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

2014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”）经中国证监会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，是投票基金中风险较低、收益中等的产品。投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，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。

本招募说明书所载内容截止日为2014年12月30日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2014年9月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

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12层
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：杨明辉
联系人：崔雁巍
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元，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	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
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
杨明辉先生：董事长、代总经理、党委书记，中信证券股份有限公司党委委员、硕士，高级经济师。兼任华夏资本管理有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长等。
杨一夫先生：董事，硕士。现任触尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大触尔公司在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。
胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。
徐刚先生：董事，博士，经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人，兼任中信证券（山东）、中信期货、前海股权交易中心、青岛监海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部、曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部、担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。
葛小波先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、计划财务部行政负责人，兼任华夏资本管理有限公司董事。曾任中信证券股份有限公司投资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部（现交易与衍生产品业务部）行政负责人。
朱武祥先生：独立董事，博士，教授，现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建设（香港上市）及华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信三家内地上市公司的独立董事。
贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行董纸上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。
谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任同方环境股份有限公司、北京双杰电气股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司），朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事会理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。曾任清华大学经济管理学院会计学讲师、副教授。
吴志军先生：副总经理，学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。
林亮先生：副总经理、投资决策委员会主席、研究总监、硕士。曾任公司总经理助理等。
张雪岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授，清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。
汤晓东先生：督察长，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。
李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员、中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长、中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。
罗楚良先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东省农村经济开发投资公司总经理（法定代表人）、党委副书记，兼任山东高速投资控股有限公司法定代表人、总经理，山东高速环球融资租赁有限公司法定代表人、执行董事兼总经理，山东高速路桥集团股份有限公司董事。曾任山东省交通厅政策法规处副主任科员、主任科员，山东省交通厅外事外经处副处长，山东基建股份有限公司董事、副总经理，山东高速股份有限公司董事、常务副总经理。
吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。
康西女士：监事，法学和金融学双学士。现任华夏基金管理有限公司纪律检查委员会委员，兼任华夏资本管理有限公司常务副总经理。曾任中国工商银行北京分行法律部、证券监管部门主任科员，华夏基金管理有限公司或都分公司总经理、法律监察部总经理等。
刘文灿先生：监事，工商管理硕士。曾任原北京市二商局干部，中国国际贸易促进委员会干部，华夏基金管理有限公司财务部总经理、办公室主任、稽核总监、人力资源总监、法律监察部总监等。
王芬华女士：监事，经济学学士。现任华夏基金管理有限公司人力资源部总监。曾任北京NTT DATA人力资源部职员，华夏基金管理有限公司人力资源部总经理助理、人力资源部副总经理等。
2、本基金基金经理
方军先生，硕士，1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、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、华夏回报证券投资基金基金经理助理、数量投资部副总经理等，现任数量投资部总监，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）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）。
3、本公司最化投资决策委员会
主任：王路先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官，恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、华夏沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。
成员：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理，华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华夏沪深300指数增强型证券投资基金基金经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
方军先生、华夏基金管理有限公司数量投资部总监、上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
列席人员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司督察长。
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（简称：中国工商银行）
注册地址：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349,018,545.822元
联系电话：010-66105799
联系人：蒋松云
（二）主要人员情况
截至2014年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工207人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
（三）基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，赢得坚实的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最非常、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年12月，中国工商银行共托管证券投资基金407只，自2003年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、美国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的45项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构
1、申购赎回代理券商（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号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：丙敏祺
网址：www.gtja.com
客户服务电话：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：王常青
客户服务电话：400-888-8108
传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc.com.cn
（3）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：周杨
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：95536
（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：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
电话：020-87555888
传真：020-87555417
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
（6）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010-60833722
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com
客户服务电话：95548
（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2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn
客户服务电话：400-888-8888
（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：金芸、李笑鸣
网址：www.htsec.com
客户服务电话：021-962503，400-888-8001或按打各城市营业网点咨询电话
（9）中银万国证券股份有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：杨晓明
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李清怡
网址：www.sywg.com
客户服务电话：95523，400-889-5523
（10）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565955
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn
客户服务电话：95562
（11）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：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
网址：www.95579.com
客户服务电话：95579，400-888-8999
（12）安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：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
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn
客户服务电话：400-800-1001
（13）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人：沈强
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
联系人：李珊
网址：www.bigsun.com.cn
客户服务电话：95548
（14）湘财证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634510-8620
传真：021-68865680
联系人：赵小明
网址：www.xcsc.com
客户服务电话：400-888-1551
（15）国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：蔡咏
电话：0551-62257012
传真：0551-62272100
联系人：倪丽萍
网址：www.gyzq.com.cn
客户服务电话：95578
（16）渤海证券股份有限公司
住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区津水西道8号
法定代表人：王春峰
电话：022-28451709
传真：022-28451892
联系人：胡天彤
网址：www.bhzq.com
客户服务电话：400-651-5988
（17）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：深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人：吴万善
电话：0755-82492193
传真：025-51863323（南京）、0755-82492962（深圳）
联系人：庞晓芸
网址：www.htsc.com.cn
客户服务电话：95597
（18）中信证券（山东）有限责任公司
住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
网址：www.citicsd.com
客户服务电话：95548
（19）东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
办公地址：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：吴永敏
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
网址：www.dwzq.com.cn
客户服务电话：0512-33396288
（20）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
电话：010-63081000
传真：010-63080978
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：400-800-8899
（21）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、23层、25层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层
法定代表人：潘鹰军
电话：021-63325888
传真：021-63326729
联系人：胡月茹
网址：www.dfzq.com.cn
客户服务电话：95503
（22）方正证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市芙蓉区五一路芙蓉广场A座
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
电话：0731-85832503
传真：0731-85832214
联系人：邹军瑞
电话：0755-83709350
传真：0755-83704850
联系人：牛孟宇
网址：www.ghzq.com.cn
客户服务电话：95563
（32）中原证券股份有限公司
住所：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：智坤军
电话：0371-65585287
传真：0371-65585665
联系人：陈利民
网址：www.ccnew.com
客户服务电话：0371-967218，400-813-9666
（33）国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：常喆
电话：010-84183389
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118
（34）东海证券股份有限公司
住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：刘化军
电话：021-20333333
传真：021-50498825
联系人：王一彦
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：95531，400-888-8588
（35）华西证券股份有限公司
住所：四川省成都市陕西街239号
办公地址：四川省成都市陕西街239号
法定代表人：杨炯洋
电话：010-52723273
传真：028-86150040
联系人：李慧灵
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：400-888-8818
（36）宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085201
传真：010-88085195
联系人：李巍
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0562
（37）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889185
联系人：吴阳
网址：www.qlzq.com.cn
客户服务电话：95538
（38）第一创业证券股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
电话：0755-23835754
传真：0755-23838750
联系人：毛诗莉
网址：www.firstcapital.com.cn
客户服务电话：400-888-1888
（39）德邦证券有限责任公司
住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：姚文平
电话：021-68676016-8522
传真：021-68767032
联系人：叶蕾
网址：www.tebon.com.cn
客户服务电话：400-888-8128
（40）中国国际金融有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65058065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166
（41）华鑫证券有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：洪家新
电话：021-64339000-807
传真：021-64333051
联系人：陈敏
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918
（42）中国中投证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
联系人：刘毅
网址：www.china-invs.cn
客户服务电话：400-600-8008，95532
（43）西藏同信证券有限责任公司
住所：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号
法定代表人：贺经胜
电话：021-36533016
传真：021-36533017
联系人：王伟光
网址：www.xzsec.com
客户服务电话：400-881-1177
（44）中国民族证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座6层-9层
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座6层-9层
法定代表人：赵大建
电话：010-59355941
传真：010-66553791
联系人：李微
网址：www.e5618.com
客户服务电话：400-889-5618
（45）华宝证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人：陈林
电话：021-50122128
传真：021-50122398
联系人：徐方亮
网址：www.cnhbstock.com
客户服务电话：400-820-9898
2、银市场交易代理券商
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销售本基金，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：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：陈文祥
联系电话：021-68419095
传真：021-68870311
（三）律师事务所
名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52682888
传真：010-52682999
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（特殊普通合伙）
住所：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（东三办公楼）16层
办公地址：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
执行事务合伙人：吴港平
联系电话：010-58153000
传真：010-85188298
联系人：边卓群
经办注册会计师：边卓群、濮晓洁

四、基金的名称

本基金名称：上证50交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式。

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。
（一）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。
（二）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、调整决策以及每日中购、赎回清单的编制决策。
（三）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：基金经理、研究人员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、误差及其影响因子分析等工作，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权重方法构建组合。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，即时履行一线监控的职责。
5、投资绩效评估：风险管理委员会定期对本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、基金中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。
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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证50指数。
如果上海证券交易所变更或停止上证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指数不宜继续作为标的指数，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根据本基金合同规定，于2014年10月22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。
本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,662,339,100.02	95.93
	其中：股票	17,662,339,100.02	95.93
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	749,404,492.27	4.07
7	其他各项资产	822,545.13	0.00
8	合计	18,412,566,137.42	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	69,809,298.66	0.38
B	采矿业	1,102,484,650.98	6.00
C	制造业	3,689,066,433.88	20.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	996,601.80	0.01
E	建筑业	466,601,798.37	2.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	513,330,714.06	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	536,144,038.14	2.92
J	金融业	10,754,082,211.51	58.52
K	房地产业	529,823,352.62	2.88
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	-	-
	合计	17,662,339,100.02	96.10

（三）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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	34,956,075	1,445,084,140.50	7.86
2	600036	招商银行	121,952,927	1,267,090,911.53	6.89
3	600016	民生银行	201,472,425	1,257,187,932.00	6.84
4	601166	兴业银行	85,613,250	874,967,415.00	4.76
5	600000	浦发银行	82,315,262	802,573,804.50	4.37
6	600837	海通证券	71,914,348	742,156,071.36	4.04
7	600519	贵州茅台	3,362,062	545,091,112.06	2.97
8	601328	交通银行	114,290,019	490,304,181.51	2.67
9	601288	农业银行	189,409,475	471,629,592.75	2.57
10	600887	伊利股份	18,014,423	466,573,555.70	2.54

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
（五）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
本基金本报告期末未持有债券。
（六）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持有资产支持证券。
（七）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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
（八）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持有权证。
（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
2、本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1、本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
3、本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
（十一）投资组合报告附注
1、报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。
2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	436,047.58
2	应收证券清算款	227,947.49
3	应收股利	-
4	应收利息	143,425.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.17
8	其他	-
9	合计	822,545.13

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2004年12月30日至2004年12月31日	-0.10%	0.07%	-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	127.78%	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12月31日	-65.19%	2.92%	-67.23%	3.08%	2.04%	-0.16%
2009年1月1日至2009年12月31日	83.60%	2.03%	84.40%	2.07%	-0.80%	-0.04%
2010年1月1日至2010年12月31日	-21.78%	1.54%	-22.57%	1.56%	0.79%	-0.02%
2011年1月1日至2011年12月31日	-17.24%	1.27%	-18.19%	1.28%	0.95%	-0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	17.00%	1.21%	14.84%	1.21%	2.16%	0.00%
2013年1月1日至2013年12月31日	-12.34%	1.55%	-15.23%	1.57%	2.89%	-0.02%
2014年1月1日至2014年9月30日	5.66%	1.02%	2.85%	1.04%	2.81%	-0.02%

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）基金份额持有人大会费用。
（7）基金合同生效以后与基金相关的会计师费、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×0.5%÷当年天数
H为每日应计