

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

要

(2006 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”)经中国证券监督管理委员会证监基金字[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 2006 年 12 月 30 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 月 31 日。

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 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

电话: (010) 88066688

传真: (010) 88066566

联系人: 张弘弢

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 | 40.725% |
| 西南证券有限责任公司 | 35.725% |
| 北京证券有限责任公司 | 20% |
| 中国科技证券有限责任公司 | 3.55% |
| 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。现兼任北京证券有限责任公司董事长，曾任华夏证券有限公司副总裁、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。

范勇宏先生：副董事长、总经理，博士。曾任华夏证券有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王东明先生：董事，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。

范剑先生：董事，硕士。现任西南证券有限责任公司副总裁。曾任中国煤炭工业进出口集团公司市场部副总经理。

李洋先生：董事，学士。现任北京证券有限责任公司资产保全部总经理。曾任北京市财政局外事财务处处长。

王邦志先生：董事，硕士。现任中国科技证券有限责任公司副总经理。曾任中国科技国际信托投资有限责任公司副总经理、信贷部项目经理、证券总部总经理。

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造币局工作。

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公司纽约分部从事审计和财务分析工作。

涂建先生：独立董事，学士。现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，并兼任上海证券交易所上市公司专家委员会委员。

鲁明泓先生：独立董事，博士。现任南京大学商学院教授、博士生导师、哥伦比亚大学客座研究员。曾在美国哈佛大学做博士后研究工作。

刘芳勤女士：独立董事，学士，高级经济师。现已退休。曾任中国工商银行北京朝阳支行副行长、吉林省长春市计划委员会副处长。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理、工会主席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。现任北京证券有限公司投资银行部执行总经理、财务总监。曾任华夏证券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。

瞿颖女士：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业务主管。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月起任职）。

3、本公司投资决策委员会成员

范勇宏先生：华夏基金管理有限公司副董事长、总经理。

滕天鸣先生：华夏基金管理有限公司执行副总经理。

王亚伟先生：华夏基金管理有限公司总经理助理、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、兴安证券投资基金基金经理。

杨爱斌先生：华夏基金管理有限公司固定收益总监。

石波先生：华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部执行副总经理、华夏回报证券投资基金基金经理、华夏回报二号证券投资基金基金经理。

文鸣先生：华夏基金管理有限公司固定收益部总经理。

张益驰先生：兴华证券投资基金基金经理、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理。

程海泳先生：华夏基金管理有限公司基金经理。

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 286,509,130,026 元

联系电话：010-66106912

联系人：蒋松云

（二）主要人员情况

中国工商银行资产托管部共有员工 77 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 2006 年 12 月，托管证券投资基金 73 只，其中封闭式 16 只，开放式 57 只。托管资产规模年均递增超过 70%。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、QFII 资产、履约类产品等十一大类 16 项产品的托管业务体系。继 2004 年先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号后，2005 年，又分别获得《财资》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。

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）中国银河证券有限责任公司

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：朱利

电话：(010) 66568613、66568587

传真：(010) 66568536

联系人：郭京华

（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：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818

传真：(021) 62583439

联系人：韩星宇

(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：王明权

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54030294

联系人：李清怡

(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 39-45 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) 82943511

传真：(0755) 82943237

客户服务热线：400-8888-111；(0755) 26951111

联系人：黄健

(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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：400-8888-108

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

(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：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566

传真：(021) 53858549

联系人：金芸、杨薇

(7) 光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 室

法定代表人：王明权

电话：(021) 68823685

传真：(021) 68815009

联系人：刘晨

(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

(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

(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 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 楼

法定代表人：何如

电话：(0755) 82133066

传真：(0755) 82133302

联系人：林建闽

(11) 华泰证券有限责任公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：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) 84457777-721/950、84579897

传真：(025) 84579879

联系人：袁红彬、李金龙

(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：马国强

电话：(0755) 82493561

传真：(0755) 82492062

联系人：盛宗凌

(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：临平北路 19 号

法定代表人：蒋元真

电话：(021) 65076608-577

传真：(021) 65081069

联系人：刘永

(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：张建刚

电话：(0371) 967218、(0371) 65585256

传真：(0371) 65585670

联系人：巴冠华

(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

(16) 长江证券有限责任公司

住所：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F

法定代表人：明云成

电话：((027) 65799560

传真：(027) 85481532

联系人：毕艇

(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 518029

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法人代表：叶黎成

电话：(0755) 82450826、22622287

传真：(0755) 824332794

联系人：余江、庄维佳

(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

电话：(025) 83364032

传真：(025) 83364032

联系人：石健

(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：上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419974

传真：(021) 68419867

联系人：杨盛芳

(20) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

办公地址：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

电话：(010) 64482828-390

传真：(010) 64482090

联系人：马泽承

(21) 国元证券有限责任公司

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：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

传真：(0551) 2634400-1171

联系人：李蔡

(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

电话：(025) 84784765

传真：(025) 84784830

联系人：舒萌菲

(23) 中信金通证券有限责任公司

住所：杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9-12 楼

办公地址：杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9-12 楼

法定代表人：应土歌

电话：(0571) 85783737

传真：(0571) 85783748

联系人：余少南

(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

(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：李炜

电话：(0531) 2024184

传真：(0531) 2024197

联系人：付英梅

(26) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市东海路 28 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：(0532) 5023457

传真：(0532) 5022025

联系人：丁韶燕

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

地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 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

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：郑树成

联系电话：(010) 85207788

传真：(010) 85181218

联系人：周英

经办注册会计师：景宜青、张扣娣

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：中央交易室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 2007 年 1 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 2006 年 12 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

| | 金额（元） | 占总资产比例 |
|----|------------------|--------|
| 股票 | 5,474,106,091.90 | 97.97% |

| | | |
|--------------|------------------|---------|
| 债券 | - | - |
| 权证 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - |
| 银行存款和清算备付金合计 | 92,175,837.38 | 1.65% |
| 其他资产 | 21,505,168.62 | 0.38% |
| 合计 | 5,587,787,097.90 | 100.00% |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业分类 | 市值（元） | 占净值比例 |
|-----|----------------|------------------|--------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | 373,037,321.09 | 6.79% |
| C | 制造业 | 1,600,246,958.32 | 29.14% |
| C0 | 其中：食品、饮料 | 324,014,660.24 | 5.90% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 74,061,866.34 | 1.35% |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 140,747,761.13 | 2.56% |
| C5 | 电子 | 17,298,197.78 | 0.32% |
| C6 | 金属、非金属 | 726,391,352.87 | 13.23% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 283,709,646.00 | 5.17% |
| C8 | 医药、生物制品 | 26,934,151.16 | 0.49% |
| C99 | 其他制造业 | 7,089,322.80 | 0.13% |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 422,349,512.58 | 7.69% |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 625,125,914.83 | 11.39% |
| G | 信息技术业 | 361,391,010.62 | 6.58% |
| H | 批发和零售贸易 | 21,682,544.42 | 0.39% |
| I | 金融、保险业 | 1,919,411,560.20 | 34.96% |
| J | 房地产业 | 15,156,974.88 | 0.28% |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | 19,885,464.28 | 0.36% |
| M | 综合类 | 115,818,830.68 | 2.11% |
| | 合计 | 5,474,106,091.90 | 99.70% |

3、报告期末按市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） | 期末市值（元） | 占净值比例 |
|----|--------|------|------------|----------------|--------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 36,884,013 | 603,422,452.68 | 10.99% |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 53,500,853 | 545,708,700.60 | 9.94% |
| 3 | 600019 | 宝钢股份 | 39,612,399 | 343,043,375.34 | 6.25% |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 63,157,048 | 294,943,414.16 | 5.37% |
| 5 | 601988 | 中国银行 | 50,619,375 | 274,863,206.25 | 5.01% |
| 6 | 600028 | 中国石化 | 28,879,550 | 263,381,496.00 | 4.80% |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 2,725,728 | 239,400,690.24 | 4.36% |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 23,698,880 | 231,538,057.60 | 4.22% |
| 9 | 600000 | 浦发银行 | 10,596,470 | 225,810,775.70 | 4.11% |
| 10 | 600005 | 武钢股份 | 27,810,783 | 176,876,579.88 | 3.22% |

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

截至本报告期末，本基金未持有债券。

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至本报告期末，本基金未持有债券。

6、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) 基金的其他资产构成

单位：元

其他应收款 21,228,036.00

交易保证金 250,000.00

应收利息 27,132.62

合计 21,505,168.62

(4) 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期内获得的权证

权证名称 数量(份) 成本总额(元)

被动持有权证 伊利 CWB1 1,013,304 -

主动投资权证 - - -

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。基金的过往业绩不代表未来表现。

(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 |
| 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% |

(二) 基金份额收益分配情况表

单位：元/每份基金

2004年度 2005年度 2006年度

- - 0.061

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：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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 个工作日内从基金财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。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

(4) 本条第（一）款第 1 项中第（3）至第（8）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。

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财产的损失，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

申购、赎回费用

投资者在申购或赎回基金份额时，需按照本招募说明书第十条第（六）款的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

$$\text{申购/赎回佣金} = \text{申购/赎回份额} \times \text{佣金比率}$$

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资者申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了“三、基金管理人”的“基金管理人概况”、“主要人员情况”等；
- 2、对“四、基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况进行了更新；
- 3、更新了“五、相关服务机构”的“一级交易商”的相关信息；
- 4、对“十、基金份额的申购与赎回”的“申购和赎回场所”信息进行了更新，并且以 2006 年 12 月 29 日的日期更新了“申购、赎回清单的格式”；
- 5、更新了“十一、基金的投资”中投资组合报告，该部分内容均按有关规定编制，并经基

金托管人复核：

6、更新了“十二、基金的业绩”中“基金业绩”、“基金份额收益分配情况表”的相关内容；

7、更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”中有关服务提供信息；

8、更新了“二十四、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书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

二〇〇七年二月九日