华夏红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接C12版)

7.投资组合报告附注

(1)报告期内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)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)报告期末基金的其他资产构成

单位:元

应收申购款	49,438,836.81
应收利息	28,769,601.02
存出保证金	22,440,738.37
合计	100,649,176.20

(4)报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(元)	占净值比例
125960	锡业转债	2,832,972.44	0.01%

(5)报告期内获得的权证明细

	权证名称	数量(份)	成本总额(元)
获配权证	中远CWB1	69,678	488,793.29
	上港CWB1	180,642	268,937.69
	中兴ZXC1	1,208,777	12,144,850.62

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。

(一)基金业绩

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
2005年6月30日至2005年12月31日	0.50%	0.30%	3.26%	0.77%	-2.76%	-0.47%
2006年1月1日至2006年12月31日	117.83%	1.26%	51.26%	0.88%	66.57%	0.38%
2007年1月1日至2007年12月31日	169.42%	1.96%	101.50%	1.61%	67.92%	0.35%
2008年1月1日至2008年3月31日	-15.41%	1.98%	-11.72%	1.91%	-3.69%	0.07%

(二)基金份额收益分配情况表

单位:元/每份基金

2005年年度	2006年年度	2007年年度	2008年1月至3月
0.833元	-	-	-

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)证券交易费用;

(4)基金份额持有人大会费用;

(5)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用;

(6)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1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷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个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

(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0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷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,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

(3)基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

(4)本条第(一)款第1项中第(3)至第(6)项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定,按费用实际支出金额支付,并列入或摊入当期基金费用。

3、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资产的损失,以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

(二)基金销售费用

1、申购费与赎回费

(1)申购费

①本基金申购费由申购人承担,用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。

②投资者选择交纳前端申购费时,费率按申购金额递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上(含100万元)-500万元以下	1.2%
500万元以上(含500万元)-1000万元以下	0.8%
1000万元以上(含1000万元)	每笔500元

③投资者选择交纳后端申购费时,费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内	1.8%
满1年不满2年	1.5%
满2年不满3年	1.2%
满3年不满4年	1.0%
满4年不满8年	0.5%
满8年以后	0

(2)本基金赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。赎回费率为0.5%。其中,须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产,其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

(1)申购份额的计算

如果投资者选择交纳前端申购费,则申购份额的计算方法如下:

净申购金额＝申购金额/(1＋申购费率)

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

对于申购费用为固定金额的基金申购业务,净申购金额＝申购金额－固定申购费金额。

净申购金额及申购份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位。

如果投资者选择交纳后端申购费,则申购份额的计算方法如下:

申购份额＝申购金额/T日基金份额净值

基金份额以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

例一:假定T日的基金份额净值为1.200元,三笔申购金额分别为1,000元、100万元和500万元,如果投资者选择交纳前端申购费,各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额(元,A)	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00
适用前端申购费率(B)	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额(C=A/(1＋B))	985.22	988,142.28	4,960,317.46
前端申购费(D=A－C)	14.78	11,857.71	39,682.54
申购份额(=C/1.200)	821.02	823,451.91	4,133,597.88

例二:假定T日的基金份额净值为1.200元,一笔申购金额为1000万元,如果投资者选择交纳前端申购费,该笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购4
申购金额(元,A)	10,000,000.00
适用前端申购费率(B)	-
前端申购费(C=A×B)	500.00
净申购金额(D=A-C)	9,999,500.00
申购份额(=D/1.200)	8,332,916.67

例二:假定T日的基金份额净值为1.200元,四笔申购金额分别为1,000元、100万元、500万元和1000万元,如果投资者选择交纳后端申购费,各笔申购获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额(元,A)	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00	10,000,000.00
申购份额(=A/1.200)	833.33	833,333.33	4,166,666.67	8,333,333.33

(2)赎回金额的计算

如果投资者在认购/申购时选择交纳前端认购/申购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

赎回总金额＝赎回总金额－赎回费用

如果投资者在认购时选择交纳后端认购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

后端认购费用＝赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率/(1＋后端认购费率);

(后端认购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)

赎回金额＝赎回总金额－赎回费用－后端申购费用

其中,基金份额面值为1.00元。

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

后端申购费用＝赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率/(1＋后端申购费率)

(后端申购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)

赎回金额＝赎回总金额－赎回费用－后端申购费用

例四:假定某投资者在T日赎回10,000份,该日基金份额净值为1.250元,其在认购/申购时已交纳前端认购/申购费,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回总金额＝10,000×1.250=12,500.00元

赎回费用＝12,500×0.5%=62.50元

赎回金额＝12,500-62=12,437.50元

例五:假定某投资者在募集期内认购本基金份额时选择交纳后端认购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.025、1.080和1.140元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端认购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
基金份额面值(B)	1.000	1.000	1.000
赎回日基金份额净值(C)	1.025	1.080	1.140
赎回总金额(D=A×C)	10,250.00	10,800.00	11,400.00
赎回费用(E=D×0.5%)	51.25	54.00	57.00
适用后端认购费率(F)	1.2%	0.9%	0.7%
后端认购费(G=A×B×F/(1+F))	118.58	89.20	69.51
赎回金额(=D-E-G)	10,080.17	10,656.80	11,273.49

例六:假定某投资者申购本基金份额当日的基金份额净值为1.200元,该投资者选择交纳后端申购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.230、1.300和1.360元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端申购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
申购日基金份额净值(B)	1.200	1.200	1.200
赎回日基金份额净值(C)	1.230	1.300	1.360
赎回总金额(D=A×C)	12,300.00	13,000.00	13,600.00
赎回费用(E=D×0.5%)	61.50	65.00	68.00
适用后端申购费率(F)	1.8%	1.5%	1.2%
后端申购费(G=A×B×F/(1+F))	212.18	177.34	142.29
赎回金额(=D-E-G)	12,026.32	12,757.66	13,389.71

(3)T日的基金份额净值在当日收市后计算,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、基金转换费用及转换份额的计算

(1)基金转换费:无。

(2)转出基金费用:按转出基金正常赎回时应收的赎回费收取费用,如该部分基金采用后端收费模式购买,需收取正常赎回时应收的后端申购费。

(3)转入基金费用:对转入基金申购费费率进行优惠,收取优惠申购费,细则如下:

①收取申购、赎回费用的基金之间的转换

第一,前端或后端收费模式基金I转入前端收费基金II(I→II)

如果II基金的前端申购费率最高档比I基金的前端申购费率最高档高,则其差额部分即为转入II基金时的优惠申购费率;反之,则转入II基金时的申购费率优惠为0。

特例处理:由于华夏回报二号、华夏优势增长申购金额在1,000万元以上的前端申购费率为固定费用1,000元,华夏红利申购金额在1,000万元以上的前端申购费率为固定费用500元,对于转换金额在1,000万元以上的A类或B类华夏债券基金份额转入华夏回报二号、华夏优势增长收取固定申购费用1,000元,对于转换金额在1,000万元以上的A类或B类华夏债券基金份额转入华夏红利收取固定申购费用500元。

第二,前端或后端收费模式基金I转入后端收费基金II(I→II)

转入II基金的已持有期为I基金后端申购费率为0的年限。例如,A类或B类华夏债券基金份额转入华夏大盘精选后收费,转入时即视为已持有华夏大盘精选满5年。

华夏回报二号、华夏优势增长转入其他可收转换业务的后端收费模式开放式基金免收后端申购费用。

②不收取申购、赎回费用的基金(目前包括华夏现金增利、华夏债券C类)与收取申购、赎回费用的基金之间的转换

第一,收取申购、赎回费用的基金转入华夏现金增利、华夏债券C类

转入华夏现金增利、华夏债券C类不收取申购费用。

第二,华夏现金增利、华夏债券C类转入收取申购、赎回费用的基金前端收费,按优惠的申购费率收取,公式如下:

收取的申购费率＝转入基金的申购费率－转出基金的销售服务费率*转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。

特例处理:现金增利或华夏债券C转入华夏红利、回报二号、优势增长、转换金额1000万元以上,实际收取申购费如下:

现金增利或债券C转入华夏红利前,实际收取申购费=500元－转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。

现金增利或债券C转入回报二号、优势增长,实际收取申购费=1000元－转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。

第三,华夏现金增利、华夏债券C类转入收取申购、赎回费用的基金后端收费

在计算转入基金的持有年限时,其持有期从买入华夏现金增利、华夏债券C类基金份额的时间开始计算。

上述为处理申(认)购时间不同的多笔基金份额的转出的情况,对转出基金持有时间的确定有特殊规定,即每当有基金新增份额时,均调整持有时间,计算方法如下:

调整后的持有时间＝原持有时间*原份额/(原份额＋新增份额)

③不收取申购、赎回费用的基金之间的转换(目前包括华夏现金增利、华夏债券C类)不收取转换费用。

4、基金管理人可以根据基金合同的相关规定调整申购费率和赎回费率,并按规定提前公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏红利混合型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》、《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规的要求,对本基金管理人于2008年2月14日刊登的本基金原招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了"三、基金管理人"的"主要人员情况"。

(二)更新了"四、基金托管人"的基本情况及相关业务经营情况。

(三)更新了"五、相关服务机构"的"代销机构"的相关信息,新增了"中国民生银行股份有限公司"、"中国光大银行股份有限公司"、"华龙证券有限责任公司"、"东方证券股份有限公司"、"中国建银投资证券有限责任公司"等代销机构信息,更新了律师事务所、会计师事务所的相关信息。

(四)更新了"八、基金份额的申购、赎回和转换"中直销和代销机构的相关信息。

(五)更新了"九、基金份额持有人数及持有人服务"的服务"中有关服务提供信息。

(六)更新了"十、基金的业绩",该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核。

(七)更新了"二十一、对基金份额持有人的服务"中有关服务提供信息。

(八)更新了"二十二、其他应披露事项",披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司

二〇〇八年八月十四日

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1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号文批准公开发售。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。

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。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。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2008年6月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年3月31日。

一、基金管理人

(一)基金托管人概况

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8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

客户服务电话:400-818-6666

传真:010-88066511

联系人:廖为

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

凌新源先生:董事长、硕士。曾任北京证券有限责任公司董事长、华夏证券股份有限公司副总裁、中国钢铁工贸集团公司总裁助理、中国冶金进出口总公司总裁助理、北京国际信托投资公司业务部副经理。

王东明先生:拟任董事长,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中信基金管理有限责任公司董事长、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、中信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、总经理、董事,北京华远经济建设公司副总经理,加拿大枫叶银行证券公司部门副经理,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、华北业务总监、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》、《证券投资基金法》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。

龙涛先生:独立董事,硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计组约分部从事审计和财务分析工作。

徐建先生: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资产监督管理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总经理等。

方瑞枝女士:督察长,硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生:监事,硕士。现任西南证券有限责任公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。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。

张鸣溪先生,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资银行部执行总经理、财务总监。曾任华夏证券股份有限公司并购业务管理部常务副总经理、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。

翟颖女士: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,硕士。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9日起任职)。

3、本公司投资委员会(股票投资)成员

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:华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

刘文动先生: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。

程海泳先生: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。

张益驰先生: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。

孙建冬先生:华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏红利混合型证券投资基金基金经理,共同担任华夏复兴股票型证券投资基金基金经理。

张龙先生:华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理,华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理。

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

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334,018,850,026元

联系电话:010-66106912

联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2008年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工101人,平均年龄30岁,90%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士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"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行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,取得了优异业绩。截至2008年6月,托管证券投资基金95只,其中封闭式10只,开放式85只。托管资产规模年均递增超过90%。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、履约类产品、QFII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》等国际国内媒体评选为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)基金份额销售机构

1、申购赎回代办证券公司(简称"一级交易商")

(1)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:肖时庆

客户服务电话:800-820-1868

传真:010-66568536

联系人:李洋

网址:www.chinastock.com.cn

(2)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

法定代表人:祝幼一

电话:021-38676666

传真:021-38670666

联系人:韩星宇

网址:www.gtja.com

客户服务电话:021-962588、400-888-8666

(3)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

(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)中信建投证券有限责任公司

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:权唐

网址:www.csc108.com

(6)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或拨打各城市营业网点咨询电话

(7)光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

电话:021-68816000

传真:021-68815009

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

客户服务电话:10108998或拨打各城市营业网点咨询电话

(8)中信证券股份有限公司

住所:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

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:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.ecitic.com

客户服务电话:各地营业部咨询电话

(9)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:020-87555888

传真:020-87557985

联系人:肖中梅

网址:www.gf.com.cn

客户服务电话:020-87555888-875

(10)国信证券有限责任公司

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:0755-82130833

传真:0755-82133302

联系人:林建闽

网址:www.guosen.com.cn

客户服务电话:800-810-8868

(11)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:程高峰

网址:www.htsc.com.cn

客户服务电话:400-888-8168、025-84579897

(12)联合证券有限责任公司

住所:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

联系人:盛宗凌

网址:www.lhzq.com

客户服务电话:400-8888-555、0755-25125666

(13)上海证券有限责任公司

住所:上海市九江路111号

办公地址:上海市临平北路19号

法定代表人:蒋元真

电话:021-65081063

传真:021-65217206

联系人:谢秀峰

网址:www.962518.com

客户服务电话:021-962518

(14)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.zyzq.cn

客户服务电话:0371-967218

(15)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座28层

办公地址:北京市建国门外大街一号国贸大厦2座28层

法定代表人:汪建熙

电话:021-58796226

传真:021-68875123

联系人:王欢

网址:www.cicc.com.cn

(16)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: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

(17)平安证券有限责任公司

住所:深圳市八卦三路平安大厦三楼

办公地址:深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼

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

(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:025-83364032

传真:025-83364032

联系人:石健

网址:www.njzq.com.cn

(19)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

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

传真:021-68419967

联系人:谢高得

网址:www.xyzq.com.cn

客户服务电话:021-68419393转1098

(20)国都证券有限责任公司

住所:深圳市福田区华强北路赛格广场45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

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:800-810-8809

(21)国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:凤良志

电话:0551-2207938

传真:0551-2634400-1171

联系人:祝丽萍

网址:www.gyzq.com.cn

客户服务电话:全国:400-888-8777、安徽地区:96888

(22)信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:钱凯法

客户服务电话:025-84784765

传真:025-84794830

联系人:舒萌菲

网址:www.thope.com

(23)中信金通证券有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783715

传真:0571-85783771

联系人:王勤

网址:www.96598.com.cn

客户服务电话:0571-96598

(24)国海证券有限责任公司

住所:中国广西南宁市滨湖路46号

办公地址:中国广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅锋

电话:0771-5539262

传真:0771-5539033

联系人:覃清芳

网址:www.ghzq.com.cn

客户服务电话:全国:400-8888-100、广西:96100

(25)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.qlzq.com.cn

客户服务电话:0531-82084184

(26)中信万通证券有限责任公司

住所:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

联系人:丁韶燕

网址:www.zxwt.com.cn

客户服务电话:0532-96577

(27)东海证券有限责任公司

住所:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人:朱科敏

电话:021-50586660

传真:021-50586660-8880

联系人:邵一明

网址:www.longone.com.cn

客户服务电话:0519-8166222、0379-64912266

2、二级市场交易代办证券公司

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:刘永卫

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:王丽

联系电话:010-66575888

传真:010-65232181

联系人:李娜

经办律师:李志宏、李娜

(四)会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所

住所:上海市延安东路222号30楼

办公地址:北京市东方广场东方经贸城西二办公楼8层

法定代表人:卢伯卿

联系电话:010-85207788

传真:010-85181218

联系人:刘昊

经办注册会计师:景宜青、郭新华

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。

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: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,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,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2008年4月18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2008年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占总资产比例
股票①	13,707,717,939.75	94.04%
债券	11,058,052.50	0.08%
权证	2,485,885.25