

# 嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

(2016 年第 1 号)

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）根据2012年11月27日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]1588号）的核准公开发售，本基金基金合同于2013年3月22日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

## 重要提示

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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《证券投资基金法》、《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。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年3月22日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本信息

|       |  |
|-------|--|
| 名称    | 嘉实基金管理有限公司   |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元        |
| 办公地址  | 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层                              |
| 法定代表人 | 邓红国  |
| 总经理   | 赵学军  |
| 成立日期  | 1999 年 3 月 25 日                                    |
| 注册资本  | 1.5 亿元   |
| 股权结构  | 中诚信托有限责任公司 40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%，立信投资有限责任公司 30%。 |
| 存续期间  | 持续经营   |
| 电话    | （010）65215588                                      |
| 传真    | （010）65185678                                      |
| 联系人   | 胡勇钦  |

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014 年 12 月 2 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

苗菁先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中煤信托有限责任公司国际业务部项目

---

经理、投资管理部业务经理；2004年3月至今历任中诚信托有限责任公司投资管理部业务经理、副经理、经理、投资总监兼投资管理部经理；现任中诚信托有限责任公司投资总监、副总经理、公司党委委员。

**Bernd Amlung** 先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自1989年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

**Mark Cullen** 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD。

韩家乐先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。

2004至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今

---

任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察长和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

陈正宪先生，11年证券从业经历。曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。2016年1月5日至今任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实黄金

（QDII-FOF-LOF）、嘉实H股指数（QDII）基金经理，2016年3月24日至今任嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实中创400ETF及其联接基金经理，2016年1月5日至今任本基金基金经理。

何如女士，硕士研究生，9年证券从业经历。曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司（IA-Clarrington Investments Inc）、富兰克林坦普顿投资管理公司（Franklin Templeton Investments Corp.）。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司，任产品管理部高级产品经理职位，负责指数产品及ETF创新产品的设计与开发、指数研究及产品管理工作；2012年9月加入指数投资部，先后担任基金经理助理、基金经理职位，现任指数投资部执行副总监及

---

基金经理。2014年5月9日至今任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理，2014年6月13日至今任嘉实中证主要消费ETF基金经理，2014年6月13日至今任嘉实中证医药卫生ETF基金经理，2014年6月20日至今任嘉实中证金融地产ETF基金经理，2015年8月6日至今任嘉实中证金融地产ETF联接基金经理，2016年1月5日任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实中证500ETF基金经理以及本基金基金经理。

## （2）历任基金经理

杨宇先生，2013年3月22日至2016年1月5日任本基金基金经理。

## 3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生，公司总经理赵学军先生，公司研究总监陈少平女士，资深基金经理邹唯先生、邵秋涛先生、胡涛先生，定量投资部负责人张自力先生。

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

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

---

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个、综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场

处、理财信托股市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

###### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

|      |                         |    |                |
|------|-------------------------|----|----------------|
| 办公地址 | 北京市东城区建国门南大街7号万豪中心D座12层 |    |                |
| 电话   | (010) 65215588          | 传真 | (010) 65215577 |
| 联系人  | 赵佳                      |    |                |

###### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

|      |                                 |    |                |
|------|---------------------------------|----|----------------|
| 办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2期53层09-11单元 |    |                |
| 电话   | (021) 38789658                  | 传真 | (021) 68880023 |
| 联系人  | 邵琦                              |    |                |

###### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

|      |                                     |    |                |
|------|-------------------------------------|----|----------------|
| 办公地址 | 成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元 |    |                |
| 电话   | (028) 86202100                      | 传真 | (028) 86202100 |
| 联系人  | 王启明                                 |    |                |

###### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

|      |                         |    |                 |
|------|-------------------------|----|-----------------|
| 办公地址 | 深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦16层 |    |                 |
| 电话   | (0755) 84362200         | 传真 | (0755) 25870663 |
| 联系人  | 陈寒梦                     |    |                 |

###### 1、（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

|      |                            |    |                 |
|------|----------------------------|----|-----------------|
| 办公地址 | 青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室 |    |                 |
| 电话   | (0532) 66777766            | 传真 | (0532) 66777676 |
| 联系人  | 胡洪峰                        |    |                 |

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

|      |                              |    |                 |
|------|------------------------------|----|-----------------|
| 办公地址 | 杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室 |    |                 |
| 电话   | (0571) 87759328              | 传真 | (0571) 87759331 |
| 联系人  | 章文雷                          |    |                 |

(7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

|      |                                |    |                 |
|------|--------------------------------|----|-----------------|
| 办公地址 | 福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元 |    |                 |
| 电话   | (0591) 88013673                | 传真 | (0591) 88013670 |
| 联系人  | 吴志锋                            |    |                 |

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

|      |                                  |    |                |
|------|----------------------------------|----|----------------|
| 办公地址 | 南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室 |    |                |
| 电话   | (025) 66671118                   | 传真 | (025) 66671100 |
| 联系人  | 徐莉莉                              |    |                |

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

|      |                                       |    |                |
|------|---------------------------------------|----|----------------|
| 办公地址 | 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元 |    |                |
| 电话   | (020) 88832125                        | 传真 | (020) 81552120 |
| 联系人  | 周炜                                    |    |                |

2、代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

|       |                             |      |       |
|-------|-----------------------------|------|-------|
| 住所    | 北京市西城区金融大街 25 号             |      |       |
| 办公地址  | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心 |      |       |
| 法定代表人 | 王洪章                         |      |       |
| 网址    | www.ccb.com                 | 客服电话 | 95533 |

(2) 中国工商银行股份有限公司

|         |                   |      |       |
|---------|-------------------|------|-------|
| 住所、办公地址 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |      |       |
| 法定代表人   | 姜建清               | 联系人  | 陶仲伟   |
| 传真      | 010-66107914      |      |       |
| 网址      | www.icbc.com.cn   | 客服电话 | 95588 |

(3) 中国农业银行股份有限公司

|         |                   |  |  |
|---------|-------------------|--|--|
| 住所、办公地址 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |  |  |
|---------|-------------------|--|--|



|       |                 |      |                |
|-------|-----------------|------|----------------|
| 法定代表人 | 蒋超良             | 联系人  | 滕涛             |
| 电话    | (010) 85108227  | 传真   | (010) 85109219 |
| 网址    | www.abchina.com | 客服电话 | 95599          |

(4) 中国银行股份有限公司

|       |                          |      |                |
|-------|--------------------------|------|----------------|
| 办公地址  | 北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼 |      |                |
| 注册地址  | 北京市西城区复兴门内大街1号           |      |                |
| 法定代表人 | 田国立                      |      |                |
| 电话    | (010) 66596688           | 传真   | (010) 66594946 |
| 网址    | www.boc.cn               | 客服电话 | 95566          |

(5) 交通银行股份有限公司

|       |                  |      |              |
|-------|------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 上海市银城中路188号      |      |              |
| 注册地址  | 上海市银城中路188号      |      |              |
| 法定代表人 | 牛锡明              | 联系人  | 张宏革          |
| 电话    | 021-58781234     | 传真   | 021-58408483 |
| 网址    | www.bankcomm.com | 客服电话 | 95559        |

(6) 招商银行股份有限公司

|         |                    |      |                 |
|---------|--------------------|------|-----------------|
| 住所、办公地址 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |      |                 |
| 法定代表人   | 李建红                | 联系人  | 邓炯鹏             |
| 电话      | (0755) 83198888    | 传真   | (0755) 83195050 |
| 网址      | www.cmbchina.com   | 客服电话 | 95555           |

(7) 中信银行股份有限公司

|         |                 |      |       |
|---------|-----------------|------|-------|
| 住所、办公地址 | 北京市东城区朝阳门北大街9号  |      |       |
| 法定代表人   | 常振明             | 联系人  | 廉赵峰   |
| 网址      | bank.ecitic.com | 客服电话 | 95558 |

(8) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

|       |                |      |       |
|-------|----------------|------|-------|
| 办公地址  | 北京市西城区金融大街3号   |      |       |
| 注册地址  | 北京市西城区金融大街3号   |      |       |
| 法定代表人 | 李国华            | 联系人  | 王硕    |
| 传真    | (010) 68858117 |      |       |
| 网址    | www.psbc.com   | 客服电话 | 95580 |

(9) 江苏银行股份有限公司

|         |            |     |     |
|---------|------------|-----|-----|
| 住所、办公地址 | 南京市洪武北路55号 |     |     |
| 法定代表人   | 夏平         | 联系人 | 展海军 |

|    |                 |      |                            |
|----|-----------------|------|----------------------------|
| 电话 | (025) 58587018  | 传真   | (025) 58587038             |
| 网址 | www.jsbchina.cn | 客服电话 | (025) 96098、<br>4008696098 |

(10) 渤海银行股份有限公司

|         |                     |      |                |
|---------|---------------------|------|----------------|
| 住所、办公地址 | 天津市河西区马场道 201-205 号 |      |                |
| 法定代表人   | 刘宝凤                 | 联系人  | 王宏             |
| 电话      | (022) 58316666      | 传真   | (022) 58316569 |
| 网址      | www.cbhb.com.cn     | 客服电话 | 400-888-8811   |

(11) 深圳农村商业银行股份有限公司

|         |                            |      |                                |
|---------|----------------------------|------|--------------------------------|
| 住所、办公地址 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |      |                                |
| 法定代表人   | 李伟                         | 联系人  | 王璇                             |
| 电话      | 0755-25188269              | 传真   | 0755-25188785                  |
| 网址      | www.4001961200.com         | 客服电话 | 961200 (深圳)<br>4001961200 (全国) |

(12) 烟台银行股份有限公司

|         |                    |      |              |
|---------|--------------------|------|--------------|
| 住所、办公地址 | 山东省烟台市芝罘区海港路 25 号  |      |              |
| 法定代表人   | 叶文君                | 联系人  | 王淑华          |
| 电话      | 0535-6699660       | 传真   | 0535-6699884 |
| 网址      | www.yantaibank.net | 客服电话 | 4008-311-777 |

(13) 河北银行股份有限公司

|         |                 |      |               |
|---------|-----------------|------|---------------|
| 住所、办公地址 | 石家庄市平安北大街 28 号  |      |               |
| 法定代表人   | 乔志强             | 联系人  | 王娟            |
| 电话      | 0311-88627587   | 传真   | 0311-88627027 |
| 网址      | www.hebbank.com | 客服电话 | 4006129999    |

(14) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

|       |                   |      |               |
|-------|-------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 常州市和平中路 413 号     |      |               |
| 注册地址  | 常州市和平中路 413 号     |      |               |
| 法定代表人 | 陆向阳               | 联系人  | 包静            |
| 电话    | 13951229068       | 传真   | 0519-89995170 |
| 网址    | www.jnbank.com.cn | 客服电话 | 96005         |

(15) 包商银行股份有限公司

|         |                |     |                |
|---------|----------------|-----|----------------|
| 住所、办公地址 | 内蒙古包头市钢铁大街 6 号 |     |                |
| 法定代表人   | 李镇西            | 联系人 | 张晶 刘芳          |
| 电话      | (0472) 5109729 | 传真  | (0472) 5176541 |

|    |                       |      |   |
|----|-----------------------|------|---|
| 网址 | http://www.bsb.com.cn | 客服电话 | 0472-96016 010-96016 0574-967210 0755-967210 028-65558555 |
|----|-----------------------|------|---|

(16) 广州农村商业银行股份有限公司

|       |                 |      |              |
|-------|-----------------|------|--------------|
| 办公地址  | 广州市天河区珠江新城华夏路1号 |      |              |
| 注册地址  | 广州市天河区珠江新城华夏路1号 |      |              |
| 法定代表人 | 王继康             | 联系人  | 戴一挥          |
| 电话    | 020-22389188    | 传真   | 020-22389031 |
| 网址    | www.grcbank.com | 客服电话 | 020-961111   |

(17) 成都农村商业银行股份有限公司

|       |                       |      |              |
|-------|-----------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 四川省成都市武侯区科华中路88号      |      |              |
| 注册地址  | 四川省成都市武侯区科华中路88号      |      |              |
| 法定代表人 | 陈萍                    | 联系人  | 杨琪           |
| 电话    | 028-85315412          | 传真   | 028-85190961 |
| 网址    | http://www.cdrcb.com/ | 客服电话 | 028-962711   |

(18) 苏州银行股份有限公司

|       |                    |      |               |
|-------|--------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 江苏省苏州市钟园路728号      |      |               |
| 注册地址  | 江苏省苏州市东吴北路143号     |      |               |
| 法定代表人 | 王兰凤                | 联系人  | 熊志强           |
| 电话    | 0512-69868390      | 传真   | 0512-69868370 |
| 网址    | www.suzhoubank.com | 客服电话 | 0512-96067    |

(19) 杭州联合农村商业银行股份有限公司

|         |                    |      |               |
|---------|--------------------|------|---------------|
| 住所、办公地址 | 杭州市建国中路99号杭州联合银行大楼 |      |               |
| 法定代表人   | 张晨                 | 联系人  | 胡莹            |
| 电话      | 0571-87923324      | 传真   | 0571-87923214 |
| 网址      | www.urcb.com       | 客服电话 | 96592         |

(20) 威海市商业银行股份有限公司

|       |                |      |              |
|-------|----------------|------|--------------|
| 办公地址  | 山东省威海市宝泉路9号    |      |              |
| 注册地址  | 山东省威海市宝泉路9号    |      |              |
| 法定代表人 | 谭先国            | 联系人  | 刘文静          |
| 电话    | 0631-5211651   | 传真   | 0631-5215726 |
| 网址    | whshls@163.com | 客服电话 | 4000096636   |

(21) 福建海峡银行股份有限公司

|       |                     |      |               |
|-------|---------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 福建省福州市晋安区六一北路 158 号 |      |               |
| 注册地址  | 福建省福州市晋安区六一北路 158 号 |      |               |
| 法定代表人 | 苏素华                 | 联系人  | 黄钰雯           |
| 电话    | 0591-83967183       | 传真   | 0591-87330926 |
| 网址    | www.fjhxbank.com    | 客服电话 | 4008939999    |

(22) 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

|       |                  |      |               |
|-------|------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号 |      |               |
| 注册地址  | 浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号 |      |               |
| 法定代表人 | 俞俊海              | 联系人  | 孔张海           |
| 电话    | 0575-84788101    | 传真   | 0575-84788100 |
| 网址    | www.borf.cn      | 客服电话 | 4008896596    |

(23) 和讯信息科技有限公司

|       |                        |      |              |
|-------|------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层 |      |              |
| 注册地址  | 北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层 |      |              |
| 法定代表人 | 王莉                     | 联系人  | 刘洋           |
| 电话    | 021-20835785           | 传真   | 021-20835879 |
| 网址    | licaike.hexun.com      | 客服电话 | 4009200022   |

(24) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

|       |                              |      |              |
|-------|------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼 |      |              |
| 注册地址  | 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室   |      |              |
| 法定代表人 | 汪静波                          | 联系人  | 李娟           |
| 电话    | 021-80359115                 | 传真   | 021-38509777 |
| 网址    | www.noah-fund.com            | 客服电话 | 400-821-5399 |

(25) 深圳众禄金融控股股份有限公司

|       |                                  |      |               |
|-------|----------------------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼            |      |               |
| 注册地址  | 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 IJ 单元 |      |               |
| 法定代表人 | 薛峰                               | 联系人  | 童彩平           |
| 电话    | 0755-33227950                    | 传真   | 0755-33227951 |
| 网址    | www.zlfund.cn                    | 客服电话 | 4006-788-887  |

(26) 上海天天基金销售有限责任公司

|       |                           |     |     |
|-------|---------------------------|-----|-----|
| 办公地址  | 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼 |     |     |
| 注册地址  | 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层  |     |     |
| 法定代表人 | 其实                        | 联系人 | 潘世友 |

|    |                            |    |              |              |
|----|----------------------------|----|--------------|--------------|
| 电话 | 021-54509998               | 传真 | 021-64385308 |              |
| 网址 | http://www.1234567.com.cn/ |    | 客服电话         | 400-1818-188 |

(27) 上海好买基金销售有限公司

|       |                                  |      |              |
|-------|----------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 |      |              |
| 注册地址  | 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室  |      |              |
| 法定代表人 | 杨文斌                              | 联系人  | 张茹           |
| 电话    | 021-20613999                     | 传真   | 021-68596916 |
| 网址    | www.ehowbuy.com                  | 客服电话 | 4007009665   |

(28) 杭州数米基金销售有限公司

|       |                               |      |               |
|-------|-------------------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼 |      |               |
| 注册地址  | 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号            |      |               |
| 法定代表人 | 陈柏青                           | 联系人  | 张裕            |
| 电话    | 021-60897840                  | 传真   | 0571-26697013 |
| 网址    | http://www.fund123.cn/        | 客服电话 | 4000-766-123  |

(29) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

|       |                                |      |              |
|-------|--------------------------------|------|--------------|
| 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 |      |              |
| 注册地址  | 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室     |      |              |
| 法定代表人 | 张跃伟                            | 联系人  | 单丙焯          |
| 电话    | 021-20691869                   | 传真   | 021-20691861 |
| 网址    | www.erichfund.com              | 客服电话 | 400-089-1289 |

(30) 浙江同花顺基金销售有限公司

|       |                                 |      |              |
|-------|---------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼 |      |              |
| 注册地址  | 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室          |      |              |
| 法定代表人 | 凌顺平                             | 联系人  | 林海明          |
| 传真    | 0571-86800423                   |      |              |
| 网址    | www.5ifund.com                  | 客服电话 | 4008-773-772 |

(31) 北京展恒基金销售股份有限公司

|       |                        |      |              |
|-------|------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层 |      |              |
| 注册地址  | 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号      |      |              |
| 法定代表人 | 闫振杰                    | 联系人  | 翟飞飞          |
| 电话    | 13520236631            | 传真   | 010-62020355 |
| 网址    | 010-62020355           | 客服电话 | 4008886661   |

(32) 嘉实财富管理有限公司

|         |                                 |      |              |
|---------|---------------------------------|------|--------------|
| 住所、办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2期53层12-15单元 |      |              |
| 法定代表人   | 赵学军                             | 联系人  | 景琪           |
| 电话      | 021-38789658                    | 传真   | 021-68880023 |
| 网址      | www.harvestwm.cn                | 客服电话 | 400-021-8850 |

**(33) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司**

|       |                           |      |              |
|-------|---------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809 |      |              |
| 注册地址  | 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809    |      |              |
| 法定代表人 | 沈伟桦                       | 联系人  | 程刚           |
| 电话    | 010-52855713              | 传真   | 010-85894285 |
| 网址    | www.yixinfund.com         | 客服电话 | 400-6099-200 |

**(34) 众升财富（北京）基金销售有限公司**

|       |                               |      |              |
|-------|-------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元 |      |              |
| 注册地址  | 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元 |      |              |
| 法定代表人 | 李招弟                           | 联系人  | 高晓芳          |
| 电话    | 010-59393923                  | 传真   | 010-59393074 |
| 网址    | www.wy-fund.com               | 客服电话 | 400-059-8888 |

**(35) 深圳腾元基金销售有限公司**

|       |                                      |      |               |
|-------|--------------------------------------|------|---------------|
| 办公地址  | 广东省深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808室 |      |               |
| 注册地址  | 广东省深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808室 |      |               |
| 法定代表人 | 曾革                                   | 联系人  | 鄢萌莎           |
| 电话    | 0755-33376922                        | 传真   | 0755-33065516 |
| 网址    | www.tenyuanfund.com                  | 客服电话 | 4006877899    |

**(36) 中经北证（北京）资产管理有限公司**

|       |                               |      |              |
|-------|-------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市西城区北礼士路甲129号3号楼创新工场一层109-1 |      |              |
| 注册地址  | 北京市西城区北礼士路甲129号               |      |              |
| 法定代表人 | 徐福星                           | 联系人  | 徐娜           |
| 电话    | 010-68292940                  | 传真   | 010-68292941 |
| 网址    | www.bzfund.com                | 客服电话 | 010-68292745 |

**(37) 上海汇付金融服务有限公司**

|      |                       |  |  |
|------|-----------------------|--|--|
| 办公地址 | 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 |  |  |
| 注册地址 | 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 |  |  |

|       |              |      |              |
|-------|--------------|------|--------------|
| 法定代表人 | 冯修敏          | 联系人  | 陈云卉          |
| 电话    | 021-33323998 | 传真   | 021-33323837 |
| 网址    | 暂无           | 客服电话 | 400-820-2819 |

**(38) 北京乐融多源投资咨询有限公司**

|       |                         |      |              |
|-------|-------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 |      |              |
| 注册地址  | 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 |      |              |
| 法定代表人 | 董浩                      | 联系人  | 张婷婷          |
| 电话    | 18510450202             | 传真   | 010-56580660 |
| 网址    | www.jimufund.com        | 客服电话 | 400-068-1176 |

**(39) 上海陆金所资产管理有限公司**

|       |                          |      |              |
|-------|--------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼     |      |              |
| 注册地址  | 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 |      |              |
| 法定代表人 | 郭坚                       | 联系人  | 宁博宇          |
| 电话    | 021-20665952             | 传真   | 021-22066653 |
| 网址    | www.lufunds.com          | 客服电话 | 4008219031   |

**(40) 珠海盈米财富管理有限公司**

|       |                                       |      |              |
|-------|---------------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 广东省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 |      |              |
| 注册地址  | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491              |      |              |
| 法定代表人 | 肖雯                                    | 联系人  | 黄敏嫦          |
| 电话    | 020-89629019                          | 传真   | 020-89629011 |
| 网址    | www.yingmi.cn                         | 客服电话 | 020-89629066 |

**(41) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司**

|       |                          |      |              |
|-------|--------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层 |      |              |
| 注册地址  | 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室      |      |              |
| 法定代表人 | 彭运年                      | 联系人  | 仲甜甜          |
| 电话    | 010-59336492             | 传真   | 010-59336510 |
| 网址    | www.jnlc.com/            | 客服电话 | 010-59336512 |

**(42) 泉州银行股份有限公司**

|       |                |     |               |
|-------|----------------|-----|---------------|
| 办公地址  | 福建省泉州市丰泽区云鹿路3号 |     |               |
| 注册地址  | 福建省泉州市丰泽区云鹿路3号 |     |               |
| 法定代表人 | 傅子能            | 联系人 | 董培姗、王燕玲       |
| 电话    | 0595-22551071  | 传真  | 0595-22578871 |

|    |   |      |            |
|----|---|------|------------|
| 网址 | <a href="http://www.qzccb.com">http://www.qzccb.com</a> | 客服电话 | 4008896312 |
|----|---|------|------------|

(43) 锦州银行股份有限公司

|       |  |      |              |
|-------|--|------|--------------|
| 办公地址  | 辽宁省锦州市科技路 68 号   |      |              |
| 注册地址  | 辽宁省锦州市科技路 68 号   |      |              |
| 法定代表人 | 张伟   | 联系人  | 张华阳          |
| 电话    | 0416-3220085   | 传真   | 0416-3220017 |
| 网址    | <a href="http://www.jinzhoubank.com">www.jinzhoubank.com</a> | 客服电话 | 400-6696178  |

(44) 浙江乐清农村商业银行股份有限公司

|       |  |      |               |
|-------|--|------|---------------|
| 办公地址  | 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号                                |      |               |
| 注册地址  | 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号                                |      |               |
| 法定代表人 | 高剑飞  | 联系人  | 金晓娇           |
| 电话    | 0577-61566028                                      | 传真   | 0577-61566063 |
| 网址    | <a href="http://www.yqbank.com">www.yqbank.com</a> | 客服电话 | 4008896596    |

(45) 贵阳银行股份有限公司

|       |  |      |               |
|-------|--|------|---------------|
| 办公地址  | 贵州省贵阳市中华北路 77 号                                |      |               |
| 注册地址  | 贵州省贵阳市中华北路 77 号                                |      |               |
| 法定代表人 | 陈宗权  | 联系人  | 黎荣荣           |
| 电话    | 18092299120                                    | 传真   | 0851-86851953 |
| 网址    | <a href="http://www.gyccb.cn">www.gyccb.cn</a> | 客服电话 | 4001196033    |

(46) 天相投资顾问有限公司

|       |  |      |              |
|-------|--|------|--------------|
| 办公地址  | 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编: 100088   |      |              |
| 注册地址  | 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编: 100032  |      |              |
| 法定代表人 | 林义相  | 联系人  | 尹伶           |
| 电话    | 010-66045529   | 传真   | 010-66045518 |
| 网址    | <a href="http://www.jjm.com.cn">http://www.jjm.com.cn</a><br><a href="http://www.txsec.com">http://www.txsec.com</a> | 客服电话 | 010-66045678 |

(47) 中信建投证券股份有限公司

|       |  |      |                |
|-------|--|------|----------------|
| 住所    | 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  | 权唐             |
| 电话    | (010) 65183880                                     | 传真   | (010) 65182261 |
| 网址    | <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a> | 客服电话 | 400-8888-108   |

(48) 国信证券股份有限公司



|       |                                 |      |               |
|-------|---------------------------------|------|---------------|
| 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 |      |               |
| 法定代表人 | 何如                              | 联系人  | 周杨            |
| 电话    | 0755-82130833                   | 传真   | 0755-82133952 |
| 网址    | www.guosen.com.cn               | 客服电话 | 95536         |

**(49) 中信证券股份有限公司**

|         |                       |      |                |
|---------|-----------------------|------|----------------|
| 住所、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                   | 联系人  | 陈忠             |
| 电话      | (010) 60833722        | 传真   | (010) 60833739 |
| 网址      | www.cs.ecitic.com     | 客服电话 | 95558          |

**(50) 中国银河证券股份有限公司**

|         |                           |      |              |
|---------|---------------------------|------|--------------|
| 住所、办公地址 | 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 |      |              |
| 法定代表人   | 陈有安                       | 联系人  | 田薇           |
| 电话      | (010) 66568430            | 传真   | 010-66568990 |
| 网址      | www.chinastock.com.cn     | 客服电话 | 400-8888-888 |

**(51) 海通证券股份有限公司**

|       |                |      |                          |
|-------|----------------|------|--------------------------|
| 住所    | 上海淮海中路 98 号    |      |                          |
| 办公地址  | 上海市广东路 689 号   |      |                          |
| 法定代表人 | 王开国            | 联系人  | 金芸、李笑鸣                   |
| 电话    | (021) 23219000 | 传真   | (021) 23219100           |
| 网址    | www.htsec.com  | 客服电话 | 95553 或拨打各城市<br>营业网点咨询电话 |

**(52) 申万宏源证券有限公司**

|         |                      |      |              |
|---------|----------------------|------|--------------|
| 住所、办公地址 | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 |      |              |
| 注册地址    | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 |      |              |
| 法定代表人   | 李梅                   | 联系人  | 钱达琛          |
| 电话      | 021-33389888         | 传真   | 021-33388224 |
| 网址      | www.swhysc.com       | 客服电话 | 021-962505   |

**(53) 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 深<br>圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层 |     |                 |
| 法定代表人 | 牛冠兴  | 联系人 | 陈剑虹             |
| 电话    | (0755) 82825551  | 传真  | (0755) 82558355 |

|    |                    |      |            |
|----|--------------------|------|------------|
| 网址 | www.essence.com.cn | 客服电话 | 4008001001 |
|----|--------------------|------|------------|

**(54) 国元证券股份有限公司**

|         |                 |      |                |
|---------|-----------------|------|----------------|
| 住所、办公地址 | 安徽省合肥市寿春路 179 号 |      |                |
| 法定代表人   | 凤良志             | 联系人  | 陈玲玲            |
| 电话      | (0551) 2246273  | 传真   | (0551) 2272100 |
| 网址      | www.gyzq.com.cn | 客服电话 | 95578          |

**(55) 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  | 天津市南开区滨水西道 8 号              |      |                |
| 法定代表人 | 杜庆平                         | 联系人  | 王兆权            |
| 电话    | (022) 28451861              | 传真   | (022) 28451892 |
| 网址    | www.bhzq.com                | 客服电话 | 4006515988     |

**(56) 华泰证券股份有限公司**

|       |                           |      |   |
|-------|---------------------------|------|---|
| 办公地址  | 江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场 |      |   |
| 注册地址  | 江苏省南京市建邺区江东中路 228 号       |      |   |
| 法定代表人 | 周易                        | 联系人  | 庞晓芸                                     |
| 电话    | 0755-82492193             | 传真   | 025-51863323 (南京)<br>0755-82492962 (深圳) |
| 网址    | www.htsc.com.cn           | 客服电话 | 95597                                   |

**(57) 中信证券(山东)有限责任公司**

|         |                              |      |                 |
|---------|------------------------------|------|-----------------|
| 住所、办公地址 | 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 |      |                 |
| 法定代表人   | 杨宝林                          | 联系人  | 吴忠超             |
| 电话      | (0532) 85022326              | 传真   | (0532) 85022605 |
| 网址      | www.citicssd.com             | 客服电话 | 95548           |

**(58) 信达证券股份有限公司**

|         |                       |      |                |
|---------|-----------------------|------|----------------|
| 住所、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   | 高冠江                   | 联系人  | 唐静             |
| 电话      | (010) 63081000        | 传真   | (010) 63080978 |
| 网址      | www.cindasc.com       | 客服电话 | 95321          |

**(59) 长城证券有限责任公司**

|         |                                    |     |    |
|---------|------------------------------------|-----|----|
| 住所、办公地址 | 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 |     |    |
| 法定代表人   | 黄耀华                                | 联系人 | 刘阳 |

|    |                 |      |                                |
|----|-----------------|------|--------------------------------|
| 电话 | (0755) 83516289 | 传真   | (0755) 83515567                |
| 网址 | www.cgws.com    | 客服电话 | 4006666888、<br>(0755) 33680000 |

**(60) 光大证券股份有限公司**

|         |                  |      |                        |
|---------|------------------|------|------------------------|
| 住所、办公地址 | 上海市静安区新闻路 1508 号 |      |                        |
| 法定代表人   | 薛峰               | 联系人  | 刘晨、李芳芳                 |
| 电话      | (021) 22169999   | 传真   | (021) 22169134         |
| 网址      | www.ebscn.com    | 客服电话 | 400888788、<br>10108998 |

**(61) 东北证券股份有限公司**

|         |                 |      |                                |
|---------|-----------------|------|--------------------------------|
| 住所、办公地址 | 长春市自由大路 1138 号  |      |                                |
| 法定代表人   | 杨树财             | 联系人  | 潘锴                             |
| 电话      | (0431) 85096709 | 传真   | (0431) 85096795                |
| 网址      | www.nesc.cn     | 客服电话 | 4006000686、<br>(0431) 85096733 |

**(62) 新时代证券有限责任公司**

|         |                                  |      |                |
|---------|----------------------------------|------|----------------|
| 住所、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   | 刘汝军                              | 联系人  | 孙恺             |
| 电话      | (010) 83561149                   | 传真   | (010) 83561094 |
| 网址      | www.xsdzq.cn                     | 客服电话 | 4006989898     |

**(63) 平安证券有限责任公司**

|       |                                 |      |                 |
|-------|---------------------------------|------|-----------------|
| 住所    | 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼          |      |                 |
| 办公地址  | 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048) |      |                 |
| 法定代表人 | 杨宇翔                             | 联系人  | 郑舒丽             |
| 电话    | 0755-22626391                   | 传真   | (0755) 82400862 |
| 网址    | http://www.pingan.com           | 客服电话 | 95511—8         |

**(64) 华安证券股份有限公司**

|       |                        |      |                  |
|-------|------------------------|------|------------------|
| 办公地址  | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 |      |                  |
| 注册地址  | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 |      |                  |
| 法定代表人 | 李工                     | 联系人  | 甘霖、钱欢            |
| 电话    | 055165161821           | 传真   | 055165161672     |
| 网址    | www.hazq.com           | 客服电话 | 96518、4008096518 |

**(65) 国都证券股份有限公司**

|         |                                 |  |  |
|---------|---------------------------------|--|--|
| 住所、办公地址 | 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 |  |  |
|---------|---------------------------------|--|--|

|       |                |      |                    |
|-------|----------------|------|--------------------|
| 法定代表人 | 常喆             | 联系人  | 黄静                 |
| 电话    | (010) 84183389 | 传真   | (010)84183311-3389 |
| 网址    | www.guodu.com  | 客服电话 | 400-818-8118       |

**(66) 东海证券股份有限公司**

|       |                          |      |                     |
|-------|--------------------------|------|---------------------|
| 办公地址  | 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦  |      |                     |
| 注册地址  | 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层 |      |                     |
| 法定代表人 | 朱科敏                      | 联系人  | 王一彦                 |
| 电话    | (021) 20333910           | 传真   | (021) 50498825      |
| 网址    | www.longone.com.cn       | 客服电话 | 95531; 400-888-8588 |

**(67) 申万宏源西部证券有限公司**

|         |   |      |              |
|---------|---|------|--------------|
| 住所、办公地址 | 新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼                 |      |              |
| 注册地址    | 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 258 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 |      |              |
| 法定代表人   | 李季  | 联系人  | 唐岚           |
| 电话      | 010-88085258                                | 传真   | 0991-2301802 |
| 网址      | www.hysec.com                               | 客服电话 | 4008-000-562 |

**(68) 中泰证券有限公司**

|         |                   |      |                 |
|---------|-------------------|------|-----------------|
| 住所、办公地址 | 山东省济南市市中区经七路 86 号 |      |                 |
| 法定代表人   | 李玮                | 联系人  | 吴阳              |
| 电话      | (0531) 68889155   | 传真   | (0531) 68889752 |
| 网址      | www.qlzq.com.cn   | 客服电话 | 95538           |

**(69) 中国国际金融有限公司**

|       |                                 |      |                                   |
|-------|---------------------------------|------|-----------------------------------|
| 住所    | 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 |      |                                   |
| 办公地址  | 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层       |      |                                   |
| 法定代表人 | 李剑阁                             | 联系人  | 廉赵峰                               |
| 电话    | (010) 65051166                  | 传真   | (010) 85679535                    |
| 网址    | www.ciccs.com.cn                | 客服电话 | (010) 85679238;<br>(010) 85679169 |

**(70) 中国中投证券有限责任公司**

|      |  |  |  |
|------|--|--|--|
| 住所   | 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 |  |  |
| 办公地址 | 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层  |  |  |

|       |                   |      |               |
|-------|-------------------|------|---------------|
| 法定代表人 | 高涛                | 联系人  | 刘毅            |
| 电话    | 0755-82023442     | 传真   | 0755-82026539 |
| 网址    | www.china-invs.cn | 客服电话 | 400 600 8008  |

**(71) 中山证券有限责任公司**

|         |                            |      |                 |
|---------|----------------------------|------|-----------------|
| 住所、办公地址 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层 |      |                 |
| 法定代表人   | 吴永良                        | 联系人  | 李珍              |
| 电话      | (0755) 82570586            | 传真   | (0755) 82960582 |
| 网址      | www.zszq.com               | 客服电话 | 4001022011      |

**(72) 江海证券有限公司**

|         |                     |      |               |
|---------|---------------------|------|---------------|
| 住所、办公地址 | 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 |      |               |
| 注册地址    | 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 |      |               |
| 法定代表人   | 孙名扬                 | 联系人  | 刘爽            |
| 电话      | 0451-85863719       | 传真   | 0451-82287211 |
| 网址      | www.jhzq.com.cn     | 客服电话 | 400-666-2288  |

**(73) 国金证券股份有限公司**

|         |                 |      |                |
|---------|-----------------|------|----------------|
| 住所、办公地址 | 成都市东城根上街 95 号   |      |                |
| 法定代表人   | 冉云              | 联系人  | 金喆             |
| 电话      | (028) 86690126  | 传真   | (028) 86690126 |
| 网址      | www.gjzq.com.cn | 客服电话 | 4006600109     |

**(74) 华宝证券有限责任公司**

|         |                              |      |                |
|---------|------------------------------|------|----------------|
| 住所、办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层 |      |                |
| 法定代表人   | 陈林                           | 联系人  | 夏元             |
| 电话      | (021) 68777222               | 传真   | (021) 68777822 |
| 网址      | www.cnhbstock.com            | 客服电话 | 4008209898     |

**(75) 天风证券股份有限公司**

|       |                                |      |              |
|-------|--------------------------------|------|--------------|
| 办公地址  | 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼 |      |              |
| 注册地址  | 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼   |      |              |
| 法定代表人 | 余磊                             | 联系人  | 崔成           |
| 电话    | 027-87610052                   | 传真   | 027-87618863 |
| 网址    | www.tfzq.com                   | 客服电话 | 4008005000   |

**(76) 宏信证券有限责任公司**

|      |                             |  |  |
|------|-----------------------------|--|--|
| 办公地址 | 四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 10 楼 |  |  |
| 注册地址 | 四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 11 楼 |  |  |

---

|       |              |      |              |
|-------|--------------|------|--------------|
| 法定代表人 | 吴玉明          | 联系人  | 刘进海          |
| 电话    | 028-86199278 | 传真   | 028-86199382 |
| 网址    | www.hxzq.cn  | 客服电话 | 4008366366   |

(二) 基金注册登记机构

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人：邓红国

总经理：赵学军

电话：（010）65215588

传真：（010）65185678

联系人：彭鑫

(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、办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19层

联系电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

负责人：韩炯

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(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：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：许康玮、张勇

---

## 四、基金的名称

本基金名称：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。

## 七、基金的投资范围

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许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。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等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决定。

---

## 八、基金的投资策略

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

此外，为更好地实现投资目标，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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

### 1、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决策依据。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建以及调整决策。

### 3、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正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台，整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展目标ETF的申购赎回清单分析、目标ETF流动性分析、标



---

的指数成份证券相关信息的搜集与分析等，作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 交易执行：集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(4) 投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

(5) 组合监控与调整：基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况，并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、本基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪业绩比较基准。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

#### (四) 投资组合管理

##### 1、投资组合的建立

在基金建仓期，为避免有可能在二级市场造成的价格冲击，基金经理将主要采取一级市场申购的方式建立联接基金的初始投资组合。

##### 2、投资组合的日常管理

(1) 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。

(2) 基金经理每日根据本基金申购赎回情况及已有现金滞留，在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。

(3) 通常情况下，联接基金的投资组合主要体现为持有目标ETF基金份额；对于目标ETF暂停申购、停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的现金，基金经理将根据市场情况按照本基金的投资范围约定的其他投资品种进行投资。

##### 3、投资绩效评估

风险管理部门定期对本基金的运行情况和跟踪偏离进行量化评估并出具评估报告。基金经理根据评估报告分析投资操作、组合状况和跟踪误差来源等情况，并相应进行组合调整。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95% + 银行活期存款税后利率\*5%。

中证500指数由沪深A股市场中经营状况良好、价格无异常波动或市场操纵的500只股票组成，以调整股本为权数，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。

中证500指数是本基金目标ETF的标的指数。如果目标ETF变更标的指数、或中证500指数编制机构变更或停止中证500指数的编制及发布、或中证500指数由其他指数替代、或中证500指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中证500指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，变更本基金的业绩比较基准并及时公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为嘉实中证500ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中证500ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证500指数及嘉实中证500ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

## 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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 月 18 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 2015 年 12 月 31 日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

### 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              | 5,410,766.55   | 1.30   |
|   | 其中：股票             | 5,410,766.55   | 1.30   |
| 2 | 基金投资              | 375,825,422.11 | 90.47  |
| 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      | 30,940,135.81  | 7.45   |
| 8 | 其他资产              | 3,237,743.49   | 0.78   |
|   | 合计                | 415,414,067.96 | 100.00 |

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 29,652.00    | 0.01         |
| C  | 制造业              | 4,502,015.00 | 1.09         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 17,408.00    | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | 558,446.00   | 0.14         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 57,750.00    | 0.01         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 130,281.00   | 0.03         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 40,590.55    | 0.01         |
| 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        | 30,000.00    | 0.01         |

|   |    |              |      |
|---|----|--------------|------|
| S | 综合 | 44,624.00    | 0.01 |
|   | 合计 | 5,410,766.55 | 1.31 |

### 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  | 300043 | 互动娱乐 | 69,000 | 1,090,200.00 | 0.26         |
| 2  | 000973 | 佛塑科技 | 79,200 | 1,029,600.00 | 0.25         |
| 3  | 601717 | 郑煤机  | 92,400 | 694,848.00   | 0.17         |
| 4  | 600851 | 海欣股份 | 41,000 | 602,700.00   | 0.15         |
| 5  | 002568 | 百润股份 | 13,600 | 580,584.00   | 0.14         |
| 6  | 600859 | 王府井  | 13,700 | 372,914.00   | 0.09         |
| 7  | 002678 | 珠江钢琴 | 6,800  | 117,028.00   | 0.03         |
| 8  | 600654 | 中安消  | 3,300  | 95,172.00    | 0.02         |
| 9  | 002049 | 同方国芯 | 1,100  | 69,542.00    | 0.02         |
| 10 | 600219 | 南山铝业 | 9,800  | 64,484.00    | 0.02         |

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 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

报告期末，本基金未持有债券。

### 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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

### 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

报告期末，本基金未持有权证。

### 9. 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称       | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值（人民币元）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------|------|--------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 嘉实中证500ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 嘉实基金管理有限公司 | 375,825,422.11 | 91.00        |

## 10. 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（买/卖） | 合约市值（元）      | 公允价值变动（元）  | 风险说明         |
|-------------------|--------------------------|----------|--------------|------------|--------------|
| IC1601            | 中证 500 股指期货<br>IC1601 合约 | 6        | 8,878,800.00 | 544,298.18 | -            |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                          |          |              |            | 544,298.18   |
| 股指期货投资本期收益（元）     |                          |          |              |            | 2,035,301.82 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |                          |          |              |            | 544,298.18   |

### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货的目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 12. 投资组合报告附注

### (1)

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### (2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### (3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,069,466.22 |
| 2  | 应收证券清算款 | 575,222.37   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 12,217.73    |
| 5  | 应收申购款   | 546,974.11   |
| 6  | 其他应收款   | 33,863.06    |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
|    | 合计      | 3,237,743.49 |

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 300043 | 互动娱乐 | 1,090,200.00   | 0.26         | 重大事项停牌   |
| 2  | 000973 | 佛塑科技 | 1,029,600.00   | 0.25         | 重大事项停牌   |
| 3  | 601717 | 郑煤机  | 694,848.00     | 0.17         | 重大事项停牌   |
| 4  | 600851 | 海欣股份 | 602,700.00     | 0.15         | 重大事项停牌   |
| 5  | 002568 | 百润股份 | 580,584.00     | 0.14         | 重大事项停牌   |
| 6  | 600859 | 王府井  | 372,914.00     | 0.09         | 重大事项停牌   |
| 7  | 002678 | 珠江钢琴 | 117,028.00     | 0.03         | 重大事项停牌   |
| 8  | 600654 | 中安消  | 95,172.00      | 0.02         | 重大事项停牌   |
| 9  | 002049 | 同方国芯 | 69,542.00      | 0.02         | 重大事项停牌   |
| 10 | 600219 | 南山铝业 | 64,484.00      | 0.02         | 重大事项停牌   |

## 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。

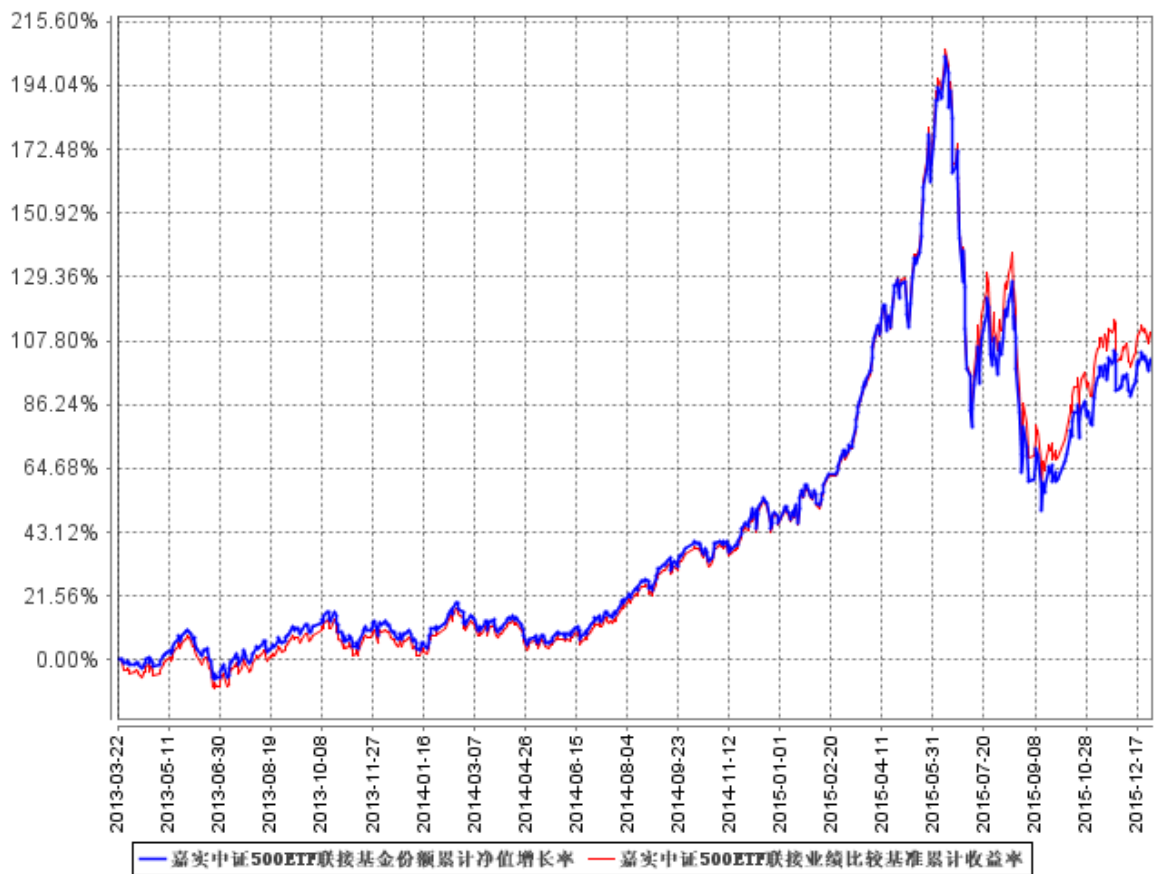
### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|                                 |        |       |        |       |        |        |
|---------------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2013年3月22日（基金合同生效日）至2013年12月31日 | 9.44%  | 1.29% | 7.14%  | 1.36% | 2.30%  | -0.07% |
| 2014年                           | 34.80% | 1.16% | 36.88% | 1.18% | -2.08% | -0.02% |
| 2015年                           | 34.43% | 2.68% | 41.26% | 2.68% | -6.83% | 0.00%  |

2.自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实中证500ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实中证 500ETF 联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月22日至2015年12月31日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

---

## 十三、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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）基金资产的资金汇划费用；
- （4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （7）因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （8）基金的开户费用、账户维护费用；
- （9）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### 3、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

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。



## (2) 基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

(3) 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费和赎回费

(1) 本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高不超过 5%，具体如下：

| 申购金额（含申购费）          | 申购费率      |
|---------------------|-----------|
| M < 50 万元           | 1.2%      |
| 50 万元 ≤ M < 200 万元  | 0.8%      |
| 200 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.4%      |
| M ≥ 500 万元          | 单笔 1000 元 |

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，

则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

(2) 本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

| 持有期限              | 赎回费率  |
|-------------------|-------|
| M < 365 天         | 0.50% |
| 365 天 ≤ M < 730 天 | 0.25% |
| M ≥ 730 天         | 0     |

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(3) 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上刊登公告。

(4) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

## 2、转换费

### ①、通过代销机构办理基金转换业务（仅限“前端转前端”的模式）

(a) 嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C转换为嘉实中证500ETF联接时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

---

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A或、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B或嘉实机构快线货币C全部转出时账户当前累计未付收益。

(b) 嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实中证500ETF联接时，采用“赎回费+申购费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$
$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

F为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(c) 嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红利混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合、嘉实对冲套利混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合转入嘉实中证500ETF联接时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$
$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

---

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(d) 嘉实中证500ETF联接与嘉实中创400联接、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接之间互转，以及转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(e) 嘉实中证500ETF联接转入嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红利混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合、嘉实对冲套利混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票时、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

---

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额 $\geq 500$ 万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金额 $< 500$ 万元，并且转出基金的持有期 $\geq 90$ 天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 $< 90$ 天，则固定补差费率为0.2%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(f) 嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实信用债券A、嘉实纯债债券A、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A转入嘉实中证500ETF联接时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额 $\geq 500$ 万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金额 $< 500$ 万元，并且转出基金的持有期 $\geq 90$ 天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 $< 90$ 天，则固定补差费率为0.2%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

## ②、通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务

a) 对于“前端转前端”的模式，采用以下规则：

(i) 嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C转换为嘉实中证500ETF联接时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

---

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B或嘉实机构快线货币C全部转出时账户当前累计未付收益。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

(ii) 嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证中期企业债指数（LOF）C转换为嘉实中证500ETF联接时，采用“赎回费+申购费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

F为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(iii) 嘉实中证500ETF联接与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实多元债券A、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实信用债券A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创400联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券A、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合、嘉实对冲套利混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实如意宝定期债券A、嘉实事件驱动股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实中证中期企业债指数（LOF）A、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A之间互转，以及转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实机构快线货币A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证中期企业债指数（LOF）C时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

---

净转入金额 =  $B \times C \times (1 - D)$

转入份额 = 净转入金额 / E

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

**b) 对于“后端转后端”的模式, 采用以下规则:**

(i) 若转出基金有赎回费, 则仅收取转出基金的赎回费;

(ii) 若转出基金无赎回费, 则不收取转换费用。

转出基金时, 如涉及的转出基金有赎回费用, 收取该基金的赎回费用。收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率, 调整后的基金转换费率应及时公告。

注1: 2014年5月23日起, 嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购(或转入)不超过500万元; 2014年11月13日起, 嘉实纯债债券单日单个基金账户累计申购(或转入、定投)不超过100万元; 2015年7月9日起, 嘉实货币单日单个基金账户累计申购(或转入、定投)不超过500万元; 自2015年7月22日起, 嘉实安心货币单日单个基金账户的累计申购(含转入及定投)金额不得超过200万元; 自2015年11月16日起, 嘉实中证中期企业债指数

(LOF) 单日单个基金账户累计申购(或转入、定投)不超过2000万元; 2016年4月5日起, 嘉实信用债券单日单个基金账户的累计申购(含转入及定投)金额不得超过500万元。嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实对冲套利定期混合、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益定期债券为定期开放, 在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

注2: 2013年4月9日, 本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》, 自2013年4月12日起, 在本公司基金网上直销系统开通旗下部分基金产品的后端收费模式(包括申购、定期定额投资、基金转换等业务)、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。2013年9月13日, 本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开

---

通后端收费基金产品的公告》，自2013年9月17日起，本基金开通网上直销后端收费模式，并执行上述优惠费率和业务规则。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

3、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

(三)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《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，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

- 1.在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
- 2.“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
- 3.在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。
- 4.在“五、相关服务机构”部分：更新了相关直销机构和代销机构信息。
- 5.在“九、基金的转换”部分：更新了基金转换的相关内容。
- 6.在“十二、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
- 7.在“十三、基金的业绩”：基金业绩更新至 2015 年 12 月 31 日。
- 8.在“二十六、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2015 年 9 月 22 日至 2016 年 3 月 22 日相关临时公告事项。



---

嘉实基金管理有限公司

2016年5月4日