上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年第1号）

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

一、重要提示

投资有风险,投资人认购或申购、基金时应认真阅读招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现;

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、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（更新）摘要所载内容截止日为2014年2月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日,所披露的投资组合为2013年第4季度的数据（财务数据未经审计）。

二、基金管理人概况和主要人员情况

（一）基金管理人概况

名称	银华基金管理有限公司		
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		
法定代表人	王珠林	设立日期	2001年5月28日
批准设立机关	中国证监会	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	2亿元人民币
存续期间	持续经营	联系人	刘晓雅
电话	010-85186558	传真	010-58163027

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。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股权结构为西南证券股份有限公司（出资比例49%）、第一创业证券股份有限公司（出资比例29%）、东北证券股份有限公司（出资比例21%）及山西海鑫实业股份有限公司（出资比例1%）。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。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4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、研究部、固定收益部、量化投资部、境外投资部、特定资产管理部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、交易管理部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、监察稽核部、公司办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、战略发展部等19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,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。

（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

王珠林先生:董事长,经济学博士。曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师;甘肃省证券公司发行部经理;中国蓝星化学工业总公司处长,蓝星清洗股份有限公司董事副总经理、董事会秘书,蓝星化工新材料股份公司筹备组组长;西南证券有限责任公司副总裁;中国银河证券股份有限公司副总裁;西南证券股份有限公司董事、总裁。此外,还曾先后担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、中国证券业协会投资银行业委员会委员、重庆市证券期货业协会会长、盐田港集团外部董事、国投电力控股股份有限公司独立董事、上海城投控股股份有限公司独立董事等职务。现任银华基金管理有限公司董事长、银华财富资本管理（北京）有限公司董事、西南证券股份有限公司董事、财政部资产评估准则委员会委员、北京大学公共经济管理研究中心研究员。

钱龙海先生:董事,经济学硕士。曾任北京京放投资管理顾问公司总经理助理;佛山证券有限责任公司副总经理。现任第一创业证券股份有限公司党委书记、董事、总裁,兼任第一创业投资管理有限公司董事长、第一创业摩根大通证券有限责任公司董事。还担任中国证券业协会第五届理事会理事,中国证券业协会投资银行业务委员会第五届副主任委员,深圳市证券业协会副会长。

矫正中先生:董事,中共党员,经济学硕士,中国注册会计师,中国注册会计师协会资深会员,中国证券业协会咨询委员会委员曾任吉林省财政厅工交企业财务处副处长（正处长级）;吉林省长岭县副县长;吉林省财政厅文教行政财务处处长;吉林省财政厅副厅长、厅长兼吉林省地税局局长;吉林省政府秘书长兼办公厅主任、副省长,兼吉林市代市长、书记。现任东北证券股份有限公司董事长、党委书记。

周晓冬先生:董事,金融MBA、国际商务师。曾任中国南光进出口总公司广东分公司总经理;上海海博鑫惠国际贸易有限公司董事、常务副总经理。现任海鑫钢铁集团有限公司董事长助理,兼任北京惠宇投资有限公司总经理。

王立新先生,董事总经理,经济学博士。历任中国工商银行总行科员;南方证券股份有限公司基金部副处长;南方基金管理有限公司研究开发部、市场拓展部总监;银华基金管理有限公司总经理助理、公司副总经理、代总经理、代董事长。现任银华基金管理有限公司总经理、银华财富资本管理（北京）有限公司董事长。

郑秉文先生,独立董事,经济学博士后,教授,博士生导师。曾任中国社会科学院培训中心主任,院长助理,副院长。现任中国社会科学院拉美研究所所长。

王恬先生,独立董事,经济学博士,高级经济师。曾任中国银行深圳分行行长,深圳天骥基金董事,中国国际财务有限公司（深圳）董事长,首长四方（集团）有限公司执行董事。现任南方国际租赁有限公司董事、总裁。

陆志芳先生,独立董事,法律硕士,律师。曾任对外经济贸易大学法律系副主任,北京仲裁委员会仲裁员,北京市律师协会国际业务委员会副主任委员,海问律师事务所律师、合伙人。现任浩天信和律师事务所律师、合伙人。

高歌女士:独立董事,法律硕士。曾任高阳科技控股有限公司助理总裁;普天系统集成公司副总经理;新华锦集团副总裁、副董事长。现任中国民主建国会青岛市委员会副主委、全国青联委员、中国青年企业家协会常务理事、新华锦集团副董事长。

周兰女士,监事会主席,中国社会科学院货币银行学专业研究生毕业。曾任北京建材研究院财务科长;北京京放经济发展公司计财部经理;佛山证券有限责任公司监事长及风险控制委员会委员。现任第一创业证券股份有限公司监事长及风险控制委员会委员。

王致贤先生,监事,硕士。曾任重庆市地方税务局办公室秘书、重庆市政府办公厅一处秘书、重庆市国有资产监督管理委员会办公室秘书、重庆市国有资产监督管理委员会企业管理三处副处长。现任西南证券股份有限公司办公室（党委办公室）主任、证券事务代表。

杜永军先生:监事,大专学历。曾任五洲大酒店财务部收款主管;北京赛特饭店财务部收款主管、收款主任、经理助理、副经理、经理。现任银华基金管理有限公司行政财务部财务主管。

龚飒女士:监事,硕士学历。曾任湘财证券有限责任公司分支机构财务负责人;泰达荷银基金管理有限公司基金事业部副总经理;湘财证券有限责任公司稽核经理;交银施罗德基金管理有限公司运营部总经理。现任银华基金管理有限公司运作保障部总监。

封树标先生:副总经理,工学硕士。曾任国信证券天津营业部经理、平安证券综合研究所副所长、平安证券资产管理事业部总经理、平安大华基金管理有限责任公司总经理、广发基金机构投资部总经理等职。2011年3月加盟银华基金管理有限公司,曾担任公司总经理助理职务,现任银华基金管理有限公司副总经理,同时兼任公司特定资产管理业务投资经理。

周毅先生:副总经理,硕士学位。曾任美国普华永道金融服务部部门经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009年9月加盟银华基金管理有限公司,曾担任银华全球核心优选证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）及银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理和公司总经理助理职务。现任银华基金管理有限公司副总经理,兼任公司量化投资总监、量化投资部总监以及境外投资部总监、银华财富资本管理（北京）有限公司董事,并同时兼任银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理职务。

凌宇翔先生,督察长,工商管理硕士。曾任机械工业部主任科员;重庆国际信托投资公司研发中心部门经理;西南证券有限责任公司基金管理部总经理。现任银华基金管理有限公司督察长。

2.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指数分级证券投资基金基金经理,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经理,自2013年5月22日起兼任银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金经理。

3.A股基金投资决策委员会成员

委员会主席:王立新

委员:封树标、周毅、王华、姜永康、郭建兴

王立新先生:详见主要人员情况。

封树标先生:详见主要人员情况。

周毅先生:详见主要人员情况。

王华先生,硕士学位,中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于西南证券有限责任公司。2000年10月加盟银华基金管理有限公司（筹）,先后在研究策划部、基金经理部工作,曾任银华保本增值证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理。现任银华中小盘精选股票型证券投资基金基金经理、公司总经理助理、投资管理部总监及A股基金投资总监。

姜永康先生,硕士学位。2001年至2005年曾就职于中国平安保险（集团）股份有限公司,历任研究员、组合经理等职。2005年9月加盟银华基金管理有限公司,曾任养老金管理部投资经理职务。曾担任银华货币市场证券投资基金基金经理。现任公司总经理助理、固定收益部总监、固定收益基金投资总监以及银华财富资本管理（北京）有限公司董事,并同时担任银华保本增值证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金以及银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理。

郭建兴先生,学士学位。曾在山西证券股份有限公司（原山西证券有限责任公司）从事证券自营业务工作,历任交易主管、总经理助理兼监理等职;并曾就职于华商基金管理有限公司投资管理部,曾担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司,现任银华优质增长股票型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人概况

（一）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:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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:田青
联系电话:(010) 6759 5096

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2013 年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,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、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14 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27家,拥有建信基金、建信租赁、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。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年"世界银行1000强排名"中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,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,投资托管业务部副总经理,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,投资托管业务部副总经理,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。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）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2013年6月30日,中国建设银行已托管311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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行",在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国"最佳资产托管银行"奖,和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最佳基金托管银行"奖。

四、相关服务机构

(一) 申购、赎回代办证券公司

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.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

4.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	刘一宏
客服电话	4006-600109	网址	www.gjzq.com.cn

5.海通证券股份有限公司

注册地址	上海市广东路689号		
法定代表人	王开国	联系人	李笑鸣
客服电话	95553或拨打各城市营业网点咨询电话	网址	www.htsec.com

6.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

7.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

8.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

9.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

10.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

11.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

12.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	安岩岩
客服电话	400 -600 -0686 ;0431 -85096733	网址	www.nesc.cn

13.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

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
客服电话	967218 ;400-813-9666	网址	www.ccnew.com

(二)注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所及办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	崔巍
电话	(021)58872625	传真	(021)68870311

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所及办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	021-31358666	传真	021-31358600
经办律师	吕红、黎明		

(四)会计师事务所及经办注册会计师

名称	安永华明会计师事务所		
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		
法定代表人	葛明	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		

五、基金的名称

上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金

六、基金的类型

股票型证券投资基金

七、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的最小化,努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

八、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、一级市场股票（包括首次公开发行或增发）、债券资产（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、回购、中期票据等）、银行存款（包括银行定期存款、通知存款或大额存单等）、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并且无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数,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。

在少数特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）下,基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充,构建本基金实际的投资组合,以追求尽可能贴近标的指数的表现,有效控制跟踪误差。

为提高投资效率,使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,更好地实现本基金的投资目标,在法律法规许可时,本基金可投资于经中国证监会允许的期权、期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融衍生工具。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

(二)投资管理体制和程序

(1)决策依据

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A股基金投资决策委员会领导下的基金经理负责制。A股基金投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理负责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,避免重大风险的发生。

1)研究:量化投资部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、跟踪误差及其归因分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

2)投资决策:A股基金投资决策委员会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A股基金投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

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成份股及其权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和跟踪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:量化投资部定期和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、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否,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,采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人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。

建仓期结束后,在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

若本基金投资股指期货,基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

十、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的,若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数及业绩比较基准召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒体公告;若标的指数变更对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),基金管理人在与基金托管人协商一致后,有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

十二、投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,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。

本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日（财务数据未经审计）。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元）	占基金总资产的比例 (%）
1	权益投资	59,427,206.07	98.00
	其中:股票	59,427,206.07	98.00
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	1,209,318.29	1.99
6	其他资产	5,546.13	0.01
7	合计	60,642,070.49	100.00

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、渔业	–	–
B	采矿业	8,061,245.59	13.34
C	制造业	16,137,546.53	26.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	2,306,840.18	3.82
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	2,457,167.67	4.07
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,675,494.23	6.08
J	金融业	23,137,184.32	38.29
K	房地产业	2,511,043.93	4.16
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	1,140,683.62	1.89
	合计	59,427,206.07	98.34

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	601901	方正证券	263,230	1,555,689.30	2.57
2	600383	金地集团	200,801	1,341,350.68	2.22
3	600406	国电南瑞	87,955	1,307,890.85	2.16
4	600015	华夏银行	151,653	1,299,666.21	2.15
5	600010	包钢股份	296,051	1,275,979.81	2.11
6	600999	招商证券	99,839	1,265,958.52	2.09
7	600036	招商银行	115,496	1,257,751.44	2.08
8	600018	上港集团	238,000	1,256,640.00	2.08
9	600887	伊利股份	31,928	1,247,746.24	2.06
10	600030	中信证券	96,338	1,228,309.50	2.03

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有权证。

8. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

10.投资组合报告附注

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查,或在报告编制 日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元）
1	存出保证金	4,892.98
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	653.15
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,546.13

10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 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	601901	方正证券	1,555,689.30	2.57	重大资产重组

10.6 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。

十三、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。

本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012.8.23 (基金合同生效日)-2012.12.31	13.70%	1.09%	11.91%	1.35%	1.79%	-0.26%
2013.1.1-2013.12.31	-16.89%	1.43%	-18.60%	1.44%	1.71%	-0.01%
自基金合同生效日 (2012年8月23日)起至2013.12.31	-5.50%	1.35%	-8.90%	1.42%	3.40%	-0.07%

十四、费用概览

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金合同生效后的标的指数许可使用费;
4.基金财产拨划支付的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费;
8.基金的证券交易费用;
9.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
10.基金上市初费及年费;
11.基金收益分配中发生的费用;
12.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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×年管理费率÷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支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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×年托管费率÷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,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支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3.标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算,逐日累计。

计算方法如下:

H=E×0.03%/当年天数

H为每日应付的标的指数许可使用费,E为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000）。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法,应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

4.除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)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关的事项发生的费用等不列入基金费用。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。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照相关法律法规规定在指定媒体上刊登公告。

调高基金管理费率或基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

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》及其它有关法律法规的要求,对本基金原更新招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新内容如下:

1、在"重要提示"部分,更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
2、在"三、基金管理人" 部分,对基金管理人的概况和主要人员情况进行了更新。
3、在"五、相关服务机构"部分,更新了部分申购赎回代办证券公司的信息。
4、在"十一、基金的投资"部分,更新了最近一期的投资组合报告。
5、在"十二、基金的业绩" 部分,说明了基金合同生效至2013年12月31日的基金投资业绩。
6、在"二十四、其他应披露的事项"部分,列出了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的重大事项。
7、对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司
2014年4月9日

关于开放嘉实活期宝货币市场基金与嘉实活钱包货币市场基金在直销柜台办理转换业务的公告

公告送出日期:2014年4月9日

为更好满足广大投资者的理财需求,根据《嘉实活期宝货币市场基金基金合同》和《嘉实活钱包货币市场基金基金合同》的有关规定,嘉实基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2014年4月10日起开始办理旗下嘉实活期宝货币市场基金(基金代码:000464)与嘉实活钱包货币市场基金(基金代码:000581)在直销柜台的基金转换业务。现将该业务有关事项公告如下:

1、基金转换业务的办理时间

投资者在开放日办理基金的转换业务,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,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的规定公告暂停转换时除外。

2、基金转换费用

嘉实活期宝货币市场基金与嘉实活钱包货币市场基金之间互转时,不收取转换费用,计算公式如下:

净转入金额=B×C

转入份额=净转入金额/E

其中,B 为申请转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值;

以下为举例说明:

假定投资者在 T 日持有2,000份嘉实活期宝货币市场基金,其在T日转出1,000 份嘉实活期宝货币市场基金,转入嘉实活钱包货币市场基金,则净转入金额和转入份额计算如下:

净转入金额=1000@

转入份额=1000/1=1000份

3、其他与基金转换相关的事项

(1)基金转换的时间:投资者需在嘉实活期宝货币市场基金和嘉实活钱包货币市场基金均为开放日的当日,方可办理基金转换业务。

(2)基金转换的原则:

①采用份额转换原则,即基金转换以份额申请;

②基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算;

③本次公告的转换业务仅适用于在直销柜台上办理的嘉实活期宝货币市场基金与嘉实活钱包货币市场基金之间的转换业务;

④基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则,但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

(3)基金转换的程序

①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售机构规定的手续,在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时,帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日(T日),在正常情况下,注册登记机构不晚于T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

(4)基金转换的数额限制

基金转换时,由嘉实活期宝货币市场基金转换到嘉实活钱包货币市场基金时,最低转出份额为1份基金份额;由嘉实活钱包货币市场基金转换到嘉实活期宝货币市场基金时,最低转出份额为1份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

(5)基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

4、基金销售机构

本次公告开放的基金转换业务仅适用于本公司的直销柜台。具体销售机构如下:

嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	赵虹		

5、其他需要提示的事项

(1)本公告仅对嘉实活期宝货币市场基金与嘉实活钱包货币市场基金开放直销柜台转换业务有关事项予以说明。投资者欲了解上述基金详细情况,请阅读上述基金的相关法律文件。

(2)投资者可登陆本公司网站(www.jsfund.cn)或拨打客户服务电话(400-600-8800)咨询有关事宜。

风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2014年4月9日

证券代码:002111　证券简称:威海广泰　公告编号:2014-029

威海广泰空港设备股份有限公司关于运用部分闲置募集资金购买交通银行"蕴通财富o日增利"理财产品的到期归还公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

威海广泰空港设备股份有限公司(以下简称"公司")于2014年2月24日召开第四届董事会第十九次临时会议,审议通过了《关于使用部分闲置募集资金购买保本型理财产品的议案》,同意在确保不影响募集资金项目建设和募集资金使用的情况下,公司拟使用部分闲置募集资金购买交通银行"蕴通财富o日增利"理财产品,理财期限42天,任一时点持有未到期的理财产品总额不超过人民币2,600万元。内容详见2014年2月25日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《威海广泰空港设备股份有限公司关于运用部分闲置募集资金购买保本型理财产品的公告》(公告编号:2014-010)。

根据董事会的决议,公司于2014年2月24日使用2,600万元闲置募集资金购买交通银行"蕴通财富o日增利"理财产品,理财期限42天,截至2014年4月8日,公司已将上述资金2,600万元及理财收益179,506.85元全部归还并转入公司募集资金专用账户。该理财收益与预期收益不存在重大差异。

公司已将上述募集资金的归还情况通知保荐人及保荐代表人。

特此公告。

威海广泰空港设备股份有限公司
董事会
2014年4月9日

证券代码:002524　证券简称:光正集团　公告编号:2014-019

光正集团股份有限公司重大工程中标公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

近日,光正集团股份有限公司(以下简称"公司")收到中建三局集团有限公司发来的《中标通知书》,通知确定公司与江苏沪宁钢机股份有限公司组成的联合体为《第8.5代TFT-LCD(含氧化物半导体及AMOLED)生产线建设项目-钢结构工程》的中标单位,中标价为人民币128,931,181.66元,工程工期为219天。

一、总承包方及项目基本情况

1、该项目的业主方:深圳市华星光电技术有限公司。

2、该项目的总承包方:中建三局集团有限公司

3、该项目承包方式:钢结构专业分包施工。

4、该项目钢结构工程的计划工期:219天。

5、2013 年度公司未与总承包方及发生类似业务。

6、公司与业主方和总承包方不存在任何关联关系。

二、中标对公司的影响

若公司最终签订合同,将对本年度经营业绩产生积极的影响。由于本项目为联合体中标,工程合同尚未签订,该项目具体由公司承揽的部分以及工程金额尚未最终确定。

三、风险提示

公司尚未与该项目业主方正式签订合同,因此合同条款尚存在不确定性,具体内容待合同签订后另行公告,敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

光正集团股份有限公司董事会
2014年4月8日

股票代码:002083　股票简称:孚日股份　公告编号:临2014-015

孚日集团股份有限公司关于变更定期报告披露时间的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

孚日集团股份有限公司(以下简称"公司")原计划于2014年4月15日披露2013年度报告,根据目前的工作进度,因审计报告出具时间延迟,故本公司申请变更2013年度报告的披露日期,披露的日期申请变更为2014年4月17日。

由此给广大投资者带来的不便,公司深表歉意。

特此公告。

孚日集团股份有限公司
董 事 会
2014年4月8日

证券代码:002640　证券简称:百圆裤业　公告编号:2014-009

山西百圆裤业连锁经营股份有限公司关于筹划重大事项停牌公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

山西百圆裤业连锁经营股份有限公司(以下简称"公司")拟筹划重大事项,该事项存在不确定性。为保护广大投资者的利益,避免股票价格异常波动,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票(股票简称:百圆裤业,股票代码:002640)自2014年4月8日(星期二)开市起停牌,待公司通过指定媒体披露相关公告后复牌,敬请投资者密切关注,并注意投资风险。

特此公告。

山西百圆裤业连锁经营股份有限公司
董事会
二〇一四年四月八日

证券代码:002302　证券简称:西部建设　公告编号:2014- 016

中建西部建设股份有限公司关于公司网址、电子信箱变更的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

从即日起,中建西部建设股份有限公司(以下简称"公司")的公司网址由http://www.west-construction.com 变更为http://cwcg.cscec.com/;公司电子信箱由stock@xbjs.net变更为zjxbjs@cscec.com;董事会秘书电子信箱由lb@xbjs.net变更为linb@cscec.com;证券事务代表电子信箱由wly@xbjs.net变更为wangly-west@cscec.com。

原公司网址及电子信箱将停止使用,公司的其他联系方式保持不变,敬请广大投资者留意。

特此公告。

中建西部建设股份有限公司
董 事 会
2014年4月9日

证券代码:000609　证券简称:绵世股份　公告编号:2014-8

北京绵世投资集团股份有限公司关于推迟年报披露时间的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京绵世投资集团股份有限公司(以下简称"公司"、"绵世股份")原定于 2014年4月12日披露2013年年度报告。因公司审计和年报编制工作量大,无法在原预约时间披露年报。经公司申请2013年年度报告披露时间推迟至2014年4月25日。

公司董事会对由此给投资者带来的不便深表歉意。

特此公告。

北京绵世投资集团股份有限公司
2014年4月8日