

上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31日

基金管理人:华泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告期截止日期:2014年1月21日

\$1 重要提示

基金管理人和基金托管人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，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金的合同规定，于2014年1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信息，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。投资人认购基金后应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 上证50等权重ETF

交易代码 510430

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2012年8月23日

报告期末基金份额总额 636245.10份

基金类别 主要采用完全复制法跟踪标的指数的上证50等权重指数，即完全复制法，同时将维持与标的指数成份股相同的权重比例，所持有的股票数量不超过基金资产净值的95%。

投资目标 本基金通过投资于上证50等权重指数成份股，追求超越标的指数的长期投资收益。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度绝对值的波动不超过±2%，年度跟踪误差不超过±2%。

投资策略 本基金主要通过投资于上证50等权重指数成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

基金经理和基金托管人 华泰基金管理有限公司 中信银行股份有限公司

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -1,485,007.84

2.本期利润 -2,381,796.69

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0362

4.期末基金份额净值 60,433,087.18

5.期末可供分配基金份额 0.948

注:1.本期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,本期期间费用包括管理费、利息支出、手续费及佣金、交易费、申购费、赎回费、计入费用后实际收益水平以所列示的序号所列数据为准。

2.上述本基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,计人费用后实际收益水平以所列示的序号所列数据为准。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率标准差③ ①-② ②-③

过去三个月 -1.77% 1.00% -3.61% 1.00% -1.06% -0.04%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金净值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定;本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金净资产的90%。

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 任职日期 证券从业年限 说明

周大鹏先生 本基金的基金经理 2012年8月23日 - 4.5年

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.2 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.5 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.7 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.8 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.9 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.10 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.11 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.12 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.13 公平交易专项说明

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.15 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.16 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.17 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.19 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.20 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.21 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.23 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.24 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.25 独立董事履行职责情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.26 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。

4.27 报告期内基金的现金类资产

截至报告期末,本基金的现金类资产为0.945元,本基金报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-3.61%。

报告期内,本基金日跟踪误差控制在0.2%之内,年内跟踪误差控制在2%之内。

4.28 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第一季度,我们对市场持谨慎乐观的态度。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金管理人对报告期内基金运作指标进行分析,并将其与行业平均数进行对比分析,另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和各业务部门、相关岗位是否存在不公平交易、利益输送的情况进行定期报告。

综上所述,本基金管理人在报告期内严格执行了公平交易制度,并执行了公平交易制度的有关规定。