

# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## ( LOF ) 更新招募说明书摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

### 重要提示

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 由嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 变更投资范围及其相关事宜而来。《关于嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 变更投资范围及其相关事项的议案》经 2012 年 8 月 6 日嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2012 年 8 月 21 日证监许可 [2012] 1146 号文核准。自 2012 年 8 月 21 日起，由《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》生效，原《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 8 月 21 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 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，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、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总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008 年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010 年 11 月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

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 年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，历任督察员和公司副总经理。

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

何如女士，硕士研究生，10年证券从业经历。曾任职于IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington 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，现任指数投资部副总监。2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中创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、嘉实中证500ETF联接以及本基金基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，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，现任公司指数投资部执行总监。2016年1月5日任嘉实沪深300ETF、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接以及本基金基金经理。2016年3月24日至今担任嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实中创400ETF及嘉实中创400ETF联接基金经理。

### （2）历任基金经理

2005年8月29日至2016年1月5日，杨宇先生任本基金基金经理。

## 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：公司副总经理兼股票投资业务联席CIO邵健先生，公司总经理赵学军先生，股票投资业务联席CIO兼研究总监陈少平女士，助理CIO兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理邹唯先生、胡涛先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2016年06月30日，中国银行已托管475只证券投资基金，其中境内基金444只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和

“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### 三、相关服务机构

#### (一) 柜台（场外）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) 25870686 传真 (0755) 25870663

联系人 陈寒梦

###### (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 杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城2幢1001A室

电话 (0571) 87759328 传真 (0571) 87759331

联系人 王振

###### (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) 87555163 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

## 2. 代销机构

(1) 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](http://www.boc.cn) 客服电话 95566

(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 易会满 联系人 杨菲

传真 010-66107914

网址 [www.icbc.com.cn](http://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](http://www.abchina.com) 客服电话 95599

(4) 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](http://www.ccb.com) 客服电话 95533

(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](http://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](http://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 李庆萍 联系人 廉赵峰

网址 [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com) 客服电话 95558

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址 上海市中山东一路 12 号

注册地址 上海市中山东一路 12 号

法定代表人 吉晓辉 联系人 高天、虞谷云

电话 (021) 61618888 传真 (021) 63604199

网址 [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn) 客服电话 95528

(9) 兴业银行股份有限公司

住所 福州市湖东路 154

办公地址 上海市江宁路 168

法定代表人 高建平 联系人 卞晷煜

电话 (021) 52629999 传真 (021) 62569070

网址 [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn) 客服电话 95561

(10) 中国光大银行股份有限公司

注册地址 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人 唐双宁 联系人 朱红

电话 (010) 63636153 传真 010-63639709

网址 [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com) 客服电话 95595

(11) 中国民生银行股份有限公司

住所、办公地址 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人 洪崎 联系人 杨成茜

电话 (010)58560666 传真 (010)57092611

网址 [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn) 客服电话 95568

(12) 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](http://www.psbc.com) 客服电话 95580

(13) 北京银行股份有限公司

住所 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人 闫冰竹 联系人 谢小华

电话 (010) 66223587 传真 (010) 66226045  
网址 [www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn) 客服电话 95526

(14) 华夏银行股份有限公司  
住所、办公地址 北京市东城区建国门内大街 22 号  
法定代表人 吴建 联系人 郑鹏  
电话 010-85238667 传真 010-85238680  
网址 [www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn) 客服电话 95577

(15) 上海银行股份有限公司  
住所、办公地址 上海市浦东新区银城中路 168 号  
法定代表人 金煜 联系人 汤征程  
电话 021-68475888 传真 021-68476111  
网址 [www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com) 客服电话 95594

(16) 广发银行股份有限公司  
住所、办公地址 广东省广州市农林下路 83 号  
法定代表人 董建岳 联系人 詹全鑫、张扬眉  
电话 (020) 38322256 传真 (020) 87310955  
网址 [www.gdb.com.cn](http://www.gdb.com.cn) 客服电话 800-830-8003、400-830-8003

(17) 平安银行股份有限公司  
住所、办公地址 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦  
法定代表人 肖遂宁 联系人 张青  
电话 0755-22166118 传真 0755-82080406  
网址 [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com) 客服电话 95511-3 或 95501

(18) 宁波银行股份有限公司  
住所、办公地址 宁波市鄞州区宁南南路 700 号  
法定代表人 陆华裕 联系人 胡技勋  
电话 (0574) 89068340 传真 (0574) 87050024  
网址 [www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn) 客服电话 96528, 962528 上海、北京地区

(19) 浙商银行股份有限公司  
住所、办公地址 浙江省杭州市庆春路 288 号  
法定代表人 张达洋 联系人 毛真海  
电话 (0571) 87659546 传真 (0571) 87659188  
网址 [www.czbank.com](http://www.czbank.com) 客服电话 95527

(20) 东莞银行股份有限公司  
住所、办公地址 东莞市城区运河东一路 193 号  
法定代表人 廖玉林 联系人 巫渝峰  
电话 (0769) 22119061 传真 (0769) 22117730  
网址 [www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn) 客服电话 4001196228

(21) 杭州银行股份有限公司  
住所、办公地址 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦  
法定代表人 吴太普 联系人 严峻  
电话 (0571)85108309 传真 (0571)85108309  
网址 [www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn) 客服电话 400-888-8508

(22) 温州银行股份有限公司  
住所 温州市车站大道华海广场 1 号楼  
办公地址 温州市车站大道 196 号  
法定代表人 邢增福 联系人 林波  
电话 (0577) 88990082 传真 (0577) 88995217  
网址 [www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn) 客服电话 (0577) 96699

(23) 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](http://www.jsbchina.cn) 客服电话 (025) 96098、4008696098

(24) 乌鲁木齐商业银行股份有限公司  
住所 乌鲁木齐市新华北路 8 号  
办公地址 乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦  
法定代表人 农惠臣 联系人 何佳  
电话 (0991)8824667 传真 (0991)8824667  
网址 [www.uccb.com.cn](http://www.uccb.com.cn) 客服电话 (0991)96518

(25) 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](http://www.jnbank.com.cn) 客服电话 96005

(26) 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 <http://www.qzccbank.com> 客服电话 4008896312

(27) 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  
注册地址 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人 林义相 联系人 尹伶  
电话 010-66045529 传真 010-66045518  
网址 <http://www.jjm.com.cn> 客服电话 010-66045678

(28) 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 刁甜  
传真 021-20835879  
网址 <http://fund.licaike.com/> 客服电话 4009200022

(29) 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 张裕  
电话 021-38509735 传真 021-38509777  
网址 [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com) 客服电话 400-821-5399

(30) 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 J 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](http://www.zlfund.cn) 客服电话 4006-788-887

(31) 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

(32) 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](http://www.ehowbuy.com) 客服电话 4007009665

(33) 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

(34) 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](http://www.erichfund.com) 客服电话 400-089-1289

(35) 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](http://www.5ifund.com) 客服电话 4008-773-772

(36) 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 李静如

电话 010-59601366-7024

网址 [www.myfund.com](http://www.myfund.com) 客服电话 4008886661

(37) 上海利得基金销售有限公司

办公地址 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

注册地址 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人 沈继伟 联系人 曹怡晨

电话 021-50583533 传真 021-50583633

网址 [a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn) 客服电话 400-067-6266

(38) 嘉实财富管理有限公司

住所 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号

金地中心 A 座 6 层

法定代表人 赵学军 联系人 景琪

电话 021-20289890 传真 021-20280110

网址 [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn) 客服电话 400-021-8850

(39) 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](http://www.yixinfund.com) 客服电话 400-6099-200

(40) 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](http://www.wy-fund.com) 客服电话 400-059-8888

(41) 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](http://www.tenyuanfund.com) 客服电话 4006877899

(42) 北京广源达信投资管理有限公司

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

注册地址 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人 齐剑辉 联系人 王英俊

电话 010-57298634 传真 010-82055860

网址 [www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com) 客服电话 4006236060

(43) 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

(44) 北京乐融多源投资咨询有限公司

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 2 层

注册地址 北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼 2 层

法定代表人 董浩 联系人 姜颖

电话 13522549431 传真 010-65951887

网址 [www.jimufund.com](http://www.jimufund.com) 客服电话 400-068-1176

(45) 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](http://www.lufunds.com) 客服电话 4008219031

(46) 大泰金石投资管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼中心  
注册地址 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室  
法定代表人 袁顾明 联系人 朱海涛  
电话 15921264785 传真 021-20324199  
网址 <http://www.dtfunds.com> 客服电话 400-928-2266

(47) 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](http://www.yingmi.cn) 客服电话 020-89629066

(48) 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/](http://www.jnlc.com/) 客服电话 010-59336512

(49) 国泰君安证券股份有限公司  
住所 上海市浦东新区商城路 618 号  
办公地址 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼  
注册地址 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号  
法定代表人 杨德红 联系人 芮敏祺  
电话 (021)38676666 传真 (021)38670666  
网址 [www.gtja.com](http://www.gtja.com) 客服电话 4008888666

(50) 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 [www.csc108.com](http://www.csc108.com) 客服电话 400-8888-108

(51) 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](http://www.guosen.com.cn) 客服电话 95536

(52) 招商证券股份有限公司  
住所、办公地址 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层  
法定代表人 宫少林 联系人 林生迎

电话 (0755)82943666 传真 (0755)82943636  
网址 [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn) 客服电话 4008888111、95565

(53) 广发证券股份有限公司

住所 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)  
办公地址 广东省广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼  
法定代表人 孙树明 联系人 黄岚  
电话 (020) 87555888 传真 (020) 87555305  
网址 [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn) 客服电话 95575 或致电各地营业网点

(54) 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](http://www.cs.ecitic.com) 客服电话 95558

(55) 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](http://www.chinastock.com.cn) 客服电话 400-8888-888

(56) 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](http://www.htsec.com) 客服电话 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

(57) 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](http://www.swhysc.com) 客服电话 021-962505

(58) 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](http://www.essence.com.cn) 客服电话 4008001001

(59) 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 0755-82492962(深圳)  
网址 [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn) 客服电话 95597

(60) 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](http://www.citicssd.com) 客服电话 95548

(61) 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](http://www.cgws.com) 客服电话 4006668888、(0755) 33680000

(62) 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

(63) 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](http://www.china-invs.cn) 客服电话 400 600 8008

(64) 兴业证券股份有限公司

住所 福州市湖东路 268 号  
办公地址 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层  
法定代表人 兰荣 联系人 夏中苏  
电话 (0591)38281963 传真 (0591)38507538  
网址 <http://www.xyzq.com.cn> 客服电话 95562

(65) 东方证券股份有限公司

住所 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层  
办公地址 上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人 潘鑫军 联系人 吴宇  
电话 (021) 63325888 传真 (021) 63326173  
网址 [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn) 客服电话 95503

(66) 方正证券股份有限公司  
住所、办公地址 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层  
法定代表人 雷杰 联系人 郭军瑞  
电话 (0731) 85832503 传真 (0731) 85832214  
网址 [www.foundersc.com](http://www.foundersc.com) 客服电话 95571

(67) 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](http://www.ebscn.com) 客服电话 4008888788、10108998

(68) 广州证券股份有限公司  
住所、办公地址 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼  
法定代表人 邱三发 联系人 林洁茹  
电话 020-88836999 传真 020-88836654  
网址 [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn) 客服电话 (020) 961303

(69) 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](http://www.nesc.cn) 客服电话 4006000686、(0431) 85096733

(70) 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 55165161821 传真 55165161672  
网址 [www.hazq.com](http://www.hazq.com) 客服电话 96518、4008096518

(71) 财富证券有限责任公司  
住所、办公地址 湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼  
法定代表人 周晖 联系人 郭磊  
电话 (0731) 84403319 传真 (0731) 84403439  
网址 [www.cfzq.com](http://www.cfzq.com) 客服电话 (0731) 84403360

(72) 华西证券股份有限公司  
住所 四川省成都市陕西街 239 号  
办公地址 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼深圳总部

法定代表人 杨炯洋 联系人 金达勇  
电话 (0755) 83025723 传真 (0755) 83025991  
网址 [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn) 客服电话 4008-888-818

(73) 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](http://www.hysec.com) 客服电话 4008-000-562

(74) 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](http://www qlzq.com.cn) 客服电话 95538

(75) 世纪证券有限责任公司  
住所、办公地址 深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层  
法定代表人 姜昧军 联系人 方文  
电话 (0755) 83199599 传真 (0755) 83199545  
网址 [www.cscs.com.cn](http://www.cscs.com.cn) 客服电话 (0755) 83199511

(76) 中航证券有限公司  
住所、办公地址 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼  
法定代表人 杜航 联系人 戴蕾  
电话 (0791) 86768681 传真 (0791) 86770178  
网址 [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com) 客服电话 400-8866-567

(77) 华福证券有限责任公司  
住所 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层  
办公地址 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层  
法定代表人 黄金琳 联系人 张腾  
电话 (0591) 87383623 传真 (0591) 87383610  
网址 [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn) 客服电话 (0591) 96326

(78) 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](http://www.ciccs.com.cn) 客服电话 (010) 85679238; (010) 85679169

(79) 联讯证券股份有限公司

办公地址 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼  
注册地址 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼  
法定代表人 徐刚 联系人 彭莲  
电话 0752-2119700 传真 0752-2119660  
网址 [www.lxsec.com](http://www.lxsec.com) 客服电话 95564

(80) 英大证券有限责任公司

住所 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
注册地址 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
法定代表人 吴骏 联系人 吴尔晖  
电话 0755-83007159 传真 0755-83007034  
网址 [www.ydsc.com.cn](http://www.ydsc.com.cn) 客服电话 4000-188-688

(81) 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](http://www.hxzq.cn) 客服电话 4008366366

(82) 长江证券股份有限公司

住所、办公地址 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦  
法定代表人 杨泽柱 联系人 李良  
电话 (027) 65799999 传真 (027) 85481900  
网址 [www.95579.com](http://www.95579.com) 客服电话 95579 或 4008-888-999

(83) 西南证券股份有限公司

住所、办公地址 重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦  
法定代表人 余维佳 联系人 张煜  
电话 (023) 63786141 传真 (023) 6378212  
网址 [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn) 客服电话 4008096096

(84) 湘财证券股份有限公司

住所、办公地址 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼  
法定代表人 林俊波 联系人 钟康莺  
电话 (021) 68634518 传真 (021) 68865680  
网址 [www.xcsc.com](http://www.xcsc.com) 客服电话 400-888-1551

(85) 万联证券有限责任公司

住所、办公地址 广州市中山二路18号电信广场36、37层  
法定代表人 张建军 联系人 罗创斌  
电话 (020) 37865070 传真 020-22373718-1013  
网址 [www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn) 客服电话 4008888133

(86) 民生证券股份有限公司

住所、办公地址 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人 余政 联系人 赵明

电话 (010) 85127622 传真 (010) 85127917

网址 [www.msizq.com](http://www.msizq.com) 客服电话 400-619-8888

(87) 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](http://www.gyzq.com.cn) 客服电话 95578

(88) 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 天津市南开区宾水西道 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](http://www.bhzq.com) 客服电话 4006515988

(89) 山西证券股份有限公司

住所、办公地址 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人 侯巍 联系人 郭熠

电话 (0351) 8686659 传真 (0351) 8686619

网址 [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn) 客服电话 400-666-1618

(90) 东兴证券股份有限公司

住所、办公地址 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人 徐勇力 联系人 汤漫川

电话 (010) 66555316 传真 (010) 66555246

网址 [www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn) 客服电话 400-8888-993

(91) 东吴证券股份有限公司

住所、办公地址 苏州工业园区翠园路 181 号

法定代表人 吴永敏 联系人 方晓丹

电话 (0512)65581136 传真 (0512) 65588021

网址 [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn) 客服电话 4008601555

(92) 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](http://www.cindasc.com) 客服电话 95321

(93) 南京证券股份有限公司

住所、办公地址 江苏省南京市大钟亭 8 号  
法定代表人 步国旬 联系人 潘月  
电话 (025) 83367888 传真 (025) 83320066  
网址 [www.njq.com.cn](http://www.njq.com.cn) 客服电话 4008285888

(94) 上海证券有限责任公司

住所、办公地址 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼  
法定代表人 龚德雄 联系人 许曼华  
电话 (021) 53686888 传真 (021) 53686100-7008  
网址 [www.962518.com](http://www.962518.com) 客服电话 (021) 962518、4008918918

(95) 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](http://www.xsdzq.cn) 客服电话 4006989898

(96) 大同证券有限责任公司

住所 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层  
办公地址 山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13  
法定代表人 董祥 联系人 薛津  
电话 (0351) 4130322 传真 (0351) 4130322  
网址 [www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn) 客服电话 4007121212

(97) 国联证券股份有限公司

办公地址 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702  
注册地址 江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层  
法定代表人 雷建辉 联系人 沈刚  
电话 0510-82831662 传真 0510-82830162  
网址 [www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn) 客服电话 95570

(98) 浙商证券有限责任公司

住所、办公地址 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼  
法定代表人 吴承根 联系人 许嘉行  
电话 (0571) 87901912 传真 (0571) 87901913  
网址 [www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn) 客服电话 (0571) 967777

(99) 国海证券股份有限公司

住所、办公地址 广西桂林市辅星路 13 号  
法定代表人 张雅锋 联系人 牛孟宇  
电话 0755-83709350 传真 0755-83700205  
网址 [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn) 客服电话 95563 (全国)

(100) 东莞证券股份有限公司

住所、办公地址 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼  
法定代表人 张运勇 联系人 苏卓仁  
电话 (0769) 22112062 传真 (0769) 22119423  
网址 [www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn) 客服电话 (0769) 961130

(101) 中原证券股份有限公司

住所、办公地址 郑州市郑东新区商务外环路 10 号  
法定代表人 菅明军 联系人 程月艳 范春艳  
电话 0371--69099882 传真 0371--65585899  
网址 [www.ccnew.com](http://www.ccnew.com) 客服电话 95377

(102) 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](http://www.guodu.com) 客服电话 400-818-8118

(103) 东海证券股份有限公司

住所、办公地址 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层  
法定代表人 赵俊 联系人 王一彦  
电话 (021)20333333 传真 (021)50498825  
网址 [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn) 客服电话 95531;400-888-8588

(104) 中银国际证券有限责任公司

住所 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层  
办公地址 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层  
法定代表人 许刚 联系人 李丹  
传真 (021) 50372474  
网址 [www.bocichina.com.cn](http://www.bocichina.com.cn) 客服电话 4006208888

(105) 恒泰证券股份有限公司

住所、办公地址 内蒙古呼和浩特市新城区新华大街 111 号  
法定代表人 庞介民 联系人 王旭华  
电话 (010) 66297386 传真 (0471) 4961259  
网址 [www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn) 客服电话 (0471) 4972343

(106) 国盛证券有限责任公司

住所 江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦  
办公地址 江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼  
法定代表人 曾小普 联系人 俞驰  
电话 (0791) 86285337 传真 (0791) 86282293  
网址 [www.gsstock.com](http://www.gsstock.com) 客服电话 4008222111

(107) 第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址 广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层  
法定代表人 刘学民 联系人 崔国良  
电话 (0755) 25832852 传真 (0755) 82485081  
网址 [www.fcsc.cn](http://www.fcsc.cn) 客服电话 4008881888

(108) 金元证券股份有限公司  
住所 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层  
办公地址 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层  
法定代表人 陆涛 联系人 马贤清  
电话 (0755) 83025022 传真 (0755) 83025625  
网址 [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn) 客服电话 400-8888-228

(109) 德邦证券有限责任公司  
住所 上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼  
办公地址 上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼  
法定代表人 姚文平 联系人 罗芳  
电话 (021) 68761616 传真 (021) 68767981  
网址 [www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn) 客服电话 4008888128

(110) 西部证券股份有限公司  
住所、办公地址 陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼  
法定代表人 刘建武 联系人 刘莹  
电话 (029) 87416787 传真 (029) 87417012  
网址 [www.westsecu.com](http://www.westsecu.com) 客服电话 95582

(111) 华龙证券有限责任公司  
住所、办公地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心  
法定代表人 李晓安 联系人 李昕田  
电话 (0931) 4890208 传真 (0931) 4890628  
网址 [www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com) 客服电话 (0931) 96668、4006898888

(112) 财通证券有限责任公司  
住所、办公地址 杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心  
法定代表人 沈继宁 联系人 乔骏  
电话 (0571) 87925129 传真 0571-87818329  
网址 [www.ctsec.com](http://www.ctsec.com) 客服电话 (0571) 96336、962336 (上海地区)

(113) 上海华信证券有限责任公司  
注册地址 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼  
法定代表人 罗浩 联系人 倪丹  
电话 021-38784818 传真 021-68775878  
网址 [www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com) 客服电话 68777877

(114) 华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元  
法定代表人 洪家新? 联系人 孔泉  
电话 (0755) 82083788 传真 (0755) 82083408  
网址 [www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn) 客服电话 (021) 32109999, (029) 68918888

(115) 瑞银证券有限责任公司

住所、办公地址 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层  
法定代表人 程宜荪 联系人 牟冲  
电话 (010) 58328112 传真 (010)58328748  
网址 [www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com) 客服电话 400-887-8827

(116) 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](http://www.zszq.com) 客服电话 4001022011

(117) 国融证券股份有限公司

住所 呼和浩特市新城区锡林南路 18 号  
办公地址 北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层  
法定代表人 孔佑杰 联系人 董晶姗  
电话 (010)83991737 传真 (010)66412537  
网址 [www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn) 客服电话 4006609839

(118) 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](http://www.jhzq.com.cn) 客服电话 400-666-2288

(119) 中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层  
法定代表人 赵大建 联系人 李微  
电话 (010) 59355941 传真 (010) 66553791  
网址 [www.e5618.com](http://www.e5618.com) 客服电话 400-889-5618

(120) 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](http://www.cnhbstock.com) 客服电话 4008209898

(121) 长城国瑞证券有限公司

住所、办公地址 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人 王勇 联系人 卢金文

电话 (0592) 5161642 传真 (0592) 5161140

网址 [www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn) 客服电话 (0592) 5163588

(122) 爱建证券有限责任公司

住所、办公地址 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人 宫龙云 联系人 陈敏

电话 (021) 32229888 传真 021-68728782

网址 [www.ajzq.com](http://www.ajzq.com) 客服电话 (021) 63340678

(123) 华融证券股份有限公司

住所 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人寿保险大厦十二层、十五层、十六层、十七层、十八层

法定代表人 祝献忠 联系人 李慧灵

电话 010-85556100 传真 010-85556088

网址 [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn) 客服电话 400-898-4999

(124) 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](http://www.tfzq.com) 客服电话 4008005000

(二) 注册登记机构

名称 中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人 金颖 联系人 朱立元

电话 (010) 59378839 传真 (010) 59378907

(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、办公地址 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人 韩炯 联系人 黎明

电话 (021) 31358666 传真 (021) 31358600

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 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人 杨绍信 联系人 张勇  
电话 (021) 23238888 传真 (021) 23238800  
经办注册会计师 许康玮、张勇

#### 四、基金的名称

本基金名称：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型上市开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

#### 七、基金的投资方向

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、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，在正常市场情况下，本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%。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。

##### 1、资产配置比例

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%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的

指数的有效跟踪。

## 2、组合构建

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，如期权、权证以及其他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。

## 3、风险收益目标

本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资，在日常管理过程中，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现对标的指数的有效跟踪，分享中国股票市场的长期收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金以沪深 300 指数为标的指数。业绩衡量基准为 95% 的沪深 300 指数增长率加 5% 的银行活期存款税后利率。

本基金管理人在基金管理期间有权更换标的指数和业绩衡量基准，标的指数和业绩衡量基准的更换将提前 3 个月在指定媒体上公告。

## 十、基金的风险收益特征

风险中等，获得证券市场平均收益率。

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据原基金合同规定，于 2016 年 7 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 2016 年 6 月 30 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 422,446,294.99 2.61

其中：股票 422,446,294.99 2.61

2 基金投资 14,878,369,171.55 91.84

3 固定收益投资 129,884,000.00 0.80

其中：债券 129,884,000.00 0.80

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 738,002,237.04 4.56  
 8 其他资产 32,437,775.58 0.20  
 合计 16,201,139,479.16 100.00

## 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	328,692.00	0.00
B	采矿业	14,720,422.63	0.09
C	制造业	139,220,822.72	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,769,949.67	0.10
E	建筑业	14,614,469.64	0.09
F	批发和零售业	8,959,044.40	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	12,909,958.57	0.08
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,588,564.33	0.16
J	金融业	152,988,886.83	0.95
K	房地产业	16,827,575.72	0.10
L	租赁和商务服务业	5,064,701.26	0.03
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,979,090.88	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	719,641.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,986,682.24	0.05
S	综合	2,747,667.00	0.02
	合计	422,446,294.99	2.61

## 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	539,576	17,288,015.04	0.11
2	600016	民生银行	1,177,600	10,515,968.00	0.06
3	601166	兴业银行	664,300	10,123,932.00	0.06
4	600036	招商银行	513,844	8,992,270.00	0.06
5	000651	格力电器	400,400	8,824,816.00	0.05
6	601328	交通银行	1,368,600	7,705,218.00	0.05
7	600519	贵州茅台	25,089	7,323,980.88	0.05

8 600000 浦发银行 430,779 6,707,229.03 0.04  
9 600030 中信证券 392,100 6,363,783.00 0.04  
10 600837 海通证券 403,100 6,215,802.00 0.04

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 129,884,000.00 0.80  
其中：政策性金融债 129,884,000.00 0.80  
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） --  
8 同业存单 --  
9 其他 --  
合计 129,884,000.00 0.80

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 160401 16 农发 01 700,000 69,986,000.00 0.43  
2 160209 16 国开 09 600,000 59,898,000.00 0.37

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

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 嘉实沪深 300ETF 股票型 交易型开放式 嘉实基金管理有限公司 14,878,369,171.55 91.95

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

IF1607 沪深 300 股指期货 IF1607 合约 32 29,888,640.00 152,040.00 -

公允价值变动总额合计（元） 152,040.00

股指期货投资本期收益（元） 2,387,640.00

股指期货投资本期公允价值变动（元） -2,026,260.00

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股、备选成份股和目标 ETF。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。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，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) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

(1) 2015 年 11 月 27 日，中信证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查。

2015 年 8 月 25 日，海通证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查；2015 年 9 月 11 日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，公司如果放弃陈述、申辩和听证的权利，证监会将按照行政处罚事先告知书所述事实、理由和依据作出正式的行政处罚决定。2015 年 11 月 27 日，海通证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查。

本基金投资于“中信证券（600030）”、“海通证券( 600837)”的决策程序说明：本基金投资目标为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，中信证券、海通证券为标的指数的成份股，本基金投资于“中信证券”、“海通证券”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无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。

## (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	7,255,943.37
2	应收证券清算款	22,057,996.37
3	应收股利	-
4	应收利息	1,403,797.42
5	应收申购款	1,720,038.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	32,437,775.58

## (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 000651 格力电器 8,824,816.00 0.05 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。

(一) 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 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

2005年8月29日基金合同生效日至2005年12月31日 -1.90% 0.82% -0.48% 0.89% -1.42%  
-0.07%

2006年年度 120.19% 1.32% 112.79% 1.33% 7.40% -0.01%

2007年年度 130.32% 2.18% 150.20% 2.18% -19.88% 0.00%

2008年年度 -64.36% 2.92% -63.85% 2.89% -0.51% 0.03%

2009年年度 91.97% 1.95% 90.72% 1.95% 1.25% 0.00%

2010年年度 -11.45% 1.50% -11.77% 1.50% 0.32% 0.00%

2011年年度 -22.95% 1.23% -23.82% 1.23% 0.87% 0.00%

2012年年度 8.81% 1.21% 7.30% 1.22% 1.51% -0.01%

2013年年度 -5.16% 1.32% -7.16% 1.32% 2.00% 0.00%

2014年年度 51.12% 1.14% 48.69% 1.15% 2.43% -0.01%

2015年度 6.98% 2.35% 5.70% 2.36% 1.28% -0.01%

2016年上半年度 -13.97% 1.74% -14.66% 1.75% 0.69% -0.01%

(二) 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

图：嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)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

(2005年8月29日至2016年6月30日)

注：根据2012年8月21日中国证监会《关于核准嘉实沪深300指数证券投资基金

(LOF)基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2012]1146号)，变更了投资范围并更名为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)。本基金自2012年8月21日起3个月内为建仓期(原持有的沪深300指数成份股、备选成份股调整为嘉实沪深300ETF)，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制)的规定：(1)基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；(2)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%。(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。

### 十三、基金的费用与税收

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、与基金运作有关的费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 证券交易费用;
- (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
- (7) 销售服务费, 具体计提办法按中国证监会的规定执行;
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

##### 2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

###### (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。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额 (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前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额, 若为负数, 则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从本基金财产中一次性支付给基金管理人。

###### (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。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额 (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前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额, 若为负数, 则 E 取 0。

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3) 上述 (一) 基金费用第 (3) — (8) 项费用, 除上款规定的费用外, 由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, 从当期基金财产中支付。

(4) 基金首次发行中所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支, 不另从基金财产中支付, 与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支; 若本基金发行失败, 发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

##### 3、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本基金财产的损失, 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。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(二) 与基金销售有关的费用

#### 1、申购费

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减：

申购金额（M，含申购费） 申购费率

M < 50 万元 1.5%

50 万元 ≤ M < 200 万元 1.2%

200 万元 ≤ M < 500 万元 1.0%

M ≥ 500 万元 按笔收取，1000 元/笔

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易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。

#### 2、赎回费

(1) 本基金场内的赎回费率统一为 0.5%；本基金场外赎回费率不高于 0.5%，随在开放式基金账户中的持有期限的增加而递减（如果投资人在本基金基金合同生效前连续持有原基金直至本基金基金合同生效后赎回，该投资人的持有期将按原基金持有期加上本基金持有期合并计算）：

持有期限 赎回费率

持有期 < 一年 0.5%

一年 ≤ 持有期 < 两年 0.25%

持有期 ≥ 两年 0

注：就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

(2) 本基金收取的赎回费中 25% 的部分归入基金财产。

#### 3、转换费

(1) 嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）、嘉实中证中期企业债指数（LOF）A/C 类场外份额与嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）场外基金份额之间互相转换时，基金转换费率采用“赎回费 + 申购费率补差”算法，计算公式如下：

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

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

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；

G 为对应的申购补差费率，当转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率时，则申购补

差费率 G 为零；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费的 25% 归入转出基金资产（嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 除外）；根据嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）基金合同的约定，对于持有期限少于 30 日的 C 类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

（2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

1) 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 转换为嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)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。

2) 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 转换为嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)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。

3) 嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)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、嘉实深证基本面 120ETF 联接、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、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、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、嘉实对冲套利定期混合、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、嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实丰益信用定期债券 A 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、嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券时，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。

(2) 通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式），采用以下规则：

1) 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

2) 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

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；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，嘉实信用债券型证券投资基金单个开放日每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；自 2016 年 7 月 11 日起，丰益纯债单个开放日每个基金账户的累计申购（含转入）金额不得超过 500 万元；自 2016 年 8 月 8 日起，嘉实新趋势灵活配置混合型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转入及定投）的金额不得超过 10 万元，嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转入及定投）的金额不得超过 1 万元；嘉实对冲套利定期混合、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用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。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

(三) 其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因故与本基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

(四) 本基金运作过程中的各类纳税主体，依照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.在“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：更新相关直销机构和代销机构信息。
- 5.在“十一、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。
- 6.在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至 2016 年 6 月 30 日。
- 7.在“二十五、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2016 年 2 月 21 日至 2016 年

8月21日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2016年9月30日