

（上接B055版）

公司网址: www.lufund.com
(84)北京虹点基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
联系人:陈裕洲
联系电话:010-65961887
传真:010-65961087
客服电话:400681176
公司网址: www.hongdianfund.com
(85)大泰金石基金销售有限公司
住所:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁树刚
联系人:孟召社
联系电话:021-30234176
传真:021-20324199
客服电话:400-928-2266
公司网址: www.dttfund.com
(86)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市浦东新区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈维武
联系人:高皓晖
联系电话:021-63333289
传真:021-63333380
客服电话:4006-430-389
公司网址: www.vstonewealth.com
(87)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏娜
联系电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网址: www.yingmi.cn
(88)类基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技大厦A座17楼1704室
法定代表人:TREWE WEBB HOWE
联系人:叶世雄
电话:0755-89460500
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
公司网址: www.ifastps.com.cn
(89)安联期货股份有限公司
住所:安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层
办公地址:安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层（总部）
法定代表人:朱文忠
联系人:梁蕾
联系电话:0651-62870125
传真:0651-62870131
客服电话:400 626 9988
公司网址: http://www.alq.com/
(90)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层313室
办公地址:上海市市长宁区福泉北路518号9座5层
法定代表人:吕盛斌
联系人:阮东杰
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-468-788
公司网址: www.66zichan.com
(91)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:陈剑炜
联系电话:010-57418813
客服电话:400-893-6885
公司网址: www.qianjing.com
(92)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安富路15-1号邮电新闻大厦2楼
法定代表人:陈敬松
电话:010-59601366
传真:010-62020355
联系人:霍文
客户服务电话:4008189000
公司网址: www.myfund.com
(93)深圳市金斧子基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园D3单元17楼
法定代表人:赖任军
电话:0755-29330513
传真:0755-26920630
联系人:刘斯微
客户服务电话:400-930-0660
公司网址: www.jinzixun.com

(94)北京广源达信基金销售有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京花园四区13号楼博顺中心B座19层
法定代表人:李海刚
电话:4006220600
传真:4006220600
联系人:王英爽
客户服务电话:400-999-8877
公司网址: www.webank.com
(98)上海展恒基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长海镇路园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:范杰
电话:021-65370077-220
传真:021-55088991
客尸服务电话:021-65370077
网址: www.jiuyitun.com
(99)北京懒猫金融信息服务有限公司
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人:许现良
电话:010-57649619
传真:010-57649620
联系人:宋翔宇
客户服务电话:010-57649619
公司网址: www.lanmao.com
(100)嘉实财富(北京)信息科技有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪涛
电话:+861088312877
传真:+861088312877
联系人:赵越
客户服务电话:400-001-1566
公司网址: http://www.yiliuaitu.com/
(101)南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王隽
电话:025-66969699-887226
传真:025-66608800-887226
联系人:张慧
客户服务电话:96177
公司网址: www.sanjifund.com
(102)北京微众基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜康东路1号第6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜康东路1号第6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61940699
传真:010-61940699
联系人:吴季林
客户服务电话:4000618518
公司网址: https://danjuanapp.com
(103)上海聚谷基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
法定代表人:袁飞
电话:61621602
传真:61621602-819
联系人:袁振荣
客户服务电话:61621602

公司网址: www.g-fund.com.cn
(104)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号A座1106室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法定代表人:王伟刚
电话:010-56251471
传真:010-62808027
联系人:熊小满
客户服务电话:400-619-9069
公司网址: www.hycfund.com
(105)厦门市鑫鼎隆控股有限公司住所:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人:陈洪生
电话:0592-3122672
传真:0592-3122771
联系人:梁云波
客户服务电话:400-9189808
公司网址: www.xds.com.cn
(106)北京新浪仓石基金销售有限公司
住所:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层18室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层18室
法定代表人:李阳熙
电话:010-62767405
传真:8610-62675979
联系人:付文立
客户服务电话:010-62675369
公司网址: www.xincail.com
(107)天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区临港工业园综合服务区办公楼D座二层202-1室
办公地址:天津市明区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287994
传真:010-59287825
联系人:郭宝荣
客服电话:400-111-0889
公司网址: www.gomefund.com
(108)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
电话:010-58160168
传真:010-58160173
联系人:张旭
客户服务电话:400-810-5919
公司网址: www.fengdit.com
(109)上海云湾基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:上海市浦东新区新金桥康桥308号6号楼6楼
法定代表人:戴新赛
电话:021-20638888
传真:021-20638999
联系人:江晖
客户服务电话:400-820-1515
公司网址: www.zhengtongfunds.com
(110)南京浦银基金销售有限公司
住所:南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人:李伟
联系人:阮海松
联系电话:025-86962900
客服电话:4007-999-999
公司网址: http://www.tuniu.com
(111)上海万得基金销售有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得1大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:陈亚非
联系电话:021-51327185
传真:021-50710161
客服电话:400-821-0203
公司网址: www.520fund.com.cn
(112)杭州科瑞基金销售有限公司
住所:杭州市西湖区文苑路98时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
联系人:张雨婷
联系电话:0571-86262700
传真:0571-86262600
客服电话:0571-86915761
公司网址: www.wd121.com
(113)北京植信基金销售有限公司
住所:北京市密云区云里盛康园8号楼2单元106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:杨纪伟
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
公司网址: www.zhixin-inv.com
(114)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路96号19号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座
法定代表人:江卉
联系人:李志刚
电话:4000988511/4000988816
传真:010-89189800
客服电话:96118
电话: http://fund123.com/
(115)上海聚阳永续基金销售有限公司
住所:浦东新区上南路977号1幢B座812室
办公地址:上海市浦东新区碧波路600号4号楼2楼
法定代表人:廖冰
联系电话:021-80234888-6694
传真:021-80234898
客服电话:4006991888
公司网址: www.998fund.com
(116)中金牛(北京)投资有限公司
住所:北京市丰台区东管营11号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区德胜门大街外大街1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊昊
联系人:徐斐
电话:4000988511/4000988816
传真:010-89189800
客服电话:96118
电话: http://fund123.com/
(117)上海海华财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:上海市西城区金融大街33号3号楼B座8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲庆明
电话:010-88066632
传真:010-63136184
客服电话:400-817-6666
公司网址: www.amcfot.com.cn
(118)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层154号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层154号
法定代表人:胡捷
联系人:陆峰
客户服务电话:4000279699
公司网址: www.buyifunds.com
(119)和祥传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人:李淑慧
联系人:罗聪
客户服务电话:0371-85618296
公司网址: www.hjccpb.com
(120)藏商前海有限责任公
住所:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4.6.7层、6号楼1.2层
办公地址:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4.6.7层、6号楼1.2层
法定代表人:吴国华
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008978707
公司网址: www.honghai.com
(121)北京微众基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人:梁洪军
联系人:季长军
客户服务电话:40019-6665
公司网址: www.wuyifund.com.cn
(122)成都华羿信恒基金销售有限公司
住所:中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址:中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:申健
联系人:宋楠
客户服务电话:021-20219988
客服电话:021-50810673
公司网址: www.waasifund.com
(124)上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人:申健
联系人:宋楠
客户服务电话:021-20219988
客服电话:021-20292031
网址: https://www.wg.com.cn/
(125)北京加和基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公街4号5号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404

法定代表人:徐福里
联系人:李美
电话:010-68292940
传真:010-68292964
客户服务电话:400-600-0030
网址: www.bztzunds.com
(126)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河黄甲坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:刘曜斌/徐晓荣
电话:010-58170006/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网址: www.shengshiview.com.cn
(127)北京格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
客户服务电话:400-066-8586
公司网址: www.igesafe.com
(128)北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(望)中心11号楼36层3603室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(望)中心11号楼36层3603室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址: http://www.dianyingfund.com/
(129)天津万家财富资产管理有限公司
住所:天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修静
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013825
公司网址: http://www.wanjiawealth.com/
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)注册登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2906-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2906-2908室及30层
法定代表人:杨皓瑜
总经理:杨皓瑜
成立日期:2004年3月18日
电话:021-38428088
传真:021-68419328
联系人:周琳
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人:韩朝
电话:021-31369666
传真:021-31369600
经办律师:秦悦民、王利民
(四)审计会计师事务所
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号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:毛贲宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:徐伟
经办会计师:徐伟、朱均
九、基金的名称
中海150指数增强型证券投资基
五、基金的类型
股票型证券投资基金
六、基金的投资目标
本基金为股票指数增强型基金,在被动跟踪标的指数的基础上,加入增强型的积极管理,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差率不超过7.75%。在控制基金组合跟踪误差的前提下力争取得高于业绩基准的稳定收益,追求长期资本增值。

七、基金的投资范围
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括上证50指数成份股及其备选股、新股、债券,以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种(如股指期货等),基金管理人可在履行适当程序后将其纳入投资范围。
本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-96%,投资于上证50指数成份股、备选股成份的股票资产占基金资产的比例不低于90%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、基金的投资理念
采用增强型量化投资的理念,以跟踪上证50指数为主,辅以适度增强的投资以追求对标的指数的适当超越,使投资者充分分享中国经济增长所带来的良好收益。
九、基金的投资策略
本基金将采用“指数化投资为主、主动增强投资为辅”的投资策略,在完全复制制的指数的基础上有限度地调整个股,从而最大限度地降低由于交易成本等因素造成的股票投资组合相对于标的指数的偏离,并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。
1、资产配置策略
为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标,本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于90%,投资于上证50指数成份股、备选股成份的股票资产占基金资产的比例不低于90%。本基金将采用完全复制为主,增强投资为辅的方式,买入标的指数的成份权重构建被动组合,同时辅以主动增强投资,为基金投资组合进行适当调整,力争本基金投资目标的实现。
2、股票投资策略
本基金被动投资组合采用完全复制方法进行构建,对于法律法规规定不能投资的股票将选择其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下与自下而上相结合的方法,依据宏观微观研究以及个股研究,在上证50指数中配置有超额收益预期的成份股,同时,根据研究员的研究成果,适当的选择部分上证50指数成份股以外的股票作为增强投资组合,构建主动型投资组合。
(1)指数化投资
本基金指数化投资部分不低于基金资产的80%,主要采用完全复制制的指数的被动投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重来被动构建股票投资组合,从而有效跟踪标的指数,控制跟踪误差。
(2)主动增强策略
在指数化投资过程中,由于交易成本的存在,完全复制的被动投资策略可能很难有效跟踪标的指数。因此,本基金将采用主动型的主动投资策略对指数化投资进行修正,以求降低由于交易成本等因素造成的对标的指数的跟踪的影响,并力争适度超越标的指数,获取超额收益。主动增强投资部分不超过基金资产的15%。
(3)个股精选与适度调整
本基金将在充分进行宏观经济学研究与个股深度研究的基础上,结合自上而下与自下而上两种策略对成份股进行多维度的深度研究,在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,将适度地配置价值低估或者成长性良好的个股以超额收益预期的成份股。
2)对非成份股进行适度调整
本基金将基于投研团队充分的调研与全面的研究论证,进行以下三种具体操作:
a.合理替代部分流动性缺失的成份股。标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被本基金禁止投资股票以及交易量不足等因素,使得本基金无法依照标的指数权重购买成份股。因此,本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否买入相关的成份股。本基金将首先将该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代;若成份股中没有符合要求的替代品种,本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的股票作为替代品种。
b.跟踪纳入部分备选股成份股。如果跟踪标的指数的成份股将会发生调整,本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否提前购入部分备选股成份股。
c.剔除部分不符合成份股条件的成份股。本基金管理人将采用数量化分析与基本面判断相结合的研究方法,在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上,决定适度买入部分具有增长潜力、适合投资价值的非成份股。
此外,本基金还将积极把握一级市场的新股申购与增发的盈利机会,以求提高资金运用效率。
3、债券投资策略
本基金将根据国际与国内宏观经济形势、债券市场资金状况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期等进行综合分析,评定各债券品种的投资价值,同时着重考虑债券基金的投资管理需要,主要选择到期日在一年以内的政府债券进行配置。
4、流动性风险管理
(1)投资组合调整原则
本基金为指数增强型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整,同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制,申购赎回变动影响、新股增发等因素,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
(2)投资组合调整方法
1)对标的指数的跟踪调整
本基金所构建的指数化投资组合将根据上证50指数成份股的调整而进行相应的跟踪调整。
定期调整
根据上证50指数成份股定期调整结果,基于本基金的投资组合调整原则,对投资组合进行相应调整。
不定期调整
当上证50指数的成份股因增发、送配等权益变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据上证50指数成份股调整因素,基于本基金的投资组合调整原则,对投资组合进行相应调整。
2)限制性调整
投资比例限制调整
根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例超过个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时的被动性卖出调整,并相应地对其投资组合类别或个股进行微调,以保证基金合法规范运行。
大额赎回调整
当发生大额赎回超过现金保有比例时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以确保基金正常运作。
十、基金的投资决策依据和决策程序
1、投资决策依据:
(1)国家有关法律、法规和基金合同等的有关规定;
(2)宏观经济增长趋势和证券市场走势;
(3)标的指数的编制方法及其变更。
2、投资决策流程:
本基金投资决策流程主要包括:
●投资决策委员会决定大类资产配置比例范围;投资决策委员会负责研究市场策略分析师和投资决策委员会讨论并达成一致意见,决定大类资产配置的范围。
●基金经理根据投资决策委员会决议决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的投资策略和投资计划;中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理根据其本人对宏观经济和大势的判断,在投资决策委员会决定的大类资产配置范围内,决定本基金的大类资产配置比例。
●投资决策性方案的制定:基金经理依据金融工程部的数量化选股结合投研研究成果以及金融工程部提出的跟踪误差控制方案,决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的具体操作性方案。

●合规性检查:基金经理的投资操作在日常工作中接受实时的合规性检查。
●投资操作性方案的执行:基金经理在决定本基金的投资操作性方案后,在日常工作中进行下单交易。
●风险监控与监控:交易过程受风险控制部实时监控。
●基金事务部清算:基金事务部负责基金的清算。
绩效评估与跟踪误差产生的控制:金融工程部定期对本基金进行绩效评估和跟踪误差计算,并分析跟踪误差产生的原因,当跟踪误差超过约定数值时,金融工程部提供降低跟踪误差的建议。
十一、基金的投资组合管理
1、本基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)持有一家上市公司股票,其市值不得超过基金资产净值的10%。
(2)本基金与由基金管理人管理的其市值不得超过一家上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%;本基金管理人管理的全部开放式基金包括本开放式基金以及处于开放期的定期开放基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;本基金指数化投资部分不受本条限制。
(3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%。
(4)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有一切权证的比例不得超过该证券的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定。
(5)现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(6)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%。
(7)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%。
(8)基金管理人管理的本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。
(9)本基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。
(10)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金资产净值之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(11)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围一致;
(12)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。
(13)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。
《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,本基金投资不受上述限制。

股上规定:《10》(11)项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调,以达到合规。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
2、为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
(1)承销证券。
(2)向他人贷款或者提供担保。
(3)从事承担无限责任的投。
(4)买卖其他基金份额,但法律法规另有规定的除外。
(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券。
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
(8)当有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。
法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

十二、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:
上证50指数×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%。
如果基金所跟踪的标的指数被证监会指数公司停止发布,或由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人将在履行适当程序后,可以变更基金的跟踪标的指数和投资对象,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。
十三、基金的风险收益特征
本基金属指数增强型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险较高预期收益品种。
十四、基金投资组合报告
基金管理人及董事保证本基金投资组合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基金合同规定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为截至2017年12月31日报告期末的季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。
1、基金资产组合情况
截至2018年6月30日,中海上证50指数增强型证券投资基金资产净值为119,523,648.70元,基金份额净值为1.116元,累计基金份额净值为1.116元。其资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	112,610,543.70	93.47
其中:股票	112,610,543.70	93.47	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,132,214.20	5.09
其中:债券	6,132,214.20	5.09	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其它金融资产投资	-	-
其中:3/6/9/12/36/48个月国债	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,406,477.56	1.17
8	其他资产	264,386.26	0.22
9	合计	120,472,631.46	100.00

序号	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	4,800,062.00	4.02
C	制造业	31,417,316.03	26.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.06
E	建筑业	5,215,561.12	4.36
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,366,746.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,330,444.00	1.11
J	金融业	63,116,804.63	52.81
K	房地产业	3,185,280.15	2.65
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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	111,424,209.73	93.22
合计		111,424,209.73	93.22

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	-	-
C	制造业	1,033,547.98	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	81,226.14	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,196,333.97	0.99

3.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
(1)期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	269,201	16,711,214.58	13.14
2	000619	贵州茅台	12,226	8,942,086.60	7.48
3	600036	招商银行	263,197	6,604,264.28	5.40
4	601328	交通银行	629,698	4,919,662.94	4.03
5	601196	兴业银行	312,401	4,468,574.40	3.76
6	601288	农业银行	1,264,595	3,193,793.04	2.61
7	600226	上海银行	56,130	4,176,648.80	3.49
8	600887	伊利股份	146,700	4,148,733.00	3.47
9	600016	民生银行	589,063	4,129,741.00	3.46
10	600030	中信证券	198,937	3,296,380.09	2.76

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000486	国信证券	60,900	899,531.00	0.74
2	603099	绿色动力	2,012	129,546.60	0.11
3	601330	隆平高科	9,273	131,293.14	0.09
4	603903	江苏新能	5,384	49,466.00	0.04
5	603706	东方雨润	1,766	23,103.85	0.02

4、报告期末按债券品种和种类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-