客服电话:4000-466-788

联系电话:010-57418813 客服电话:400-893-6885

公司网址:www.gianjing.com

(87)北京展恒基金销售股份有限公司

条件服务电话: 4008188000 公司网址: www.myfund.com (88)深圳市金斧子基金销售有限公司

联系人:陈剑炜

法定代表人: 闫振杰

电话:010-59601366 传真:010-62020355

联系人:翟文

园B栋3单元11厚1108

电话:0755-29330513

传真:0755-26920530

法定代表人: 齐剑辉 电话: 4006236060

传真:010-82055860

法定代表人:黄欣 电话:021-33768132

法定代表人: 王兴吉

联系人:高雪超 联系电话:18601207732

传真:010-82057741

法定代表人:顾敏

泰和经济发展区)

电话:0755-89462447

传真:0755-86700688 联系人:罗曦 客户服务电话:400-999-8877

公司网址:www.webank.com

联系人: 蓝杰 电话: 021-65370077-220 传真: 021-55085991 客户服务电话: 021-65370077

电话:010-57649619

传真:010-57649620

法定代表人 - 吳雪秀

法定代表人:王锋 在定代表人:王锋 电话:025-66996699-887226 传真:025-66008800-887226

联系人:张慧 客户服务电话:95177

法定代表人, 知辈辈

电话:010-61840688 传真:010-61840699

联系人:吴季林

法定代表人:袁飞

传真:61621602 传真:61621602*819 联系人:袁振荣

法定代表人:王伟刚

电话:010-56251471

电话:0592-3122672

地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人:赵芯蕊

电话:010-62675768 传真:010-62676582

联系人:赵芯蕊

客户服务电话:61621602

公司网址:www.g-fund.com.cn (99)北京汇成基金销售有限公司

传真:010-62680827 联系人:熊小满 客户服务电话:400-619-9059

传真:0592-3122701 联系人:梁云波 客户服务电话:400-9180808

公司网址:www.xds.com.cn

客户服务电话: 010-62675369 公司网址: www.xincai.com (102) 天津国美基金销售有限公司

公司网址:www.hcjijin.com (100)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

由话:61621602

公司网址:www.snjijin.com

(97)北京蛋卷基金销售有限公司

客户服务电话: 4000618518 公司网址: https://danjuanapp.com (98) 上海景谷基金销售有限公司

电话:+86(10)88312877

传真:+86(10)88312877

联系人:徐越 客户服务电话:400-001-1566

公司网址:http://www.yilucaifu.com/ (96) 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

客户服务电话:010-57649619

公司网址:www.lanmao.c

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: 戴珉微

传真:021-33768132-802

客户服务电话:4006767523

联系人:刘昕霞 客户服务电话:400-930-0660

客户服务电话:400-623-6060

公司网址: www.niuniufund.com (90)上海中正达广基金销售有限公司 住所: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

公司网址:www.zhongzhengfund.com

容服电话:400888080 公司网址:www.qiandaojr.com (92)深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

(91) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司 办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室 住所:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

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 办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园

(93)上海基煜基金销售有限公司 住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海

晉// 施罗·巴尼·赵子·巴尔·松子 例址: www.jiyufund.com.cn (94) 北京聯節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

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

(37) 北京東西臺灣市市時間 住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

(56) 上海京台藝並用古月 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

住所:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108室

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

(101)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

办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C

住所:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层

公司网址:www.66zichan.com (86)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

住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

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

办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学

公司网址:www.jfzinv.com (89)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:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层

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 联系人:张旭 客户服务电话:400-810-5919 公司网址:www.fengfd.com (104)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:上海市浦东新区辅康路308号6号楼6楼 联系人:江辉 客户服务电话:400-820-1515 公司网址:www.zhengtongfunds.com (105)南京涂牛基金销售有限公司 (106) 南京逐年基金销售有限公司 注册地址: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 联系电话:025-86853969 客服申话:4007-999-999 公司网址:http://jr.tuniu.com (106)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号万得大厦11楼 法定代表人:王廷富 联系人:徐亚丹 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

(107)杭州科地瑞富基金销售有限公司 住所:杭州市下城区武林时代商务中心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:张丽琼 联系电话:0571-85262700 传真:0571-85269200 客服电话:0571-86915761 公司网址:www.cd121.com

法定代表人: 杨纪锋 联系人:吴鹏 电话:010-56075718 传直:010-67767615 客服电话:400-680-2123

网址:http://fund.jd.com/ 法定代表人:廖冰 联系电话:021-802348888-6694

法定代表人:钱昊旻

法定代表人:毛淮平

由注:010-88066632

法定代表人:李淑慧 联系人:罗聪

客户服务电话:0371-85518396

公司网址:www.hsqh.net (116)北京微动利基金销售有限公司

联系人: 仲秋玥

本基金分股票指数增强型基金,在被动跟踪标的指数的基础上,加 人增强型的积极手段,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 七、基金的投资范围 七、基金的好效和图本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括上证50指数成份股及具备选成份股新股、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

客户服务电话:400-128-6800

联系人: 谭广锋

法定代表人:陈宏

客服电话:95357

联系人:孙博超 电 话:010-61952703

构代理销售本基金,并及时公告。 (二)注册登记机构

法定代表人:杨皓鹏

申话:021-38429808

法定代表人:韩炯 电话:021-31358666

传真:021-31358600

执行事务合伙人:毛鞍宁

联系人:徐艳

联系电话:010-58153000 传真:010-58153000

经办会计师:徐艳、蔺育化 四、基金的名称

六、基金的投资目标

中海上证50指数增强型证券投资基金

总经理:杨皓鹏 成立日期:2004年3月18日

传真:021-3842-8008 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

经办律师:秦悦民、王利民 (四)审计基金财产的会计师事务所 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

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

名称:中海基金管理有限公司

联系人:付佳 联系电话:021-23586603

126)腾安基金销售(深圳)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(人驻深圳市

办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层 法定代表人:刘明军

客服电活:95017(拨通后转1再转8) 网站: www.tenganxinxi.com 或 www.txfund.com (127) 东方财富证券股份有限公司

住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

公司网址:http://www.18.cn (128)北京百度百盈基金销售有限公司 住所:北京市海淀区上地十街10号百度大厦

(如股指期货等),基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%,投资于上证50指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,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行金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资理念 采用增强型指数化投资的理念,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。 增长的市采的良好收益。 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, 在完全复制标的指数的基础上有限度地调整个股,从而最大限度降低由 于安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。但来喻于为实用有效限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、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。本基金将采用完 全复制为主,增强投资为辅的方式,按标的指数的成份股权重构建被动 主发则为主,自强权及分相的为土,技术的组织的成权量为建筑和自然组合,同时制以主动增强投资,对基金投资组合进行适当调整,力争本基金投资目标的实现。

本基金被对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,依据宏微观研究与个股研究,在上证50指 数中配置有正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股票库,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%,主要采用完全复制标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)主动增强投资 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 策略可能很难有效限除标的指数。因此、本基金将采用适度的主动性投资策略可能很难有效限除标的指数。因此、本基金将采用适度的主动性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导致的对标的指数限除的影响,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%。 编权交讯分子超过基金安广的10%。 1)在成份股内进行适度增强 本基金将在充分进行宏微观经济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

台書出版下号目下加上网种探电机成份放在19至1度的保度研究,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蕴含正超额收益预期的成份股。 2)对非成份股进行适度增强 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

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

为长期停膛、被列人本公司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,决定是否买人相 关的替代性股票。本基金将首选与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

b.前瞻性纳人部分备选成份股。如果预期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,决定是否提前纳人部分备选成份股。 而的海绵仙上,於足定百班則的人的力量也成功放。 C.賴透部分鑑含投资价值的非成份股。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,决定适度买人部分具有增长潜力、蕴含投资 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。

会、以水淀局页面运用效率。 3、债券投资策略 本基金将根据国际与国内宏微观经济形势、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, 同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的政 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 府债券进行配置。 4. 投资组合调整策略

(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、申购赎回变动情况、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优化。

(2)投资组合调整方法 ()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。 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。 当上证50指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重

调整时,本基金将根据上证50指数临时调整公告,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

投票。 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或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,并相应地对其他资产类别或个股进行 微调,以保证基金合法规范运行。 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讲

行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。十、基金的投资决策依据和决策程序

、投资决策依据:

(1) 国家有关法律、法规和本基金基金合同等的相关规定; (2) 宏微观经济运行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:投资决策委员会依 据研究部策略分析师和投资决策委员会成员讨论后形成的一致意见,决

婚时方品录配打的PP和12月代来安贝云风风内比后形成的一致意见,然 定大类资产配置的范围。 ●基金经理依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:中海上证的指数增强型证券投资基金基金经理根据其本人对宏微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

●投资操作性方案的制定: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

●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

、基金的投资限制

1. 本基金的投资组合将遵循以下限制: (1) 持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的

'。 (2)本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发 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 (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人权证的总金额,不超过上一交易日基 (4)本基金在任何交易日买入权证的品金额, 小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同一权证的比例不超过该权证的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50%。

30%。 (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,

客服电话:95055—4 公司网址:www.baiyingfund.com 基金管理人可根据 有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机 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)本基金财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

○ 里。 (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 等基金管理人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 住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及

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

约定的投资范围保持一致; (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

(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,基金投资不受上述限制。 适当程序后,基金投资不受上述限制。 除上述第(5)、(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的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 进行调整,以达到标准。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 合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基

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

(2)问他人员款或有提供担保。 (3)从事承担无限责任的投资。 (4)买卖其他基金份额,但法律法规另有规定的除外

金合同生效之日起开始

(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

(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

(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从

事的其他行为。 若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

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中证指数有限公司停止发布、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 基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的跟踪目标和投资对象, 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

十四、基金投资组合报告

基金管理人的董事会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 E整性承担个别及连带责任。 元整性承担个别及连带贡性。 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

本投资组合报告所载数据为截至2019年12月31日报告期末的四季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。 1、基金资产组合情况

不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

为1.505元。其资产组合情况如下:

1、基並與产組台南於 截至2019年12月31日,中海上证50指數增强型证券投资基金资产 净值为338,163,664.43元,基金份额净值为1.389元,累计基金份额净值

基金投资 资产支持证券 贵金属投资

2、期末按行业分类的股票投资组合 (1)指数投资按行业分类的股票投资组合 制造业 力、热力、燃气及水生产和供

租赁和商务服务 文化、体育和娱乐 (2)积极投资按行业分 |股票投资组 农、林、牧、渔业 、热力、燃气及7 和供应业

1,448,016.9 学研究和技术服务 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

期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 五名股票投资明细

股票代码

3	300059	东方财富		881,960	13,908,509.20		4.11
4	600958	东方证券		862,715	9,282,813.40		2.75
5	688188	柏楚电子		7,323	1,113,755.07		0.33
4、报	告期末按债券	品	钟分类	的债券投资	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	1		7,804,117.80		5.26	
2	央行票据		-			-	
3	金融债券		-			-	
	其中:政策性金融修	ě		-			-
4	企业债券		-			-	
5	企业短期融资券		-			-	
6	中期票据		-			ı	
7	可转债(可交换债)		-			-	
8	同业存单		-			-	
9	其他		-			-	
10	会计		17 804 11780			5.26	

5, 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资

本基金本报告期末未持有贵金属 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵

木基全木报告期末未持有权证.

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 (1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。 (2)本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定, 本基金不参与股指期货交易, 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (1)本期国债期货投资政策 根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。 (2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。 (3)本期国债期货投资评价 根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易,

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰证券股份 有限公司受到处罚外,其他发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2019年8月23日,华泰证券因在代销资管产品过程中,存在使用未经报备的宣传推介材料的情形,受到地方证监局责令改正的行政监管措

本基金投资该上市公司的决策流程符合本基金管理人投资管理制 度的相关规定。本基金管理人的投研团队对该上市公司进行了及时分析和跟踪研究,认为上述事件对以上公司投资价值未产生实质性影响。 (2)报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选

~~~~		1.46 6 60 40 60 60 60 60 60 60 60 60 60 60 60 60 60
(3) 截.	止2019年12月31日,	本基金的其他各项资产构成如下:
序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	36,757.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	381,037.88
5	应收申购款	1,450,167.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	甘仲	

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券 (5) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

(6)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明 股票化码 股票名称 流通受限部分的 占基金资产净 企通受限情况 位比例(%) 流通受限情况 688188 柏楚电子 1,113,765.07 0.33 新股流通3 (7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾 十五、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 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(截止

日期2019年12月31日

阶段 净值增长 率① 伊恒增长率 标准差② 1.54% 1.40% 1.22% -17.15% 1.22% 2.45% 1.15% 1.25% -5.09% 1.21% 0.67% 0.66% 3.46% 1.29% 1.30% 1.14% 1.41%

基金的过往业绩并不预示其未来表现

十六,基金的费用与税收 一)基金费用的种类 1、基金管理人的管理费。

2、基金托管人的托管费。 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

3、《基金日间》主从后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。 5、基金份额持有人大会费用。 6、基金的证券交易费用。 7、基金的银行汇划费用。

8、基金的指数使用费 、按照法律法规有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.85%年费率计提。管理

H=E×0.85%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值

4.78印一口30毫级以广伊區 基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理 人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2个工作日内从其全财产中一次性支付给其全管理人 若遇法定节假日 公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.17%的年费率计提。托 管费的计算方法如下: H=E×0.17%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理 人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支

付日期顺延。 3、基金的指数使用费 本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署 的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提,且 收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5万元。该下限超出7

常指数使用基点费的部分(即:每季指数许可使用基点费下限 – 该季指 数许可使用基点费)由基金管理人自行承担,不得作为基金费用从基金 财产中列支。计算方法如下: H=E×0.016%/当年天数 H 为每日计提的指数使用费 E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算。该日累计 指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基 金托管人复核后干次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中 上述一、基金费用的种类中第3-8项费用,根据有关法规及相应协 议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产

中支付。 三)不列入基金费用的项目

(二)//97/X基金费用:59/日 下列费用不列入基金费用: 1、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。
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和 律师费、信息披露费用等费用。 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金

(四)费用调整 基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基

基並已经入州基並化巨人炒的一致用,可能跨越並及於同仍剛量基金管理费率,基金托管费率、基金托管费率等相关费率。 调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人 大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》在指定媒

(五)基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、对招募说明书更新部分的说明 (一)在"重要提示"部分,对相关内容进行补充。

(二)在"绪言"部分,对相关法律法规的名称进行了更新。 (三)在"释义"部分,对相关释义进行了补充和更新。 (四)在"基金管理人"部分,对"基金管理人的职责"的相关内容 进行了更新。 (五)在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回场所"

(五)代 基本订额的甲炔科赎回 部方,对 平炒与赎回物所、"申购与赎回的开放日及时间"、"申购与赎回的原则""申购与赎回的数额限制"、"申购费用和赎回费用"、"申购和赎回的注册登记"、"拒绝或暂停申购的情形及处理方式"、"暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式"、"暂停财回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式"、"暂停申购或赎 回的公告和重新开放申购或赎回的公告"的相关内容进行了更新。 (六)在"基金的收益与分配"部分,对"基金收益分配方案的确定、公告与实施"的相关内容进行了更新。

ムロコメル  $^{107H7K/146 <math>\pm 0.11}$  ] 史  40  。 (七)  40  在"基金的 费用与 税  40  で  40  が  40 (八)在"基金的会计与审计"部分,对"基金的年度审计"的相关

内容进行了更新。 (九)在"基金的信息披露"部分,对"信息披露义务人"、"本基金

(九)在"基金的信息披露 部分,对"信息披露义务人、"本基金 信息披露义务人信息披露承诺"、"本基金公开披露的信息应采用中文 文本"、"信息披露的种类、披露时间和披露形式"、"信息披露事务管 理"、"信息披露文件的存放与查阅"的相关内容进行了更新。 在"基金合同的变更、终止与基金财产的清算"部分,对"基金合同 的变更"、"基金财产的清算"的相关内容进行了更新。 (十)在"基金合同的内容摘要"部分,根据最新的《中海上证50指

数增强型证券投资基金基金合同)进行了更新。 (十一)在"基金托管协议的内容摘要"部分,根据最新的《中海上证50指数增强型证券投资基金托管协议》进行了更新。

(十二)在"其他应披露的事项"中,披露了本期间本基金的公告信

中海基金管理有限公司

本基金本报告期末未持有资产支持证券

住所、深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(人驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区 11栋A座3608室 法定代表人:杨艳平 联系人:胡闻智

法定代表人:丁东华 电话:010-59287984 传真:010-59287825 联系人:郭宝亭 客服电话:400-111-0889 公司网址:www.gomefund.com (103)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湾中央商务区万寿路142

办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

(108)北京植信基金销售有限公司 住所:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67 办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

開始:www.zhixin-Inv.com (109)北京肯特福基金销售有限公司 住所:北京市海淀区中关村东路66号1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

法定代表人:江卉 联系人:赵德赛 电话:4000988511/ 4000888816

传真:010-89188000 客服电话:95118 (110)上海朝阳永续基金销售有限公司 住所:浦东新区上丰路977号1幢B座812室 办公地址:上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼

传真:021-80234898 客服电话:4006991888 公司网址:www.998fund.com 

联系人:徐英 电话:010-59336539 传真:010-59336500 客服电话:4008-909-998 (112)上海华夏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:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

传真:010-63136184 客服电话:400-817-5666 (113) 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(-期)第七幢23层1号4号

か公地は、湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城 -期)第七幢23层1号4号 法定代表人:陶捷 联系人:陆锋 客户服务电话:4000279899 公司网址:www.buyfunds.cn (114)和耕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

公司网址:www.hgccpb.com (115)徽商期货有限责任公司 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:4008878707

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 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:季长军 客户服务电话:400-819-6665 公司网址:www.buyforyou.com.cn ( 117 ) 成都华羿恒信基金销售有限公司

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 法定代表人:赵壁 NGSCA (1878) 会戸服务电话: 400-8010-009 公司网址: http://www.huayibengxin.com (118)上海挖财基金销售有限公司 住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

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

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、 法定代表人:冷飞 联系人:李娟 联系电话:021-50810687 客服电话:021-50810673 公司网址: www.wacaijijin.com (119)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

法定代表人:申健 联系人:宋楠 联系电话:021-20219988 客服电话:021-20292031 网班:https://www.wg.com.cn/ (120) 北京加利基金销售有限公司 注册地址:北京市西城区华公庄大街 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

法定代表人:徐福星 联系人:李美 联系八:学美 电话:010-68292940 传真:010-68292964 客户服务电话:400-600-0030 网址:www.bzfunds.com (121)北京晟视天下基金销售有限公司 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层 法定代表人: 蒋煜 联系人: 刘聪慧/徐晓荣 电话: 010-58170905/010-58170876 传真: 010-58100800 | 1545:110-88100800 | 客户服务电话:400-818-8866 | 网址:www.shengshiview.com.cn | (122)北京格上富信基金销售有限公司

法定代表人:程刚

联系人:赵立芳 客户服务电话:400-100-3391

か公地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 联系人:曹庆展 客户服务电话:400-066-8586 公司网址:www.igesafe.com (123)北京电盈基金销售有限公司 住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室 办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603

住所:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

公司网址: http://www.dianyingfund.com/ (124)万家财富基金销售(天津)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 か公地址: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:李修辞 联系人:邵玉磊 客户服务电话:010-59013825 公司网址:http://www.wanjiawealth.com/ ( 125 )深圳前海财厚基金销售有限公司

> ●基金事务部清算:基金事务部负责基金的清算。 绩效评估与眼院误差控制:金融工程部定期对本基金进行绩效评估和眼踪误差计算,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。