

天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）

摘要

天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金
招募说明书（更新）摘要

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

日期：二〇一七年八月

重要提示

天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金（以下简称本基金）于 2015 年 6 月 17 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2015】1278 号）。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会接受本基金募集注册的备案，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于 2015 年 7 月 16 日正式生效。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。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。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，由投资者自行负责。本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金并非保本基金，基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投

投资者注意基金投资的买者自负原则，在做出投资决策后，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。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。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。基金招募说明书自基金合同生效之日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告。本招募说明书所载内容截止日为2017年7月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层成立日期：2004年11月8日法定代表人：井贤栋联系电话：（022）83310208组织形式：有限责任公司注册资本及股权结构：天弘基金管理有限公司（以下简称公司或本公司）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164号），于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元，股权结构为：

股东名称 股权比例

浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司 51%

天津信托有限责任公司 16.8%

内蒙古君正能源化工集团股份有限公司 15.6%

芜湖高新投资有限公司 5.6%

新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙） 3.5%

新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙） 2%

新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙） 2%

新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙） 3.5%

合计 100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴（中国）信息技术有限公司财务副总裁、支付宝（中国）网络技术有限公司首席财务官，浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司首席运营官，现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司CEO。卢信群先生，副董事长，硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书，北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司董事长、总经理，君正国际投资（北京）有限公司董事，河北大安制药有限公司董事。黄浩先生，董事，大学本科。历任中国建设银行总行计财部副处长，处长，部门副总经理、中德住房储蓄银行行长、中国建设银行总行网络金融部总经理。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司副总裁。屠剑威先生，董事，硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行（中国）有限公司合规部助理总裁、永亨银行（中国）有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司法务及合规部高级研究员。付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公

司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部总经理。郭树强先生，董事，总经理，硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理。魏新顺先生，独立董事，大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长，天津市政府法制办经济法规处处长，天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。张军先生，独立董事，博士。现任复旦大学经济学院院长，中国经济研究中心主任。贺强先生，独立董事，本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生，监事会主席，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。张杰先生，监事，注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，内蒙古中鑫能源有限公司董事，内蒙古坤德物流股份有限公司监事。方隽先生，监事，硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经理、福建立信闽都会计师事务所副主任会计师、立信会计师事务所厦门分所副主任会计师。现任芜湖高新投资有限公司总经理。韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、天弘基金市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理，现任本公司互联网金融业务部总经理。付颖女士，监事，硕士研究生。历任天弘基金监察稽核部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司监察稽核部总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。陈钢先生，副总经理，硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监，分管公司固定收益投资业务。周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司电子商务及产品业务。熊军先生，副总经理，财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员，国家国有资产管理局主任科员、副处长，财政部干部教育中心副处长，全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司，任命为公司首席经济学家，现任公司副总经理，分管智能投资部及养老金业务。童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管，本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

张子法先生，北京大学硕士学位，15年证券从业经验。历任建设银行聊城市分行任金融软件项目科员，北京中联集团金融软件项目经理，上海华腾软件系统公司金融项目经理，华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟天弘，历任高级数据工程师、基金经理助理，现任天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证100指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金经理。历任基金经理：

刘冬先生，任职期间：2015年7月17日至2017年4月17日。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、固定收益总监，基金经理。熊军先生，本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。邓强先生，首席风控官。肖志刚先生，股票投资总监，基金经理。黄颖女士，研究总监。王登峰先生，固定收益部总经理，基金经理。钱文成先生，基金经理。刘冬先生，基金经理。陈国光先生，基金经理。姜晓丽女士，基金经理。王林先生，基金经理。上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室办公地址：广州市天河区天河北路183-187号大都会广场5楼、7楼、8楼、18楼、19楼、38楼、39楼、40楼、41楼、42楼、43楼和44楼法定代表人：孙树明成立时间：1994年1月21日基金托管资格批文及文号：证监许可

【2014】510号注册资本：人民币7,621,087,664元存续期间：长期联系人：崔瑞娟联系电话：020-87555888广发证券成立于1991年，是国内首批综合类证券公司，先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：

000776.SZ，1776.HK）。截至2016年12月31日，公司共有证券营业部264家，分布于中国大陆31个省、直辖市、自治区。广发证券总资产、净资产、净资本、营业收入和净利润等多项主要经营指标从1994年起连续多年位居十大券商行列。截至2016年12月31日，集团总资产3,598.01亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为785.30亿元，2016年营业收入为207.12亿元，营业利润为105.26亿元，归属于上市公司股东的净利润为80.30亿元。资本实力及盈利能力在国内证券行业持续领先，总市值居国内上市证券公司前列。2、主要人员情况刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士，并于2003年7月获得北京大学经济学硕士学位。广发证券托管部员工均具备基金从业资格，主要人员均具备多年基金、证

券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上，专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域，是一支诚实勤勉、积极进取的专业团队。3、基金托管业务经营情况广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至2016年12月底，广发证券已托管16只公开募集证券投资基金，包括宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

1、直销机构：

(1) 天弘基金管理有限公司直销中心住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层法定代表人：井贤栋电话：(022) 83865560 传真：(022) 83865563 联系人：司媛客服电话：400-710-9999（免长途话费）(2) 天弘基金管理有限公司网上直销平台办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层电话：(010) 83571739 传真：(010) 83571840 联系人：许丛立网址：www.thfund.com.cn (3) 天弘基金管理有限公司北京分公司办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层电话：(010) 83571789 传真：(010) 83571900 联系人：申向阳 (4) 天弘基金管理有限公司上海分公司办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号30层E-F单元电话：(021) 50128808 传真：(021) 50128801 联系人：涂远宏 (5) 天弘基金管理有限公司广州分公司办公地址：广州市天河区珠江东路6号广州周大福金融中心16层05室电话：(020) 38927920 传真：(020) 38927985 联系人：袁宇鹏

2、其他销售机构：

(1) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F法定代表人：陈柏青电话：0571-26888888 联系人：韩爱彬联系人邮箱：aibin.hab@alipay.com 客户服务热线：400-0766-123 网站：www.fund123.cn (2) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号37244办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801法定代表人：汪静波联系电话：15221808925 联系人：李娟传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com (3) 北京乐融多源投资咨询有限公司注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室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座裙楼二层法定代表人：董浩电话：18513699505 联系人：陈铭洲客户服务热线：400-068-1176 网址：www.jimu.com (4) 中经北证(北京)资产管理有限公司注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1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：徐福星电话：13466390404 联系人：陶涛客户服务热线：4006000030 网址：www.bzfunds.com (5) 北京

京东金融科技控股有限公司注册地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 221 室办公地址：北京市北京经济技术开发区科创十一街 18 号 C 座 2 层 222 室法定代表人：刘强东联系人：万荣电话：18910325400 客服：400-088-8816 网址：jr.jd.com (6) 奕丰金融服务(深圳)有限公司注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室法定代表人：TANYIKKUAN 联系人：叶健电话：13424264100 客服：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn (7) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公地址：朝阳区来广营中街甲 1 号朝来高科技产业园 5 号楼法定代表人：程刚联系人：张旭电话：18500185071400-810-5919 客服：400-810-5919 网址：www.fengfd.com (8) 乾道金融信息服务(北京)有限公司注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室法定代表人：王兴吉联系人：刘金佩电话：15901073209 客服：400-088-8080 网址：www.qiandaojr.com (9) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青电话：0571-26888888 联系人：韩爱彬联系人邮箱：aibin.hab@alipay.com 客服：400-0766-123 网站：www.fund123.cn (10) 深圳众禄基金销售有限公司注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元法定代表人：薛峰电话：0755-33227950 传真：0755-82080798 联系人：童彩平联系人邮箱：tongcp@jjmmw.com 客服：400-6788-887 网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com (11) 上海天天基金销售有限公司注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼办公地址：北京市朝阳区光华路四号东方梅地亚 C 座 901 电话：186-1170-5311 联系人：丁姗姗联系人邮箱：shenshuo@eastmoney.com 客服：400-181-8188 网址：www.1234567.com.cn (12) 和讯信息科技有限公司注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层法定代表人：王莉联系人：刘洋电话：13911828608 客服电话：400-920-0022 网址：www.licaike.com (13) 浙江同花顺基金销售有限公司注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号 2 楼法定代表人：凌顺平联系人：刘晓倩电话：13116765372 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com (14) 珠海盈米财富管理有限公司注册地址：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：肖雯联系电话：13430246009 联系人：曾健灿客服：020-89629066 网址：www.yingmi.cn (15) 深圳富济财富管理有限公司注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室法人代表：齐小贺联系人：黄晶龙联系电话：0755-83999907-806 客服电话：0755-83999907 网址：www.jinqianwo.cn (16) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心 A 座 5 层法定代表人：彭运年联系人：孙雯电话：010-59336519 客服：010-59336512 网址：www.jnlc.com (17) 上海好买基金销售有限公司注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼法定代表人：杨文斌联系人：陆敏电话：13916988520 客服：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com (18) 上海陆金所资产管理有限公司注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼法定代表人：郭坚联系人：程晨电话：15921301165 客服：4008-6666-18 网址：www.lufunds.com (19) 上海长量基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市浦东新区高

翔路 526 号 2 幢 220 室办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层法定代表人：张跃伟联系人：苗明电话：021-20691923 客服：400-820-2899 网址：www.erichfund.com (20) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层法定代表人：杨懿联系人：文雯电话：18502354557 客服：400-166-1188 网址：8.jrj.com.cn (21) 上海中正达广投资管理有限公司注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室法定代表人：黄欣联系人：戴珉微电话：13774232592 客服：400-6767-523 网址：www.zzwealth.cn (22) 北京蛋卷基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 319 层法定代表人：钟斐斐联系人：侯芳芳电话：15910450297 客服：4000-618-518 网址：www.ncfjj.com (23) 泰信财富投资管理有限公司注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间办公地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间法定代表人：李静联系人：刘春霞电话：13522530189 客服：400-881-5596 网址：www.taixincf.com (24) 上海利得基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼法定代表人：沈继伟联系人：徐鹏电话：18601735759 客服：400-067-6266 网址：www.leadbank.com.cn (25) 北京广源达信投资管理有限公司注册地址：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 层法定代表人：齐剑辉联系人：王永霞电话：15201586214 客服：400-623-6060 网址：www.niuniufund.com (26) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 37244 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 法定代表人：汪静波电话：15801816961 联系人：张裕传真：021-38509777 客服：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com (27) 北京虹点基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室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 座裙楼二层法定代表人：胡伟电话：18513699505 联系人：陈铭洲客服：400-068-1176 网址：www.jimu.com (28) 北京钱景财富投资管理有限公司注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号丹棱 soho1008-1012 法定代表人：赵荣春电话：18501250851 联系人：陈剑炜客服：400-893-6885 网站：www.dyxtw.com (29) 中经北证（北京）资产管理有限公司注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 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：徐福星电话：13466390404 联系人：陶涛客服：4006000030 网址：www.bzfunds.com (30) 上海汇付金融服务有限公司注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼办公地址：上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼法定代表人：冯修敏电话：021-54677088*6732 联系人：陈云卉客服：400-821-3999 网址：www.chinapnr.com (31) 浙江金观诚财富管理有限公司注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室办公地址：浙江省杭州市登云路 43 号金诚集团 10 楼法定代表人：徐黎云电话：0571-88337717 联系人：孙成岩客服：400-068-0058 网址：www.jincheng-fund.com (32) 北京新浪仓石基金销售有限公司注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室办公地址：北京海淀区中关村海淀北 2 街 10 号泰鹏大厦 12 楼法定代表人：张琪电话：18501046366 联系人：付文红客服：010-62675369 网址：www.xincai.com (33) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司注册地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A 办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A 法定代表人：高锋联系人：廖苑兰电话：0755-83655588-605 客服：400-804-8688 网址：

www.foreseakeynes.com (34) 上海万得投资顾问有限公司注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼法定代表人: 王廷富联系人: 徐亚丹电话: 021-68882280 客服: 400-820-9463 网址:

www.wind.com.cn (35) 众升财富(北京)基金销售有限公司注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08 法定代表人: 李招弟联系人: 李艳电话: 13611256407 客服: 400-059-8888 (36) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司注册地址: 北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层221室办公地址: 北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层222室法定代表人: 刘强东联系人: 万荣电话: 18910325400 客服: 400-088-8816 网址: jr.jd.com, www.wy-fund.com (37) 北京汇成基金销售有限公司注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号法定代表人: 王伟刚联系人: 丁向坤电话: 18001102931 客服: 400-068-1176 网址: www.fundzone.cn (38) 奕丰金融服务(深圳)有限公司注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室及1307室法定代表人: TANYIKKUAN 联系人: 叶健电话: 13424264100 客服: 400-684-0500 网址:

www.ifastps.com.cn (39) 北京创金启富投资管理有限公司注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A办公地址: 中国北京西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712号法定代表人: 梁蓉联系人: 李婷婷电话: 18600948425 客服: 400-6262-818 网址: www.5irich.com (40) 北京格上理财顾问有限公司注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内03室办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内03室法定代表人: 安立欣联系人: 曹庆展电话: 15210218389 客服: 400-080-5828 网址:

www.licai.com (41) 上海大智慧财富管理有限公司注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区郭守敬路498号浦东软件园14幢22301-130座办公地址: 上海浦东杨高南路428号1号楼法定代表人: 张长虹联系人: 施燕华电话: 18901685505 客服: 020-20219997 网址: www.gw.com.cn (42) 中欧基金管理有限公司注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路333号东方汇经中心5楼法定代表人: 窦玉明联系人: 屠帅颖电话: 021-68609600 客服: 400-700-9700 网址: www.zofund.com (43) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司注册地址: 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公地址: 朝阳区来广营中街甲1号朝来高科技产业园5号楼法定代表人: 程刚联系人: 张旭电话: 18500185071400-810-5919 客服: 400-810-5919 网址: www.fengfd.com (44) 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38-45层办公地址: 中国深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼法定代表人: 宫少林联系人: 黄婵君电话: 13808832583 (45) 乾道金融信息服务(北京)有限公司注册地址: 北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室办公地址: 北京市西城区德外大街合生财富广场1302室法定代表人: 王兴吉联系人: 刘金佩电话: 15901073209 客服: 400-088-8080 网址: www.qiandaojr.com (46) 深圳市金斧子网络科技有限公司注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼办公地址: 深圳市南山区科苑路科兴科学园B3栋7F 法定代表人: 赖任军联系人: 张焯电话: 0755-66892301 客服: 4009500-888 网址: www.jfzinv.com (47) 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: 上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4F 法定代表人: 陈继武联系人: 王哲宇电话: 021-63333319 客服: 4006-433-38953 (48) 东海期货有限责任公司注册地址: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼法定代表人: 陈太康联系人: 李天雨电话: 021-68757102 客服: 4006-433-389 网址: www.qh168.com.cn (49) 杭州科地瑞富基金销售有限

公司注册地址：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：毛肖勇电话：18888952115 客服：0571-86655920 网址：www.cd121.com (50) 上海朝阳永续基金销售有限公司注册地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼办公地址：上海市浦东新区张江碧波路 690 号 4 号楼 2 楼法定代表人：廖冰联系人：陆纪青电话：15902135304 客服：400-8832-993 网址：www.998fund.com (51) 嘉晟瑞信（天津）基金销售有限公司注册地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室办公地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 2503 室法定代表人：孙伟联系人：孙颖电话：15510846151 客服：400-8832-993 网址：www.jsrxfund.com (52) 上海联泰资产管理有限公司注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层法定代表人：燕斌电话：021-52822063 联系人：陈东客户服务热线：4000-466-788 网址：www.66zichan.com (53) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809 法定代表人：戎兵联系人：张得仙电话：13520443582 客服：400-6099-200 网址：www.yixinfund.com (54) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号法定代表人：林卓电话：15840969093 联系人：鞠言客户服务热线：400-6411-999 网站：www.taichengziben.com (55) 广发证券股份有限公司住所：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）办公地址：广州市天河北路 183 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：020-87555888-8333 传真：020-87555305 联系人：黄岚客户服务热线：95575 网址：www.gf.com.cn (56) 中信证券股份有限公司注册地址：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 20 层法定代表人：王东明电话：010-60838888 联系人：周雪晴客户服务热线：95558 网站：www.cs.ecitic.com (57) 中信证券（山东）有限责任公司注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融中心 1 号楼第 20 层（266061）法定代表人：杨宝林电话：0532-85022326 传真：0532-85022605 联系人：孙秋月客户服务热线：0532-95548 网址：www.zxwt.com.cn (58) 中信期货有限公司注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦 14 层法定代表人：张皓电话：0755-23953913 联系人：洪诚客服电话：400-9908-826 网站：www.citicsf.com

3、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构调整为本基金的销售机构，并及时公告。

（二）登记机构名称：天弘基金管理有限公司住所：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层法定代表人：井贤栋电话：（022）83865560 传真：（022）83865563 联系人：薄贺龙（三）律师事务所和经办律师名称：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 楼负责人：俞卫锋电话：021-31358666 传真：021-31358600 经办律师：黎明、陈颖华联系人：陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师名称：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 号星展银行大厦 6 楼办公地址：中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼执行事务合伙人：李丹电话：（021）23238888 传真：（021）23238800 经办注册会计师：薛竞、周祎联系人：周祎

四、基金的名称

本基金名称：天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：股票型

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的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以上证 50 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，力求降低跟踪误差。

1、大类资产配置本基金管理人主要按照上证 50 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略（1）股票投资组合构建本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于

跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80% 的投资比例限制。

（2）股票投资组合的调整本基金所构建的股票投资组合将根据上证 50 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。1）定期调整根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。2）不定期调整 A 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；B 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；C 根据法律法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。3、债券投资策略本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。4、资产支持证券投资策略本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。5、其他金融工具投资策略本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

（二）投资决策流程

1、决策依据

- （1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
- （2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
- （3）国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

- （1）本基金管理人每月定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议，会议参加人员为全体投资研究团队。
- （2）投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。
- （3）基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投资研究联席会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

(4) 金融工程分析师运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算,并提供数量化风险分析报告,行业分析师对标的指数成分股中基本面情况及时提供研究报告。

(5) 基金经理根据量化风险分析报告,在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下,采取适当的方法控制与指数的偏差风险、流动性风险、降低交易成本。

九、业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为:上证 50 指数收益率 95%+银行活期存款利率(税后) 5%。上证 50 指数是根据科学客观的方法,挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的 50 只股票组成样本股,以便综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体状况。上证 50 指数自 2004 年 1 月 2 日起正式发布。其目标是建立一个成交活跃、规模较大、主要作为衍生金融工具基础的投资指数。如果指数编制单位变更或停止上证 50 指数的编制、发布或授权,或上证 50 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为上证 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,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 8 月 4 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 2017 年 3 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。以下内容摘自本基金 2017 年第 1 季度报告。

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 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 100,861,322.80 93.24

其中:股票 100,861,322.80 93.24

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 6,060,546.27 5.60
 N-1 其他资产 1,250,547.45 1.16
 N 合计 108,172,416.52 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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 4,052,778.03 3.78
 C 制造业 17,527,130.74 16.34
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 840,708.00 0.78
 E 建筑业 7,243,349.52 6.75
 F 批发和零售业 --
 G 交通运输、仓储和邮政业 1,821,686.06 1.70
 H 住宿和餐饮业 --
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,307,686.06 2.15
 J 金融业 65,192,122.39 60.79
 K 房地产业 1,690,622.00 1.58
 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 卫生和社会工作 --
 R 文化、体育和娱乐业 --
 S 综合 --
 合计 100,676,082.80 93.89

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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 185,240.00 0.17
 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 --
 G 交通运输、仓储和邮政业 --
 H 住宿和餐饮业 --
 I 信息传输、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 --
 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 185,240.00 0.17

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

3 报告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

3.1 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	270,300	10,003,803.00	9.33
2	601166	兴业银行	333,200	5,401,172.00	5.04
3	600016	民生银行	591,407	5,015,131.36	4.68
4	600036	招商银行	257,592	4,938,038.64	4.60
5	600519	贵州茅台	12,287	4,747,205.32	4.43
6	601328	交通银行	687,000	4,280,010.00	3.99
7	600000	浦发银行	215,729	3,453,821.29	3.22
8	601668	中国建筑	374,700	3,447,240.00	3.21
9	601288	农业银行	956,500	3,194,710.00	2.98
10	600030	中信证券	196,100	3,159,171.00	2.95

3.2 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601727	上海电气	22,000	185,240.00	0.17

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金属投资明细

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序的前五名权证投资明细

本基金本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

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 100,377.48

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 2,030.31

5 应收申购款 1,148,139.66

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,250,547.45

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 占基金资产净值比例（%） 流通受限情况说明

1 601727 上海电气 185,240.00 0.17 重大事项公告

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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。本基金合同生效日 2015 年 7 月 16 日，基金业绩数据截至 2017 年 3 月 31 日。

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

天弘上证 50A

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015 年 07 月 16 日-2015 年 12 月 31 日 -9.88% 2.07% -11.50% 2.26% 1.62% -0.19%

2016 年 01 月 01 日-2016 年 12 月 31 日 -3.60% 1.17% -5.15% 1.21% 1.55% -0.04%

2017 年 01 月 01 日-2017 年 3 月 31 日 2.60% 0.48% 3.03% 0.48% -0.43% 0.00%

自基金合同生效日(2015 年 07 月 16 日)至 2017 年 3 月 31 日 -10.86% 1.41% -13.52% 1.51% 2.66% -0.10%

天弘上证 50C

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015 年 07 月 16 日-2015 年 12 月 31 日 -10.02% 2.07% -11.50% 2.26% 1.48% -0.19%

2016 年 01 月 01 日-2016 年 12 月 31 日 -3.89% 1.17% -5.15% 1.21% 1.26% -0.04%

2017 年 01 月 01 日-2017 年 3 月 31 日 2.54% 0.48% 3.03% 0.48% -0.49% 0.00%

自基金合同生效日(2015 年 07 月 16 日)至 2017 年 3 月 31 日 -11.32% 1.41% -13.52% 1.51% 2.20% -0.10%

十三、基金费用与税收

（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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；4、标的指数许可使用基点费；5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；7、基金份额持有人大会费用；8、基金的证券、期货交易费用；9、基金的银行汇划费用；10、证券、期货账户开户费用和银行账户维护费；11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.5\%$ 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基金管理费每日计算，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\%$ 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算，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5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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.25\%$ 当年天数 H 为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为C类基金份额前一日基金资产净值销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、指数许可使用基点费本基金指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。本基金指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二（2个基点）的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.002\%$ 当年天数 H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。自基金合同生效日起，基金管理人、基金托管人和指数供应商核对一致后，于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划款指令，按照确认的金额和指定的账户路径将上一季度的指数许可使用基点费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。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币8000元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数许可使用基点费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒介上刊登公告。上述（一）基金费用的种类中第5—11项费用，由基金管理人、基金托管人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，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

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用；3、《基金合同》生效前的相关费用；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费用的

项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人于2017年2月27日公告的《天弘上证50指数型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下: 1、更新了重要提示中相关内容; 2、更新了三、基金管理人中相关内容; 3、更新了四、基金托管人中相关内容; 4、更新了五、相关服务机构中相关内容; 5、更新了八、基金份额的申购与赎回中相关内容; 6、更新了十、基金投资组合报告相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核; 7、更新了十一、基金的业绩的相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核; 8、更新了二十三、其他应披露的事项,披露了自上次内容更新截止日至本次内容更新截止日期间涉及本基金及基金管理人的相关公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日