法广场17楼
法定代表人:李科敏
电话:021-50586660
传真:021-50586660-8880
联系人:邵一明
网址:www.bhzq.com.cn
客户服务电话:0519-8166222,0379-64912266
㉖ 齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:0531-81283728

传真:0531-81283735
联系人:傅咏梅
网址:www.qfj.com.cn
客户服务电话:0531-82084184
㉗ 第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
电话:0755-25832494
传真:0755-25831718
联系人:王立洲
网址:www.focsc.com
客户服务电话:0755-25835253
㉘ 富泰证券有限责任公司
住所:南京市长江路88号
办公地址:南京市长江路88号
法定代表人:钱卫法
客户服务电话:025-84784765
传真:025-84784830
联系人:舒胡非
网址:www.thopec.com
㉙ 中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街一号国贸大厦2层28层
办公地址:北京建国门外大街一号国贸大厦2层28层
法定代表人:建建
电话:021-58796226
传真:021-68875123
联系人:王欢
网址:www.cicic.com.cn

2.二级市场交易代理证券公司
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。
3.基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理发售本基金,并及时公告。
(二)登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层
办公地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层
法定代表人:陈耀先
联系人:刘永江
联系电话:021-58872625
传真:021-68870311
(三)律师事务所
名称:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
法定代表人:刘军
联系电话:010-66575888
传真:010-65232161
联系人:李娜
经办律师:李志宏、李娜
(四)会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市长安大街1号东方广场东塔楼安永大厦16层
办公地址:北京市长安大街1号东方广场东塔楼安永大厦16层
法定代表人:葛明
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

(五)基金名称
本基金名称:上证50交易型开放式指数证券投资基金。
(六)基金的投资目标
本基金的投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
(七)基金的投资方向
本基金的投资方向:主要投资于标的指数成份股,备选成份股。为了更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
(八)基金的投资策略
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组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,但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

1. 投资决策
有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。
2. 投资管理体制
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制,投资决策委员会负责决定有关调整重大调整的应对对策,其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。
3. 投资程序
研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的外部。① 研究:金融工程小组依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。② 投资决策:投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资组合的日常决策。③ 组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理以完全复制指数的成份股权权重法构建组合,在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。④ 交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。⑤ 投资绩效评估:金融工程小组定期或不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告,绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合误差的来源及投资组合成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。⑥ 组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数的变动。
基金管理人将在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

如果标的业绩比较基准更为标的指数,本基金标的指数为上证50指数。
如果上证50指数所变更或停止上证50指数的编制及发布,或上证50指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致上证50指数不再继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。
十、基金的风险收益特征
本基金属股票基金,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。
十一、基金投资组合报告
基金管理人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。
于2008年10月17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。
本报告投资组合报告所载数据截至2008年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
1. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 889,116,468.35 | 4.22 |
| 6 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------|-------------------|--------------|
| A | 农林、牧、业 | - | - |
| B | 采掘业 | 2,771,632,612.86 | 13.16 |
| C | 制造业 | 2,909,220,846.79 | 13.89 |
| CD | 食品、饮料 | 818,450,537.64 | 3.82 |
| C1 | 纺织服装、鞋帽 | 218,335,524.88 | 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 | - | - |
| C9 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气、水和生产供应业 | 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 | 批发和零售业 | 196,472,256.00 | 0.93 |
| I | 金融业 | 9,367,497,214.01 | 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 | 95.41 |

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 | 1,982,449,246.96 | 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 | 713,026,545.57 | 3.47 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 5,406,580 | 713,073,836.20 | 3.39 |
| 9 | 600050 | 中国联通 | 129,460,579 | 708,198,597.13 | 3.36 |
| 10 | 600000 | 可口可乐 | 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 | 国债债券 | - | - |
| 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 | 其他 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 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序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(债) | 282,470 | 22,897,018.20 | 0.11 |
| 2 | 126012 | 08上海债 | 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序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。
8. 投资报告报告期内附注

① 报告期内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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
② 本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,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。投资者有风险,投资者在做出投资决策前应当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据。

| 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2004年12月31日 | -0.10% | 0.07% | | | | |