上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
2018年3月

重要提示

本基金经2010年6月1日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]747号)核准,进行募集。并经中国证监会基金部2010年8月5日基金部函[2010]号文件《关于上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2010年8月5日正式生效,基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

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募集的核准,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。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险,等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。投资有风险,投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年2月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:鹏华基金管理有限公司

2、住所:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

3、设立日期:1998年12月22日

4、法定代表人:何如

5、办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

6、电话:(0755)82021233 传真:(0755)82021155

7、联系人:吕奇志

8、注册资本:人民币1.5亿元

9、股权结构:

出资人名称	出资额(万元)	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 计	15,000	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生,董事长,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记,深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记,现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生,董事,经济学博士,讲师,国籍:中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员,现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生,董事,经济学博士,国籍:中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业(集团)有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁, 国信证券股份有限公司副总裁,国信证券股份有限公司公司顾问。

Massimo Mazzini先生,董事,经济和商学学士。国籍:意大利。曾在安达信(Arthur Andersen MBA)从事风险管理和资产管理工作,历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)投资副总监、农业信贷另类投资集团(Credit Agricole Alternative Investments Group)国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)投资方案部投资总监、Epsilon资产管理股份公司(Epsilon SGR)首席执行官,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)首席执行官和总经理。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)市场及业务发展总监。

Andrea Vismara先生,董事,法学学士,律师,国籍:意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师, 先后在法国农业信贷集团(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)法务部、产品开发部, 欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)治理与股权部工作,现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A)董事会秘书兼任企业事务部总经理,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)企业服务部总经理。

周中国先生,董事,会计学硕士研究生,国籍:中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理;2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理;2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

史际春先生,独立董事,法学博士,国籍:中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授,现任中国人民大学法学院教授、博士生导师,国务院特殊津贴专家,兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生,独立董事,大学本科,国籍:中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑,甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任,中央金融工作委员会研究室主任,中国银监会政策法规部(研究局)主任(局长)等职务;2005年6月至2007年12月, 任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记;2007年12月至2010年12月,任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士,独立董事,工商管理硕士,国籍:中国。曾任中国进出口银行副处长,负责贷款管理和运营,项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购;2007年加入曼达林投资顾问有限公司, 现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄前先生,监事会主席,研究生学历,国籍:中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作,曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

陈冰女士,监事,本科学历,国籍:中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等,现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI先生,监事,工商管理学士,国籍:意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗IMI资产管理SGR企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)财务管理和投资经理,现任欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)财务负责人。

于丹女士,职工监事,法学硕士,国籍:中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部法务主管,现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生,职工监事,大专学历,国籍:中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,现任登记结算部总经理。

刘嶔先生,职工监事,管理学硕士,国籍:中国。历任毕马威(中国)管理顾问公司咨询顾问, 南方基金管理有限公司北京分公司副总经理;2014年10月加入鹏华基金管理有限公司, 现任首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生,董事长,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记,深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记,现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生,董事,总裁,经济学博士,讲师,国籍:中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员,现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生,副总裁,特许金融分析师(CFA),经济学硕士,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司经理,博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生,副总裁,工商管理硕士、法学硕士,国籍:中国。历任中国人民大学校办科员,中国证监会办公厅副处级秘书,全国社保基金理事会证券投资部处长、股权资产部(实业投资部)副主任,并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理,鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长,现任鹏华基金管理有限公司副总裁、电子商务部总经理。

苏波先生,副总裁,管理学博士,国籍:中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理,南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理,易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理,鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生,督察长,法学硕士,国籍:中国。历任中共中央办公厅秘书局干部,中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长,现任鹏华基金管理有限公司督察长。

韩亚庆先生,副总经理,经济学硕士。国籍:中国。历任国家开发银行资金局主任科员,全国社保基金理事会投资部副调研员,南方基金管理有限公司固定收益部基金经理、固定收益部总监,现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4、本基金基金经理

崔俊杰先生,国籍中国,管理学硕士,10年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作。2013年03月担任鹏华深证民营ETF基金基金经理,2013年03月担任鹏华深证民营ETF联接基金基金经理,2013年03月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理,2013年03月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2013年07月担任鹏华沪深300ETF基金基金经理,2014年12月担任鹏华资源分级基金基金经理,2014年12月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年04月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015年08月至2016年07月担任鹏华医药分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华中证医药卫生(LOF)基金基金经理,2016年11月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:

2013年03月担任鹏华深证民营ETF基金基金经理

2013年03月担任鹏华深证民营ETF联接基金基金经理

2013年03月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理

2013年07月担任鹏华沪深300ETF基金基金经理

2014年12月担任鹏华资源分级基金基金经理

2014年12月担任鹏华传媒分级基金基金经理

2015年04月担任鹏华银行分级基金基金经理

2015年08月至2016年07月担任鹏华医药分级基金基金经理

2016年07月担任鹏华中证医药卫生(LOF)基金基金经理

2016年11月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理

张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,11年证券基金从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师;2011年3月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作。2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理,2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2016年06月担任鹏华新丝路分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理,2016年09月担任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理,2016年09月担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理,2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华一带一路分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:

2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理

2016年06月担任鹏华新丝路分级基金基金经理

2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理

2016年09月担任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理

2016年09月担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理

2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理

2016年11月担任鹏华一带一路分级基金基金经理

本基金历任的基金经理:

2010年08月至2013年03月 方南先生

5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生,鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

梁浩先生,鹏华基金管理有限公司研究部总经理,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合基金经理。

赵强先生,鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部FOF投资副总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2017年末,中国工商银行资产托管部共有员工230人,平均年龄33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,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、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、基本养老保险、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2017年末,中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003 年以来,本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《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54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。

(四)基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部"一手抓业务拓展,一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后,2015年、2016年中国工商银行资产托管部均通过ISAE3402(原SAS70)审阅,迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立"以人为本"的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1、申购赎回代理券商(简称"一级交易商")

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

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:王连志

联系人:陈剑虹

客户服务电话:4008-001-001

网址:www.essence.com.cn

2)渤海证券股份有限公司

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:王春峰

联系人:蔡霆

客户服务电话:400-651-5988

网址:www.ewww.com.cn

3)长江证券股份有限公司

注册地址: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:尤习贵

联系人:奚博宇

客户服务电话:95579/4008-888-999

网址:www.95579.com

4)东兴证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表:徐勇力

联系人:汤漫川

电话:010-66555316

服务热线:4008888993

公司网站:www.dxzq.net

5)方正证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路华侨国际大厦24楼

办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层

法定代表人:高利

联系人:丁敏

客户服务电话:95571

网址:www.foundersc.com

6)光大证券股份有限公司

注册地址: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:薛峰

联系人:何耀

客户服务电话:95525

网址:www.ebscn.com

7)广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场5、7、8、17、18、19、38-44楼

办公地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客户服务电话:95575

网址:www.gf.com.cn

8)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路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:杨德红

联系人:芮敏祺

客户服务电话:400-8888-666/95521

网址:www.gtja.com

9)国信证券股份有限公司

注册地址: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

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

联系人:周杨

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

10)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号

办公地址:上海市黄浦区广东路689号

法定代表人:周杰

联系人:赵洋洋

客户服务电话:95553

网址:www.htsec.com

11)华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路228号

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人:周易

联系人:庞晓芸

联系电话:0755-82492193

传真:0755-82492962

客户服务电话:95597

网址:www.htsc.com.cn

12)华西证券股份有限公司

注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人:杨炯洋

联系人:谢国梅

客户服务电话:95584

网址:www.hx168.com.cn

13)平安证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人:曹实凡

联系人:周一涵

客户服务电话:95511-8

网址:stock.pingan.com

14)申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:李梅

联系人:李玉婷

客户服务电话:95523/4008895523

网址:www.swhysc.com

15)山西证券股份有限公司

注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯巍

联系人:郭熠

客户服务电话:95573/400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

16)湘财证券股份有限公司

注册地址: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

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

联系人:李欣

客户服务电话:95351

网址:www.xcsc.com

17)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

办公地址:上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦

法定代表人:兰荣

联系人:乔琳雪

客户服务电话:95562

网址:www.xyzq.com.cn

18)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

办公地址: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

客户服务电话:95565

网址:www.newone.com.cn

19)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2-6层

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:陈共炎

联系人:辛国政

客户服务电话:4008-888-888或95551

网址:www.chinastock.com.cn

20)中泰证券股份有限公司

注册地址:济南市市中区经七路86号

办公地址:上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人:李玮

联系人:许曼华

客户服务电话:95538

网址:www.zts.com.cn

2、二级市场交易代理券商

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、基金管理人可以根据相关法律法规要求,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

法定代表人:周明

办公室地址:北京市西城区太平桥大街17号

联系电话:010-50938782

传真:010-50938907

负责人:赵亦清

(三) 律师事务所

名称:北京市竞天公诚律师事务所

住所:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层

法定代表人:赵洋

办公室地址:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层

联系电话:(010) 58091000;(0755) 23982200

传真:(010) 58091100;(0755) 23982211

联系人:黄亮

经办律师:孔雨泉、黄亮

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

法定代表人:李丹

办公室地址:上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:魏佳亮

经办会计师:许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称:上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金

五、基金运作方式及类型

本基金为交易型开放式股票证券投资基金

六、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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于上证民营企业50指数的成份股及其备选成份股 (投资比例不低于基金资产净值的95%)。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非上证民营企业50指数成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例,或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融工具纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在上证民营企业50指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力求降低跟踪误差。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%, 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、跟踪误差进一步扩大。

1、投资决策依据

(1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;

(2)经济运行态势和证券市场走势;

(3)标的指数的编制方法及其变更。

2、投资决策程序

(1)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制定基金投资方面的整体投资计划、投资原则及其它重大事项等;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作;

(2)基金经理根据上证民营企业50指数成份股名单及权重,考虑本基金资产规模及需保留现金比例等因素,拟定本基金指数化投资的初始方案;

(3)基金经理根据标的指数变动情况、实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果和风险监控的评估结果,采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整,密切跟踪标的指数;

(4) 交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(5) 风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估并提供相关绩效评估报告;

(6)监察稽核相关部门对投资合规性进行监控;

(7) 本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市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在基金招募说明书更新中予以公告。

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,即上证民营企业50指数。

本基金标的指数变更的,业绩比较基准随之变更并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告

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股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31止。

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	87,895,345.08	99.14
	其中:股票	87,895,345.08	99.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	763,132.56	0.86
8	其他资产	409.16	0.00
9	合计	88,658,886.80	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2.1的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,570,009.50	4.06
C	制造业	50,796,043.13	57.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,266,518.00	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	355,100.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,519,588.12	5.14
J	金融业	15,899,727.10	18.07
K	房地产业	8,889,119.23	10.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	599,240.00	0.68
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	87,895,345.08	99.87

(2)报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

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