

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

2016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”）经中国证监会2004年11月22日证监基金字[2004]1196号文批准募集。本基金合同于2004年12月30日正式生效。基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，编制了本招募说明书。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。投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、本基金的特定风险等。本基金为主动管理型基金，风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为主动管理型基金，采用完全复制策略，跟踪上证50指数，是股票基金中风险较高、收益较高的品种。投资者申购基金时，应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本摘要根据本基金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。基金投资者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本基金合同的承认和接受，并受《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定的约束享有权利、承担义务。基金投资者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2016年6月30日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2016年3月31日。本招募说明书中的财务资料未经审计。

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：杨明辉
联系人：张静
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元，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	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海融科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
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
杨明辉先生：董事，党委书记，中信证券股份有限公司执行董事、总经理，硕士，高级经济师。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副经理，中国建设银行证券有限责任公司党委书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事。

张军先生：董事，硕士。现任德太太平有限公司总裁，负责总部加拿大德太公司在中国的投融资活动，兼任三能能源开发有限公司董事、中国投资公司常务董事。曾任国际货币基金组织（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中国区主席、合伙人、董事总经理。徐金锁先生：董事，博士。现任中信证券（山东）有限责任公司、中信期货有限公司、前海股权交易中心（深圳）有限公司、青岛蓝海股权交易中心有限责任公司、厦门两岸股权交易中心有限公司董事。

葛小波先生：董事，硕士，中信证券党委委员、董事总经理。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓东先生：董事，总经理，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建银（香港）有限公司、华夏幸福基金、中海油海洋工程、东兴证券、中兴通讯等上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工业品进出口公司、美国纽约国际金融有限公司（外派工作）、曾担任中国银行信托咨询公司副处处长、处长，中国银行广东佛山分行副经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室主任、上市公司总经理助理，中银基金资产管理部副经理。

胡德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任中国人寿保险股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事常务理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

张霄岭先生：独立董事，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授，曾在中国技术进出口总公司副总经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模拟风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员，兼任华夏资产管理有限责任公司执行董事、总经理。曾任中国人民银行总行计划资金司副科长、科长、主任科员，中国农业银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监等。

阳琨先生：副总经理，投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部副经理，宝盈基金管理有限公司基金管理部助理，益民基金管理有限公司基金管理部经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副经理等。

李一梅女士：副总经理，硕士。兼任上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理，证通股份有限公司董事。曾任基金营销部副经理、营销总监、市场总监等。

周璇女士：副董事长，硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司助理助理；曾任中国证监会北京、北京金融街证券开发公司。

李红源先生：监事，高级会计师。现任南方工业资产管理有限责任公司董事、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、工业经济部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

闫莉先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动综合计划局与工司部副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源部管理部助理总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东渤海湾控股股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室主任科员、济南高速公路管理局长助理兼财务处主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部副经理，山东高速集团财务处主任科员、党办副主任。

汪泽华女士：监事，博士。现任华夏基金管理有限公司董事总经理。曾任财政部科研所助理研究员，中关村证券股份有限公司计划资金部总经理，华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司合规部总监。曾任中信证券股份有限公司资产管理部副经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总监、华夏基金管理有限公司法律合规部副经理。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室主管、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国人民大学讲师。

2.本基金基金经理
芳晖先生，硕士。1998年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴证证券投资基金基金经理助理、华国国际证券投资基金基金经理助理、数量投资部副经理等。现任数量投资部总监、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8日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）、华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年6月17日起任职）、华夏中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年6月5日起任职）、华夏中500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年6月5日起任职）。

3.本公司量化投资决策委员会
主任：王路先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。
张庆先生，华夏基金管理有限公司数量投资部董事总经理、基金经理。
方军先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监、基金经理。
杨志诚先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监。

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（简称“中国工商银行”）
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1985年10月31日
法定代表人：姜念海
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：洪婧

截至2016年3月31日，中国工商银行资产托管部共有员工198人，平均年龄30岁，96%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。

（二）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，获得优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、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、企业年金基金、QDII资产、股权投资基金、证券类集合资产管理计划、证券投资基金资产管理、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跨境托管，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2016年3月，中国工商银行托管证券投资基金达5655只。自2003年以来，中国工商银行连续一年获得香港《证券期货》、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》等海内外权威媒体评选的“四项最佳托管银行”大奖，并获得多项最高等级的托管银行奖，良好的服务品质获得国内外金融领域的广泛认可和好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构
1.申购赎回代理机构（简称“一级交易商”）
（1）国泰君安证券股份有限公司
住所：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号上海国金大厦29层
法定代表人：龚兵
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：洪婧
网址：www.gtja.com
客户服务电话：96521
（2）北京城市朝阳区安立路604号4号楼
办公地址：北京市朝阳区广内大街188号
法定代表人：王常营
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.61812261.com
传真：021-38670161
联系人：芮敬楠
网址：www.guotai.com
客户服务电话：96521
（3）国信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133801
联系人：黄伟
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：96536
（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：李劲松
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）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区河北路133-137号广发会堂4楼（4301-4316）
办公地址：广州天河区河北路133-137号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
电话：020-87558888
传真：020-87556147
联系人：黄岗
网址：www.gf.com.cn
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
（6）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010-60837722
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.csc.com.cn
客户服务电话：95548
（7）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2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
电话：010-66568400
传真：010-66568900

联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn
客户服务电话：400-888-8888
（8）海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路950号
办公地址：上海市浦东新区广东路689号10楼
法定代表人：王浩
电话：021-23211000
传真：021-63410366
联系人：李美蓉
网址：www.htsec.com
客户服务电话：95553,400-888-8001
（9）申万宏源证券有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1688号11层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1688号11层
法定代表人：李梅
客户服务电话：400-800-0562
传真：010-89065699
联系人：钱文琛
网址：www.hysec.com
（10）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄五道口广场1号楼21层
电话：021-68767889
传真：021-38567875
联系人：谢海霞
网址：www.xyzq.com.cn
客户服务电话：95562
（11）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：杨泽发
电话：027-68757889
传真：027-85481900
联系人：李良
网址：www.95579.com
客户服务电话：95579,400-988-8899
（12）安信证券股份有限公司
住所：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：牛冠兴
电话：0755-82565305
传真：0755-82568535
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn
客户服务电话：400-890-1001
（13）湘财证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号湘南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号湘南城商务中心A栋11楼
法定代表人：林凌波
电话：021-6884510-8620
传真：021-68865880
联系人：赵小明
网址：www.xsec.com.cn
客户服务电话：400-888-1561
（14）国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：蔡鹤
电话：0651-62257012
传真：0651-62272100
联系人：祁明辉
网址：www.gyzq.com.cn
客户服务电话：95578
（15）渤海证券股份有限公司
住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市开发区第二大街42号
法定代表人：王春峰
电话：022-28451991
传真：022-28451892
联系人：秦馨
网址：www.bhsc.com.cn
客户服务电话：400-651-5888
（16）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：深圳市福田区益田路4011号广电国际大厦24楼
法定代表人：吴万善
电话：0755-82421313
传真：0755-82492962（深圳）
联系人：庞晓涛
网址：www.htsec.com
客户服务电话：95567
（17）中信证券（山东）有限责任公司
住所：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
电话：0632-85022268
传真：0632-85022006
联系人：吴忠超
网址：www.citicscsd.com
客户服务电话：95549
（18）东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
办公地址：苏州工业园区阳澄湖5号
法定代表人：范力
电话：0512-68611136
传真：0512-65688021
联系人：方晓丹
网址：www.dwzq.com.cn
客户服务电话：0512-62862928
（19）国联证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
电话：010-63201000
传真：010-63803978
联系人：唐静
网址：www.cindas.com
客户服务电话：95521
（20）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路131号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址：上海市中山南路131号2号楼21层、22层、25层-29层
法定代表人：潘鑫军
电话：021-63328888
传真：021-63326729
联系人：胡娟娟
网址：www.dfzq.com.cn
客户服务电话：95503
（21）方正证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华国际大厦22-24层
法定代表人：雷波
电话：0731-85832503
传真：0731-85832214
联系人：邓菲
网址：www.founder.com.cn
客户服务电话：95571
（22）长城证券股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：深圳市福田区深南大道7008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄健华
电话：0755-83616089
传真：0755-83615667
联系人：李春芳
网址：www.ccsc.com.cn
客户服务电话：400-666-8888,0755-33680000
（23）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：薛峰
电话：021-22169031
传真：021-22169184
联系人：刘晨
网址：www.ebscn.com
客户服务电话：95525,400-888-8788
（24）南京证券股份有限公司
住所：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：步国
客户服务电话：400-828-8888
电话：025-83364032
联系人：石健
网址：www.njzq.com.cn
（25）上海证券有限责任公司
住所：上海市四川中路336号
办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：龚德柏
电话：021-51538888
传真：021-62217206
联系人：张祺
网址：www.962518.com
客户服务电话：400-891-8918
（26）新时代证券股份有限公司
住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：何如
电话：010-83511449
传真：010-83561094
联系人：孙怡
网址：www.xsdzq.com.cn
客户服务电话：400-698-9898
（27）国联证券股份有限公司
住所：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人：姚志勇
电话：0610-82831662
传真：0610-82830162
联系人：徐敏
网址：www.gls.com.cn
客户服务电话：95570
（28）浙商证券股份有限公司
住所：浙江省杭州市机大一路1号黄龙世纪广场A6-7
办公地址：浙江杭州市机大一路1号黄龙世纪广场A6-7
法定代表人：吴承根
电话：0571-87901053
传真：0571-87901913
联系人：胡桐桐
网址：www.zsczq.com.cn
客户服务电话：95345
（29）平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田区中心区金田路4036号平安大厦16-20层
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号平安大厦16-20层
法定代表人：谢永林
电话：021-38631171
传真：021-33830395
联系人：石静文
网址：www.pingan.com
客户服务电话：95511-8
（30）国海证券股份有限公司
住所：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：何春梅
电话：0755-83709350
传真：0755-83704850
联系人：牛孟宇
网址：www.guohai.com.cn
客户服务电话：95543
（31）中原证券股份有限公司
住所：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
电话：0371-69098822
传真：0371-65568899

联系人：程月艳、范春艳
网址：www.cneweb.com
客户服务电话：95377
（32）国都证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦10层、10层
办公地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：李宏
电话：010-84183389
传真：010-61410366
联系人：李英男
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118
（33）东海证券股份有限公司
住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：李刚
电话：021-20333333
传真：021-60498825
联系人：王一彦
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：95531,400-888-8588
（34）华西证券股份有限公司
住所：四川省成都市高新区天府二街198号
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人：杨炯洋
电话：010-52723273
传真：028-86150040
联系人：谢刚梅
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：400-888-8818
（35）中泰证券股份有限公司
住所：山东济南经七路86号
办公地址：山东济南市中区经七路86号
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889185
联系人：吴阳
网址：www.ztc.com.cn
客户服务电话：95538
（36）第一创业证券股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
电话：0755-25831754
传真：0755-23838750
联系人：毛诗莉
网址：www.firstcapital.com.cn
客户服务电话：400-888-1888
（37）德邦证券股份有限公司
住所：上海市普陀区曹杨路510号南幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心20楼
法定代表人：姚文平
电话：021-68761616-8076
传真：021-68767032
联系人：程维
网址：www.tebon.com.cn
客户服务电话：400-888-8128
（38）中国国际金融股份有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65058005
联系人：孙春霞、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166
（39）华泰证券（上海）有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人：李晖
电话：021-68767032
传真：021-54967293
联系人：王迪
网址：www.htfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999,029-68918888,400-109-9918
（40）中国银河证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路5003号银河大厦39层A座18层及第04层
办公地址：深圳市福田区益田路5003号银河大厦39层A座18层及第04层
法定代表人：李涛
电话：0755-82022442
传真：0755-82026339
联系人：刘璇
网址：www.china-invsc.com
客户服务电话：400-400-8008,95532
（41）西藏同信证券有限责任公司
住所：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市永灵路118弄东方企业园24号
法定代表人：贾绍贵
电话：021-36533016
传真：021-36533017
联系人：王伟伟
网址：www.xtzsc.com
客户服务电话：400-881-1177
（42）中国民族证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦6层-9层
法定代表人：赵大勇
电话：010-58365941
传真：010-58365391
联系人：李薇
网址：www.5618.com
客户服务电话：400-088-5618
（43）华龙证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人：陈林
电话：021-50122128
传真：021-50122398
联系人：徐奔芳
网址：www.cnhbstock.com
客户服务电话：400-820-9888
2、二级市场交易代理券商
包括具有证券经纪业务资格且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
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：陈文祥
联系电话：021-69419096
网址：021-68870311
（三）律师事务所
名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座二、三层
办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座二、三层
负责人：王丽
联系电话：010-52692988
传真：010-52692909
联系人：李娜
经办律师：李志宏、李娜
（四）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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼
办公地址：上海市静安区南京西路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：朱建群、赵晋
经办注册会计师：曹建群、洪磊

四、基金名称
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。

本基金的投资方向：主要投资于标的指数的成份股、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本基金投资的金融衍生品。

本基金主要采取完全复制法，即完全复制标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的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。

（一）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投资依据。

（二）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准确执行，避免重大风险的发生。

1.研究：基金经理小组、研究员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、误读及其影响评估等，并形成研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

2.投资决策：基金经理小组、研究员根据研究报告，定期召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理小组根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理日常决策。

3.组合构建：根据标的指数、组合投资策略，基金经理小组以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理小组将采取适当的方法，以降低买入成本、控制跟踪误差。

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：风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估报告经确认后作为投资决策、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理小组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：基金经理小组跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购赎回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。

基金管理人将在确保基金份额持有人利益的前提下，灵活运用股指期货等金融衍生品进行上述投资组合的构建，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
本基金业绩比较基准为上证50指数。

如上证50指数停牌或发生暂停上市、或上证50指数或其指数数据失真、或上证50指数权重发生重大变更导致上证50指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他更具代表性、更适合作为标的指数时，本基金管理人可以依据相关法律法规的原则，变更本基金的业绩比较基准。

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，跟踪误差较小，属于收益中等的品种。

十一、基金投资组合报告
以下内容为自本基金2016年第1季度报告：
“6.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	27,484,002,306.31	98.22
	其中：股票	27,484,002,306.31	98.22
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	86,114,565.78	1.77
7	其他各项资产	3,947,022.11	0.01
8	合计	27,982,963,900.20	100.00

注：股票投资中的公允价值包含可替代资产估值增值。
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	81,831,507	2,603,060,237.67	9.31
2	600016	民生银行	223,421,271	2,056,367,778.81	7.28
3	601166	兴业银行	100,227,929	1,556,539,737.37	5.57
4	600036	招商银行	177,557,916	1,247,906,868.44	4.46
5	600000	浦发银行	69,452,223	1,245,278,358.39	4.45
6	600030	中信证券	59,157,963	1,053,009,961.40	3.77
7	601328	交通银行	177,691,740	989,742,991.80	3.54
8	600519	贵州茅台			