易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金 更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇二〇年四月

重要提示

1、本基金根据 2019 年 4 月 17 日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2019】753 号）进行募集，本基金基金合同于 2019 年 9 月 6 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。

2、基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

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。

3、本基金投资于上证 50 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80% 且不低于基金资产净值的 90%，其投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件，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，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险及其他风险等。本基金特有风险包括：指数化投资的风险、标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、退市风险、终止清盘风险、第三方机构服务的风险、申购赎回清单标识设置风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、投资特定品种（包括股指期货、股票期权等金融衍生品、资产支持证券等）的特有风险等。本基金为股票型基金，

预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

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。

基金不同于银行储蓄，基金投资人投资于基金有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

4、基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金本次更新招募说明书对标的指数许可使用费收取下限相关信息进行更新，相关信息更新截止日为 2020 年 3 月 31 日。本基金增加扩位证券简称相关信息更新截止日为 2020 年 3 月 13 日。除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2020 年 1 月 16 日，有关财务数据截止日为 2019 年 12 月 31 日，净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期：2001年4月17日

法定代表人：刘晓艳

联系电话：400 881 8088

联系人：李红枫

注册资本：13,244.2万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

2、股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	22.6514%
广发证券股份有限公司	22.6514%
盈峰控股集团有限公司	22.6514%
广东省广晟资产经营有限公司	15.1010%
广州市广永国有资产经营有限公司	7.5505%
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5087%
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.6205%
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5309%
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.7558%
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.4396%
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5388%
总计	100%

（二）主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

周泽群先生，高级管理工商管理硕士（EMBA），董事。曾任珠海粤财实业有限公司董事长；粤财控股（北京）有限公司总经理、董事长；广东粤财投资控股有限公司总经理助理、办公室主任，广东粤财投资控股有限公司副总经理。现任广东粤财投资控股有限公司董事、总经理。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理；广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长；广发控股（香港）有限公司董事；广发证券资产管理（广东）有限公司董事长。现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理；广发控股（香港）有限公司董事长。

陈志辉先生，管理学硕士，董事。曾任美的集团财务总监；安永会计师事务所广州分所高级审计员；盈峰控股集团有限公司资财中心总经理。现任宁波盈峰股权投资基金管理有限公司合伙人、联席总裁；深圳市盈峰环保产业基金管理有限公司监事；广东顺德盈峰互联网产业投资管理有限公司监事；广东神华保险代理有限公司董事；厦门瑞为信息技术有限公司董事。

戚思胤先生，经济学硕士，董事。曾任广东省高速公路发展股份有限公司证券部投资者关系管理业务员、投资者关系管理主管、信息披露主管、证券事务代表；广东省广晟资产经营有限公司资本运营部高级主管、团委副书记、副部长、部长；（香港）广晟投资发展有限公司董事、常务副总经理等职务。现任广东省广晟资产经营有限公司董事会办公室（法务中心）主任；广东风华高新科技股份有限公司董事；佛山电器照明股份有限公司董事；深圳市

中金岭南有色金属股份有限公司董事；佛山市国星光电股份有限公司董事；广东南粤银行股份有限公司董事。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授；复星旅游文化集团（开曼）有限公司独立董事。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授；中远海运特种运输股份有限公司独立董事；上海莱士血液制品股份有限公司独立董事；珠海华发实业股份有限公司独立董事；广州恒运企业集团股份有限公司独立董事；中国南方航空股份有限公司独立董事；广州环保投资集团有限公司外部董事。

庄伟燕女士，法学博士，独立董事。曾任广东省妇女联合会干部；广东鸿鼎律师事务所主任；广东广悦鸿鼎律师事务所管委会主任。现任广东广信君达律师事务所高级合伙人。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

赵必伟先生，经济学专业研究生，监事。曾任广州市财政局第四分局工作专管员；广州市税务局对外分局工作科长、副局长；广州市广永国有资产经营有限公司董事副总裁、总裁、董事长；香港广永财务有限公司副总经理、总经理；广州市广永经贸公司总经理；广州银行股份有限公司副董事长；广州广永丽都酒店有限公司董事。现任广州市广永国有资产经营有限公司党总支书记；万联证券股份有限公司董事；广州赛马娱乐总公司副董事长；广州银行股份有限公司董事。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理；深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、固定收益投资决策委员会委员、产品审批委员会委员。

吴欣荣先生，工学硕士，副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士（MBA），首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官。

关秀霞女士，财务硕士、工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析员；Daniel Dennis 高级审计师；美国道富银行波士顿及亚洲总部大中华地区高级副总裁、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计部高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），首席养老金业务官。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任；浦东发展银行总行企业年金部总经理；长江养老保险公司首席市场总监；易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

陈荣女士，经济学博士，首席运营官。曾任中国人民银行广州分行统计研究处科员；易方达基金管理有限公司运作支持部经理、核算部总经理助理、核算部副总经理、核算部总经理、投资风险管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司首席运营官，兼任公司财务中心主任；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理有限公司监事；易方达海外投资（深圳）有限公司监事。

汪兰英女士，工学学士、法学学士，首席大类资产配置官。曾任中信证券股份有限公司风险投资部投资经理助理；中国证监会基金监管部副主任科员、主任科员、副处长、处长；中国人寿资产管理有限公司风险管理部副总经理（主持工作）、项目评审部副总经理（主持工作）、基金投资部副总经理（主持工作）。现任易方达基金管理有限公司首席大类资产配置官；易方达资产管理有限公司董事。

2、基金经理

余海燕女士，经济学硕士。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2013 年 9 月 23 日起任职）、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 6 月 26 日起任职）、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2015 年 1 月 22 日起任职）、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 4 月 15 日起任职）、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 15 日起任职）、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 8 日起任职）、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 8 日起任职）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 4 日起任职）、易方达中证军工交

易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 14 日起任职）、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 27 日起任职）、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 11 月 22 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2019 年 1 月 18 日起任职）、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 3 月 20 日起任职）、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（自 2019 年 6 月 12 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2019 年 9 月 6 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 9 月 9 日起任职）。

成曦先生，经济学硕士。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 27 日至 2019 年 8 月 15 日）、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 5 月 4 日至 2019 年 8 月 15 日）。现任易方达基金管理有限公司易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）（原易方达中小板指数分级证券投资基金）基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 5 月 17 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达原油证券投

资基金（QDII）基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 3 月 13 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2019 年 9 月 6 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 9 月 9 日起任职）。

3、指数投资决策委员会成员

本公司指数投资决策委员会成员包括：林飞先生、张胜记先生、林伟斌先生。

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数与量化投资部总经理、量化基金组合部总经理、指数与量化投资管理总部总经理、指数及增强投资部总经理、量化策略部总经理、量化投资部代总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数管理总部总经理、解决方案部总经理、投资经理，易方达资产管理（香港）有限公司就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、证券交易负责人员（RO）。

张胜记先生，管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深 300 指数证券投资基金）基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数投资部总经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达标普全

球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）基金经理。

林伟斌先生，经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数投资部副总经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、托管人信息

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、场内申购、赎回代办证券公司（以下排序不分先后）

(1) 方正证券

注册地址：长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F

法定代表人：施华

联系人：程博怡

联系电话：010-56437060

客户服务电话：95571

传真：010-56437013

网址：www.foundersc.com

(2) 广发证券

注册地址：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：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或 02095575

网址：www.gf.com.cn

(3) 国信证券

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：李颖

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址: www.guosen.com.cn

(4) 海通证券

注册地址: 上海市广东路 689 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 周杰

联系人: 金芸、李笑鸣

联系电话: 021-23219000

客户服务电话: 95553

传真: 021-23219100

网址: www.htsec.com

(5) 华泰证券

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: 张伟

联系人: 庞晓芸

联系电话: 0755-82492193

客户服务电话: 95597

传真: 025-83387523

网址: www.htsc.com.cn

(6) 招商证券

注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人: 霍达

联系人: 黄婵君

联系电话: 0755-82943666

客户服务电话: 95565、400-8888-111

传真: 0755-82943636

网址: www.newone.com.cn

(7) 中信建投证券

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

联系电话：010-85130554

客户服务电话：95587 或 4008-888-108

网址：<http://www.csc108.com/>

(8) 中信证券

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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：张佑君

联系人：王一通

联系电话：010-60838888

客户服务电话：95548

传真：010-60836029

网址：www.cs.ecitic.com

(9) 中信证券（山东）

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：焦刚

联系电话：0531-89606166

客户服务电话：95548

传真：0532-85022605

网址：<http://sd.citics.com/>

2、二级市场交易代办证券公司

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

（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

联系人：郑奕莉

电话：（021）58872935

传真：（021）68870311

（三）出具法律意见书的律师事务所

律师事务所：广东金桥百信律师事务所

地址：广州市珠江新城珠江东路 16 号高德置地冬广场 G 座 24 楼

负责人：聂卫国

电话：020-83338668

传真：020-83338088

经办律师：石向阳，莫哲

联系人：石向阳

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：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

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：赵雅、马婧

联系人：赵雅

四、基金的名称

易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

交易型开放式股票基金、指数基金

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的最小化。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、中小板以及其他依法发行、上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八、基金的策略

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：

（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。

如因标的指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。

2、债券和货币市场工具投资策略

本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,适当参与债券和货币市场工具的投资。

3、金融衍生品投资策略

为更好地实现投资目标,本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品,如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。

本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易,以对冲特殊情况下的流动风险,利用杠杆作用以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

本基金将按照风险管理的原则参与股票期权投资。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

4、融资及转融通证券出借

在条件许可的情况下,基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,根据相关法律法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资及转融通证券出借业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会审议。

5、未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。

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收益率,即上证 50 指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告

本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。

本基金的托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2019 年 10 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。

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	228,001,319.22	95.14
	其中：股票	228,001,319.22	95.14
2	固定收益投资	418,993.05	0.17
	其中：债券	418,993.05	0.17
	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	9,697,139.46	4.05
7	其他资产	1,535,647.09	0.64
8	合计	239,653,098.82	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 2 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	9,402,624.00	3.93
C	制造业	68,122,262.89	28.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,086,324.00	3.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,893,379.00	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,059,144.00	0.86
J	金融业	124,899,161.38	52.20
K	房地产业	5,677,108.00	2.37
L	租赁和商务服务业	3,189,835.95	1.33
M	科学研究和技术服务业	2,671,480.00	1.12
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	228,001,319.22	95.29

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	409,950	35,034,327.00	14.64
2	600519	贵州茅台	18,607	22,012,081.00	9.20

3	600036	招商银行	390,800	14,686,264.00	6.14
4	601166	兴业银行	548,300	10,856,340.00	4.54
5	600276	恒瑞医药	118,992	10,414,179.84	4.35
6	600030	中信证券	297,100	7,516,630.00	3.14
7	600887	伊利股份	229,500	7,100,730.00	2.97
8	600016	民生银行	933,200	5,888,492.00	2.46
9	601328	交通银行	1,036,500	5,835,495.00	2.44
10	600000	浦发银行	442,700	5,476,199.00	2.29

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	418,993.05	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	418,993.05	0.18

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113029	明阳转	1,370	136,997.60	0.06

		债			
2	128085	鸿达转债	870	86,998.47	0.04
3	128084	木森转债	690	68,998.79	0.03
4	128086	国轩转债	530	52,999.07	0.02
5	110065	淮矿转债	450	44,999.61	0.02

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

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IH2001	IH2001	11	10,132,980.00	106,500.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					106,500.00

股指期货投资本期收益(元)	484,264.08
股指期货投资本期公允价值变动(元)	106,500.00

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 2019年7月25日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对交通银行股份有限公司太平洋信用卡中心2017年6月至10月期间在办理部分客户信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度的违规事实，处以责令改正，并处罚款40万元。

2019年12月27日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司如下违法违规行作出“罚款150万元”的行政处罚：1、授信审批不审慎；2、总行对分支机构管控不力承担管理责任。

2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司以贷收贷，掩盖资产真实质量，以贷转存，虚增存贷款规模的违法违规事实，处以罚款100万元的行政处罚。

2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量，贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票的违法违规事实，处以罚款100万元的行政处罚。

2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金的违法违规事实，处以罚款50万元的行政处罚。

2019年12月14日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局针对中国民生银行股份有限公司如下违法违规事实：1、总行同业票据业务管理失控；2、总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产；3、总行案件风险信息报送管理不到位；4、总行未有效管理承兑业务；5、总行办理无真实贸易背景承兑业务；6、总行承兑业务质押资金来源为本行贷款；7、银川分行为已注销法人公司办理票据贴现业务；8、杭州分行为票据中介办理票据贴现业务；9、上海自贸区分行为票据中介办理票据贴现业务；10、福州分行、苏州分行、郑州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实，处以责令改正，并处罚款700万元的行政处罚。

2019年6月24日，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司关于以下违法违规事实：（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力，处以罚款130万元人民币。

2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心2015年至2018年6月在为部分客户办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎的违法违规事实，责令改正，并处罚款30万元。

2019年12月3日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心2019年1月信用卡催收外包管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实，责令改正，并处罚款50万元。

2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心1、2016年1月至2018年1月在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度；2、2016年至2018年8月对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的违法违规行为，责令改正，并处罚款40万元。

2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心2016年9月至2018年6月在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度的违法违规事实，责令改正，并处罚款20万元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、交通银行、民生银行、兴业银行、浦发银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,209,917.01
2	应收证券清算款	322,913.63
3	应收股利	-
4	应收利息	2,816.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,535,647.09

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2019 年 9 月 6 日，基金合同生效以来（截至 2019 年 12 月 31 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率 标准差 (2)	业绩比较 基准收益 率 (3)	业绩比较 基准收益 率标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
自基金合同生效 日至 2019 年 12 月 31 日	6.23%	0.66%	3.63%	0.75%	2.60%	-0.09%

十三、费用概览

（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》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市初费及年费；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，因基金运作而发生的，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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数编制机构签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向指数编制机构支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.03 \% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

如当季度日均基金资产净值(日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同)大于人民币 5000 万元的，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元；如当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，标的指数许可使用费不设收取下限。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。标的指数许可使用费每日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

如果基金管理人和指数编制机构对指数许可使用费的计算方法、费率或支付方式等另有约定的，本基金从其最新约定。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应及时在指定媒介予以公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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

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）与基金销售有关的费用

投资人在申购或赎回时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5%的标准向投资人收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

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信息披露管理办法》等有关法律法规，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2020 年 3 月 18 日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“十六、基金的费用与税收”部分，更新了部分内容。

易方达基金管理有限公司

2020 年 4 月 2 日