上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

银华基金管理有限公司

二〇一二年九月十九日

一、重要声明与提示

上证50等权重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，银华基金管理有限公司（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。本基金托管人中国建设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，请投资者详细查阅刊登于2012年7月19日《证券时报》和银华基金管理有限公司网站（www.yhfund.com.cn）上的《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

(一)基金二级市场交易简称：50等权。

(二)二级市场交易代码：510430。

(三)基金申购、赎回简称：50E申赎。

(四)申购、赎回代码：510431。

(五)2012年9月17日基金份额总额：1,179,924,510.00份。

(六)2012年9月17日基金份额净值：1.000元。

(七)本次上市交易份额：1,179,924,510.00份。

(八)上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

(九)上市交易日期：2012年9月24日。

(十)基金管理人：银华基金管理有限公司。

(十一)基金托管人：中国建设银行股份有限公司。

(十二)上市推荐人：无。

(十三)申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司等16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：2012年6月8日中国证监会证监许可[2012]783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2012年7月23日起至2012年8月17日止通过销售机构公开进行发售。本基金的发售方式有三种---网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。其中，网下现金认购期间为2012年7月23日起至2012年8月17日，网下股票认购期间为2012年7月23日至2012年8月17日，网上现金认购期间为2012年8月15日至2012年8月17日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金发售20个工作日，网上现金发售3个工作日，通过发售代理机构进行网下股票认购20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股票认购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。

(2)代销机构

本基金的网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为：中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、财通证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中航证券有限公司、国元证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、江海证券有限公司、上海证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、华龙证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、日信证券有限责任公司（只参与网下现金发售业务）、第一创业证券股份有限公司。

本基金的网上现金发售通过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办理。

(二)基金合同生效

上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金自2012年7月23日起向全社会公开募集，于2012年8月17日募集工作顺利结束。经安永华明会计师事务所验资，截至二零一二年八月二十三日止，上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金已收到首次募集扣除认购费后的净认购金额为人民币1,135,179,000.00元，折合1,135,179,000.00份基金份额；网下现金直销方式认购款项在募集期间产生的利息为人民币56,116.00元，折合56,116.00份基金份额；由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司划转至上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金证券账户的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币44,689,394.00元，折合44,689,394.00份基金份额。上述合计折算成基金份额为1,179,924,510.00份。截至2012年8月23日止，首次募集扣除认购费后的实收基金现金部分为人民币1,135,235,116.00元已全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的本基金托管专户，募集的实收基金股票部分由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司划转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3,752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（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额共计1,179,924,510.00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。银华基金管理有限公司（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。本基金基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

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50等权重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2012年8月23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基字[2012]62号。

2、上市交易日期：2012年9月24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：50等权。

5、二级市场交易代码：510430。

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：50E申赎。

7、申购、赎回代码：510431。

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安信证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司等16家证券公司。

8、本次上市交易份额：1,179,924,510.00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2012年9月17日，本基金份额持有人户数为3,752户，平均每户持有的基金份额为314,479份（小数位以四舍五入保留到整数位）。

(二)持有人结构

截至2012年9月17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917,294,221.00份，占基金总份额的77.74%；个人投资者持有的基金份额为262,630,289.00份，占基金总份额的22.26%。

(三)前十名基金份额持有人的情况：

截至2012年9月17日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

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	信诚人寿保险有限公司	50,010,000.00	4.24
2	徐金霞	50,000,000.00	4.24
3	宏源证券股份有限公司	50,000,000.00	4.24
4	华泰证券股份有限公司	41,004,920.00	3.48
5	中信证券股份有限公司	40,000,000.00	3.39
6	海通创新证券投资有限公司	40,000,000.00	3.39
7	招商证券股份有限公司	40,000,000.00	3.39
8	长城证券有限责任公司	40,000,000.00	3.39
9	中国银河证券股份有限公司	36,000,000.00	3.05
10	中原-建行-中原证券炎黄一号精选基金集合资产管理计划	30,004,200.00	2.54

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基本信息

名称：银华基金管理有限公司

法定代表人：王珠林

总经理：王立新

设立日期：2001年5月28日

注册资本：2亿元人民币

注册地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2001]7号

工商登记注册的法人营业执照文号：440301103790705

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

股东及其出资比例：

出资单位	出资比例
西南证券股份有限公司	49%
第一创业证券股份有限公司	29%
东北证券股份有限公司	21%
山西海鑫实业股份有限公司	1%
合计	100%

联系人：刘晓雅

电话：010-85186558

传真：010-58163027

2、经营概况

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7号文）设立的全国性资产管理公司，注册资本为2亿元人民币。

截至2012年6月30日，基金管理人共管理24只基金，公募基金管理资产规模约730.83亿元。本基金管理人管理的24只证券投资基金如下：银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金（LOF）、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）、银华信用债券型证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金。

此外，本基金管理人于2012年7月9日至2012年8月3日发售了银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF），银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金合同已于2012年8月9日生效，实际募集规模为19.45亿元；本基金管理人于2012年7月23日至2012年8月24日发售了银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金，银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同已于2012年8月29日生效，实际募集规模为2.86亿元。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“风险控制委员会”和“薪酬与提名委员会”2个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由3位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理部、量化投资部、研究部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、境外投资部、特定资产管理部、交易管理部、固定收益部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、总经理（董事会）办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部等18个职能部门，并设有北京分公司。此外，公司还设有A股基金投资决策委员会、境外投资决策委员会、特定资产投资决策委员会3个投资决策委员会，分别负责指导基金及其他投资组合的运作，确定基本的投资策略。

各部门主要职能如下：

投资管理部：根据A股基金投资决策委员会制定的原则进行投资。

量化投资部：基金的投资管理（包括指数基金、ETF及主动量化基金的管理）、数量化投资策略和模型研究与开发、量化产品的设计和创新、为其他部门提供金融工程支持。

研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。

市场营销部：负责营销策划、客户服务、市场推广、基金销售、销售渠道管理等工作。

高端客户部：特定客户资产管理业务（包括特定多个客户资产管理业务）产品营销、公募基金的高端客户直销、公司大客户服务、协助公司新业务的策划及营销等工作。

国际合作与产品开发部：负责开展对外合作及新产品的开发工作。

境外投资部：负责公司QDII产品的投资管理，并协助QDII产品的设计、发行等工作。

特定资产管理部：负责特定客户资产管理业务，包括特定多个客户资产管理业务；协助组织特定客户资产管理业务的产品设计和市场营销工作；企业年金基金投资管理；理财产品投资顾问；社保基金产品投资管理；QFII投资顾问。

交易管理部：负责公司所有产品的交易管理工作。

固定收益部：负责固定收益产品的投资、研究。

养老金业务部：负责企业年金业务的市场开发、客户维护和产品推广；负责全国社保基金和地方社保基金等养老金业务的市场开发、客户维护和产品推广。

运作保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、估值。

信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。

总经理（董事会）办公室：负责公司董事会相关工作，负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责公司人力资源管理工作。

行政财务部：负责公司财务管理、会计核算，行政、后勤等相关工作。

深圳管理部：负责公司财务管理、会计核算、税务报送，与主管机关及相关单位的联络沟通，以及其他行政工作等。

监察稽核部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务。

北京分公司：负责所辖区域内的行政管理。

信息披露负责人及咨询电话：凌宇翔；010-58163096。

截至2012年8月20日，公司共有员工278人，其中139人具有硕士以上学历，11人具有博士以上学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。

3、本基金基金经理

周大鹏先生，硕士学位；毕业于中国人民大学；2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职。自2011年9月26日起担任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2012年8月23日起兼任本基金基金经理，自2012年8月29日起兼任本基金之联接基金基金经理。

(二)基金托管人情况

1.基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹 东

联系电话：(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

(三)上市推荐人

无

(四)一级交易商

1、安信证券股份有限公司

注册地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元		
法定代表人	牛冠兴		
客服电话	400-800-1001	网址	www.essence.com.cn

2、长城证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华		
客服电话	0755-33680000；400-6666-888	网址	www.cgws.com

3、第一创业证券股份有限公司

注册地址	深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层		
法定代表人	刘学民		
客服电话	400-888-1888	网址	www.fcsc.com

4、东北证券股份有限公司

注册地址	长春市自由大路1138号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
客服电话	400-600-0686；0431-85096733	网址	www.nesc.cn

5、广发证券股份有限公司

注册地址	广州市天河北路183-187号大都会广场43楼		
法定代表人	孙树明	联系人	黄岚
客服电话	95575或致电各地营业网点	网址	http://www.gf.com.cn

6、国金证券股份有限公司

注册地址	成都市青羊区东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆、张耘钒
客服电话	4006-600109	网址	www.gjzq.com.cn

7、海通证券股份有限公司

注册地址	上海市淮海中路98号		
法定代表人	王开国	联系人	李笑鸣
客服电话	95553；400-888-8001	网址	www.htsec.com

8、宏源证券股份有限公司

注册地址	新疆乌鲁木齐市文艺路233号		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
客服电话	400-800-0562	网址	www.hysec.com

9、华福证券有限责任公司

注册地址	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
法定代表人	黄金琳		
客服电话	96326（福建省外请先拨0591）	网址	www.hfzq.com.cn

10、华泰证券股份有限公司

注册地址	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		
客服电话	95597	网址	www.htsc.com.cn

11、平安证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼		
法定代表人	杨宇翔		
客服电话	95511-8	网址	http://www.pingan.com

12、西南证券股份有限公司

注册地址	重庆市江北区桥北苑8号		
法定代表人	余维佳		
客服电话	400-809-6096	网址	www.swsc.com.cn

13、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	联系人	林生迎
客服电话	400-8888-111；95565	网址	www.newone.com.cn

14、中国银河证券股份有限公司

注册地址	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	陈有安	联系人	田薇
客服电话	400-888-8888	网址	www.chinastock.com.cn

15、中信证券股份有限公司

注册地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
客服电话	95558	网址	www.citics.com

16、中原证券股份有限公司

注册地址	郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	菅明军	联系人	程月艳、耿铭
客服电话	967218；400-813-9666	网址	www.ccnew.com

(五)基金验资机构

名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）		
办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（即东3办公楼）16层		
执行事务人	吴港平	联系人	王珊珊
电话	010-58153280；010-58152145	传真	010-85188298
经办注册会计师	李慧民、王珊珊		

注：安永华明会计师事务所进行了本土化转制，即从原有的中外合作会计师事务所转制成为特殊普通合伙企业，名称为：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），其在为本基金验资时仍未转制，故验资报告所列名称为“安永华明会计师事务所”。

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(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2012年9月17日的资产负债表（未经审计）如下：

资 产	本报告期末 2012年9月17日
资 产：	
银行存款	118,476,728.97
结算备付金	17,608,695.65
存出保证金	-
交易性金融资产	43,447,515.00
其中：股票投资	43,447,515.00
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	1,000,533,628.06
应收利息	309,663.81
应收股利	21,510.00
应收申购款	-
其他资产	124,080.84
资产总计	1,180,521,822.33
负债和所有者权益	本报告期末 2012年9月17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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	274,086.59
应付托管费	54,817.32
应付销售服务费	-
应付交易费用	424.91
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	50,973.07
负债合计	380,301.89
所有者权益：	-
实收基金	1,179,924,510.00
未分配利润	217,010.44
所有者权益合计	1,180,141,520.44
负债和所有者权益总计	1,180,521,822.33

注：截至2012年9月17日，基金份额净值1.000元，基金份额总额1,179,924,510.00份。

八、基金投资组合

(一)基金资产组合情况

截至2012年9月17日，本基金的投资组合情况如下：

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	43,447,515.00	3.68
	其中：股票	43,447,515.00	3.68
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	136,085,424.62	11.53
6	其他各项资产	1,000,988,882.71	84.79
7	合计	1,180,521,822.33	100.00

(二)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、渔业	259,545.00	0.02
B	采掘业	9,070,705.00	0.77
C	制造业	8,827,024.00	0.75
C0	食品、饮料	416,759.00	0.04
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	4,996,017.00	0.42
C7	机械、设备、仪表	3,414,248.00	0.29
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	980,343.00	0.08
E	建筑业	2,507,553.00	0.21
F	交通运输、仓储业	852,600.00	0.07
G	信息技术业	2,209,305.00	0.19
H	批发和零售贸易	261,018.00	0.02
I	金融、保险业	18,361,174.00	1.56
J	房地产业	118,248.00	0.01
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	43,447,515.00	3.68

(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600030	中信证券	505,400	5,508,860.00	0.47
2	600000	浦发银行	383,700	2,843,217.00	0.24
3	600050	中国联通	595,500	2,209,305.00	0.19
4	601857	中国石油	227,800	2,025,142.00	0.17
5	600036	招商银行	189,400	1,918,622.00	0.16
6	601088	中国神华	69,700	1,560,583.00	0.13
7	600585	海螺水泥	97,300	1,460,473.00	0.12
8	600019	宝钢股份	312,300	1,445,949.00	0.12
9	601398	工商银行	383,100	1,436,625.00	0.12
10	600028	中国石化	239,000	1,431,610.00	0.12

(四)按券种分类的债券投资组合

截至2012年9月17日，本基金未持有债券投资。

(五)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

截至2012年9月17日，本基金未持有债券投资。

(六)投资组合报告附注

1、自基金合同生效日至2012年9月17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、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,000,533,628.06
3	应收股利	21,510.00
4	应收利息	309,663.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	124,080.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,000,988,882.71

4、权证投资情况

截至2012年9月17日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2012年9月17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2012年9月17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2012年9月17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

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、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等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

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，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

(一)中国证监会核准上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

(二)《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

(三)《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(四)上海市通力律师事务所关于申请募集上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金及银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金的法律意见；

(五)基金管理人业务资格批件和营业执照；

(六)基金托管人业务资格批件和营业执照。

风险提示：本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将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

银华基金管理有限公司
2012年9月19日

附件：上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金管理人

名称：银华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦19层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

邮政编码：100738

法定代表人：王珠林

成立时间：2001年5月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]7号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

(二)基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

(三)基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

(四)基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3.销售基金份额；

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9.担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构，办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用，更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10.选择、更换基金销售机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督、检查和处理；

11.选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13.依法召集基金份额持有人大会；

14.依法募集基金；

15.依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

16.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

17.以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

18.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(五)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2.办理基金备案手续；

3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7.依法接受基金托管人的监督；

8.计算并公告基金资产净值、基金份额净值，确定基金份额申购赎回清单；

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10.按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购的份额或赎回的股票、现金替代金额及现金差额；

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12.编制季度、半年度和年度基金报告；

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

19.组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24.执行生效的基金份额持有人大会决议；

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27.确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

28.当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

29.建立并保存基金份额持有人名册；

30.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(六)基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2.监督基金管理人对本基金的投资运作；

3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6.依法召集基金份额持有人大会；

7.按规定取得基金份额持有人名册资料；

（下转D11版）

上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告

公告送出日期：2012年9月19日

1公告基本信息

基金名称	上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	银华上证50等权ETF
场内基金简称	50等权
基金主代码	510430
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年8月23日
基金管理人名称	银华基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《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》等法律法规以及《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2012年9月24日
赎回起始日	2012年9月24日

2 日常申购、赎回业务的办理时间

上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）申购和赎回的开放日为上海证券交易所交易日，开放时间为开放日的上午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》规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若上海证券交易所交易时间变更或出现其他特殊情况，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《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

3 日常申购业务

3.1 申购份额限制

投资人申购的基金份额需按最小申购赎回单位或其整数倍进行申报。

本基金最小申购单位为100万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前依照有关规定在指定媒体予以公告。

3.2 申购费率

投资者在申购基金份额时，申购代理券商可按照不超过申购份额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。

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资人赎回的基金份额需按最小申购赎回单位或其整数倍进行申报。

本基金最小赎回单位为100万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前依照有关规定在指定媒体予以公告。

4.2 赎回费率

投资者在赎回基金份额时，赎回代理券商可按照不超过赎回份额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。

5 基金销售机构

5.1场内销售机构

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

基金管理人可根据情况变更或增减本基金申购赎回代理券商，并予以公告。在相关条件许可的前提下，基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构，并予以公告。

目前，本基金申购赎回代理券商的名单如下：安信证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司。

若上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购赎回的，本基金管理人将另行公告。

6 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

自2012年9月24日起，本基金管理人将在每个开放日，通过中国证监会指定的信息披露媒体及本公司网站进行开放日基金份额净值及基金份额累计净值披露，敬请投资者留意。

7 其他需要提示的事项

(一)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，即申购和赎回均以份额申请；

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；

5.基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，或依据上海证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整上述规则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

(二)申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

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。

投资人在提交申购申请时，须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金；投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

2.申购和赎回申请的确认

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，则申购申请失败而不予成交。如投资人持有的符合要求的可用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，则赎回申请失败而不予成交。

投资人可在申请当日及时通过其办理申购、赎回的销售网点或以销售网点规定的其他方式查询有关申请的确认情况。投资人应及时查询有关申请的确认情况。

3.申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

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，并将结果发送给申购赎回代理券商和基金托管人。由基金管理人和申购赎回代理券商在T+2日办理现金差额的交收。如果基金管理人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，本基金管理人将按照相关法律法规要求在指定媒体公告。

(三)申购、赎回的对价及费用

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.申购费用由申购基金份额的投资人承担，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。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不超过申购或赎回份额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。

(四)本公告仅对本基金开放日常申购、赎回业务事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请认真阅读2012年7月19日刊登在《证券时报》上的《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，亦可登陆本公司网站（www.yhfund.com.cn）查询或者拨打本公司的客户服务电话（400 678 3333）垂询相关事宜。

(五)有关本基金上市交易事宜请参见本公司于2012年9月19日披露的《上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

银华基金管理有限公司
2012年9月19日