

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

(2019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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 2 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日，特别事项注明除外。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

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	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、北京怀柔、武汉分公司。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。

（二）主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委

员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。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 2017 年 12 月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017 年 12 月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、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。

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。

经雷先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998 年到 2008 年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008 年到 2013 年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013 年 10 月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018 年 3 月起任公司总经理。

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。

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。

王瑞华先生, 独立董事, 管理学博士, 会计学教授, 注册会计师, 中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012 年 12 月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生, 监事长, 经济学博士, 高级经济师, 中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理; 光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监; 光大保德信基金管理公司董事、副总经理; 大通证券股份有限公司副总经理、总经理; 大成基金管理有限公司董事长, 中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官; 中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁, 兼任中诚资本管理(北京)有限公司董事长。

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。

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。

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。

2、基金经理

(1) 现任基金经理

何如女士, 硕士研究生, 13 年证券从业经历, 具有基金从业资格, 加拿大籍。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, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任指数投资部副总监、基金经理。2014 年 5

月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 14 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 13 日至今任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至今任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 20 日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2015 年 8 月 6 日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，14 年证券从业经历，具有基金从业资格，中国台湾籍。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。2016 年 1 月 5 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016 年 1 月 5 日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理、2017 年 6 月 7 日至今任嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至今任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至今任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 15 日至今任嘉实创业

板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 1 月 14 日至今任嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金(LOF)基金经理。

(2) 历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2005 年 8 月 29 日至 2016 年 1 月 5 日。

3、Smart Beta 及指数投资决策委员会

Smart Beta 及量化投资决策委员会的成员包括：Smart-Beta 和量化投资首席投资官杨宇先生，公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生，部门负责人刘斌先生、陈正宪先生、何如女士。

4、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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

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 2018 年 12 月 31 日，中国银行已托管 700 只证券投资基金，其中境内基金 662 只，QDII 基金 38 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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。2017 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 号北京万豪中心 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 号上海国金中心二期 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		

(5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 3101 室		
电话	(0532) 66777997	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) 88061392	传真	(0571) 88021391

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 137 号信合广场 801A 单元		
电话	(0591) 88013670	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

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国工商银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号 联系人:杨菲 传真:010-66107914 客服电话:95588 网 址: http://www.icbc.com.cn , http://www.icbc-ltd.com
2	中国农业银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨 世贸中心东座九层 法定代表人:周慕冰 电话:(010)85108227 传真:(010)85109219 客服电话:95599 网址: http://www.abchina.com
3	中国银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人:陈四清 电话:(010)66596688 传真:(010)66594946 客服电话:95566 网址: http://www.boc.cn

4	中国建设银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人:田国立 客服电话:95533 网址: http://www.ccb.com
5	交通银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号 法定代表人:彭纯 联系人:王菁 电话:021-58781234 传真:021-58408483 客服电话:95559 网址: http://www.bankcomm.com
6	招商银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号 法定代表人:李建红 联系人:邓炯鹏 电话:(0755) 83198888 传真:(0755) 83195050 客服电话:95555 网址: http://www.cmbchina.com
7	中信银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 客服电话:95558 网址: bank.ecitic.com
8	上海浦东发展银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市中山东一路 12 号 法定代表人:高国富 联系人:高天、虞谷云 电话:(021)61618888 传真:(021)63604199 客服电话:95528 网址: http://www.spdb.com.cn
9	兴业银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:福建省福州市湖东路 154 号 法定代表人:高建平 联系人:卞晔煜 电话:(021) 52629999 传真:(021) 62569070 客服电话:95561 网址: http://www.cib.com.cn
10	中国光大银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 法定代表人:李晓鹏 联系人:朱红 电话:(010) 63636153 传真:010-63639709 客服电话:95595

		网址: http://www.cebbank.com
11	中国民生银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦 法定代表人:洪崎 联系人:王志刚 电话:(010)58560666 客服电话:95568 网址: http://www.cmbc.com.cn
12	中国邮政储蓄银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区金融大街 3 号 A 座 法定代表人:李国华 联系人:王硕 传真:(010) 68858057 客服电话:95580
13	北京银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号 法定代表人:张东宁 联系人:谢小华 电话:(010) 66223587 传真:(010) 66226045 客服电话:95526 网址: http://www.bankofbeijing.com.cn
14	华夏银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 法定代表人:李民吉 联系人:郑鹏 电话:010-85238667 传真:010-85238680 客服电话:95577 网址: http://www.hxb.com.cn ; http://www.95577.com.cn
15	上海银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 客服电话:95594 网址: http://www.bosc.cn
16	广发银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人:杨明生 联系人:詹全鑫、张扬眉 电话:(020) 38322256 传真:(020) 87310955 客服电话:800-830-8003、400-830-8003 网址: http://www.cgbchina.com.cn
17	平安银行股份有限公司	办公地址:深圳市深南东路 5047 号

	(注:只代销 A 份额。)	法定代表人:谢永林 联系人:张青 电话:0755-22166118 传真:0755-82080406 客服电话:95511-3 或 95501 网址: http://www.bank.pingan.com
18	宁波银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 法定代表人:陆华裕 联系人:胡技勋 电话:(0574) 89068340 传真:(0574) 87050024 客服电话:96528, 962528 上海、北京地区 网址: http://www.nbcb.com.cn
19	青岛银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 法定代表人:郭少泉 联系人:徐伟静 电话:0532-68629925 传真:0532-68629939 客服电话:96588(青岛)、4006696588(全国) 网址: http://www.qdccb.com/
20	浙商银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:浙江省杭州市庆春路 288 号 法定代表人:沈仁康 联系人:唐燕 电话:(0571) 87659056 传真:(0571) 87659554 客服电话:95527 网址: http://www.czbank.com
21	东莞银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:东莞市莞城区体育路 21 号 法定代表人:卢国锋 联系人:吴照群 电话:(0769)22119061 传真:(0769)22117730 客服电话:4001196228 网址: http://www.dongguanbank.cn/
22	杭州银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:杭州市下城区庆春路 46 号 法定代表人:陈震山 联系人:严峻 电话:(0571)85108309 传真:(0571)85108309 客服电话:400-888-8508 网址: http://www.hzbank.com.cn
23	温州银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:温州市车站大道 196 号 法定代表人:叶建清 联系人:林波

		电话:(0577) 88990082 传真:(0577) 88995217 客服电话:(0577) 96699 网址: http://www.wzbank.cn/
24	江苏银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:江苏省南京市中华路 26 号 法定代表人:夏平 联系人:张洪玮 电话:(025)58587036 传真:(025)58587820 客服电话:95319 网址: http://www.jsbchina.cn
25	乌鲁木齐银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号 法定代表人:杨黎 联系人:何佳 电话:(0991)8824667 传真:(0991)8824667 客服电话:(0991)96518 网址: http://www.uccb.com.cn
26	江苏江南农村商业银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:江苏省常州市和平中路 413 号 法定代表人:陆向阳 联系人:包静 电话:13951229068 传真:0519-89995170 客服电话:96005 网址: http://www.jnbank.com.cn
27	泉州银行股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: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 客服电话:4008896312 网址: http://www.qzccb.com/
28	天相投资顾问有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:西城区新街口外大街 28 号院 C 座 505 法定代表人:林义相 联系人:谭磊 电话:010-66045182 传真:010-66045518 客服电话:010-66045678 网址: txsec.com
29	和讯信息科技有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层 法定代表人:王莉 联系人:刘洋 传真:8610-65884788 客服电话:4009200022

		网址: http://www.hexun.com/
30	诺亚正行基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 法定代表人:汪静波 联系人:张裕 电话:021-38509735 传真:021-38509777 客服电话:400-821-5399 网址: http://www.noah-fund.com
31	上海天天基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 法定代表人:其实 联系人:潘世友 电话:021-54509977 传真:021-64385308 客服电话:95021 网址: http://www.1234567.com.cn
32	上海好买基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 法定代表人:杨文斌 联系人:张茹 电话:021-20613999 传真:021-68596916 客服电话:4007009665 网址: https://www.howbuy.com/
33	上海长量基金销售投资顾问有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人:张跃伟 联系人:单丙焯 电话:021-20691869 传真:021-20691861 客服电话:400-089-1289 网址: http://www.erichfund.com
34	浙江同花顺基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:浙江省杭州市西湖区古荡街道 法定代表人:凌顺平 联系人:林海明 传真:0571-86800423 客服电话:4008-773-772 网址: http://www.5ifund.com
35	北京展恒基金销售股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区安苑路 15 号邮电新闻大厦 法定代表人:闫振杰 联系人:李静如 电话:010-59601366-7024 客服电话:4008886661 网址: http://www.myfund.com

36	上海利得基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 法定代表人:李兴春 联系人:曹怡晨 电话:021-50583533 传真:021-50583633 客服电话:400-921-7755 网址: http://www.leadfund.com.cn
37	嘉实财富管理有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期 53 楼 法定代表人:赵学军 联系人:景琪 电话:021-20289890 传真:021-20280110 客服电话:400-021-8850 网址: http://www.harvestwm.cn
38	北京创金启富基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 法定代表人:梁蓉 联系人:魏素清 电话:010-66154828 传真:010-63583991 客服电话:400-6262-818 网址: http://www.5irich.com
39	宜信普泽(北京)基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区建国路 88 号楼 15 层 1809 法定代表人:戎兵 联系人:魏晨 电话:010-52413385 传真:010-85894285 客服电话:400-6099-200 网址: http://www.yixinfund.com
40	南京苏宁基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人:刘汉青 联系人:喻明明 电话:025-66996699-884131 传真:025-66008800-884131 客服电话:95177 网址: http://www.snjijin.com/
41	众升财富(北京)基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 法定代表人:李招弟 联系人:高晓芳 电话:010-59393923 传真:010-59393074 客服电话:400-876-9988

		网址: http://www.wy-fund.com
42	深圳腾元基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区华富街道深南中路 4026 号田面城市大厦 18 层 b 法定代表人:曾革 联系人:鄢萌莎 电话:0755-33376922 传真:0755-33065516 客服电话:4006877899 网址: http://www.tenyuanfund.com
43	北京恒天明泽基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛中心 30 层 法定代表人:周斌 联系人:陈霞 电话:15249236571 传真:010-59313586 客服电话:400-8980-618 网址: http://www.chtfund.com/
44	北京广源达信基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层 法定代表人:齐剑辉 联系人:王英俊 电话:010-57298634 传真:010-82055860 客服电话:4006236060 网址: http://www.niuniufund.com
45	上海大智慧基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元 法定代表人:申健 联系人:宋楠 电话:021-20219988-37492 传真:021-20219923 客服电话:021-20292031 网址: https://www.wg.com.cn/
46	济安财富(北京)基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层 法定代表人:杨健 联系人:李海燕 电话:010-65309516 传真:010-65330699 客服电话:400-673-7010 网址: http://www.jianfortune.com
47	上海联泰资产管理有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 楼 法定代表人:燕斌

		<p>联系人:兰敏 电话:021-52822063 传真:021-52975270 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.66zichan.com</p>
48	上海汇付基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人:金佶 联系人:陈云卉 电话:021-33323998 传真:021-33323837 客服电话:400-820-2819</p>
49	北京虹点基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元 法定代表人:郑毓栋 联系人:姜颖 电话:13522549431 传真:010-65951887 客服电话:400-068-1176 网址:http://www.hongdianfund.com</p>
50	上海陆金所基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 法定代表人:胡学勤 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:http://www.lufunds.com</p>
51	大泰金石基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址: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 客服电话:400-928-2266 网址:http://www.dtfortune.com/</p>
52	珠海盈米基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址: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 客服电话:020-89629066 网址:http://www.yingmi.cn</p>
53	中证金牛(北京)投资咨询有限	<p>办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球</p>

	公司 (注:只代销 A 份额。)	财讯中心 A 座 5 层 法定代表人:钱昊旻 联系人:仲甜甜 电话:010-59336492 传真:010-59336510 客服电话:010-59336512 网址: http://www.jnlc.com
54	大连网金基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2F 法定代表人:樊怀东 联系人:于舒 电话:0411-39027828 传真:0411-39027835 客服电话:4000-899-100 网址: http://www.yibaijin.com/
55	中民财富基金销售(上海)有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市黄浦区老太平弄 88 号 A、B 单元 法定代表人:弭洪军 联系人:茅旦青 电话:021-33355392 传真:021-63353736 客服电话:400-876-5716 网址: http://www.cmiwm.com/
56	中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号 729S 室 法定代表人:许欣 联系人:屠帅颖 电话:021-68609600 客服电话:400-700-9700 网址: http://www.qiangungun.com
57	万家财富基金销售(天津)有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层 法定代表人:李修辞 联系人:王芳芳 电话:010-59013842/18519215322 传真:010-59013828 网址: http://www.wanjiawealth.com
58	上海华夏财富投资管理有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 法定代表人:毛淮平 联系人:仲秋玥 电话:010-88066632 传真:010-88066214 客服电话:400-817-5666 网址: https://www.amcfortune.com/

59	国泰君安证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市静安区南京西路 768 号 法定代表人:杨德红 联系人:芮敏祺 电话:(021)38676666 传真:(021)38670666 客服电话:4008888666 网址: http://www.gtja.com
60	中信建投证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市东城区朝内大街 188 号 法定代表人:王常青 联系人:权唐 电话:(010) 65183880 传真:(010) 65182261 客服电话:400-8888-108 网址: http://www.csc108.com
61	国信证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 法定代表人:何如 联系人:周杨 电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 客服电话:95536 网址: http://www.guosen.com.cn
62	招商证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 法定代表人:霍达 联系人:林生迎 电话:(0755)82943666 传真:(0755)82943636 客服电话:4008881111、95565 网址: http://www.cmschina.com
63	中国银河证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层 法定代表人:陈共炎 联系人:辛国政 电话:010-83574507 传真:010-83574807 客服电话:400-8888-888 网址: http://www.chinastock.com.cn
64	海通证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市广东路 689 号 法定代表人:周杰 联系人:金芸、李笑鸣 电话:(021)23219000 传真:(021)23219100 客服电话:95553 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址: http://www.htsec.com
65	申万宏源证券有限公司	办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号

	(注:只代销 A 份额。)	法定代表人:李梅 联系人:陈宇 电话:021-33388214 传真:021-33388224 客服电话:95523 或 4008895523 网址: http://www.swhysc.com
66	安信证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 法定代表人:王连志 联系人:陈剑虹 电话:(0755) 82825551 传真:(0755) 82558355 客服电话:4008001001 网址: http://www.essence.com.cn
67	华泰证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: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) 客服电话:95597 网址: http://www.htsc.com.cn
68	中国中投证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中 心 A 座 4 层、18-21 层 法定代表人:高涛 联系人:胡芷境 电话:0755-88320851 传真:0755-82026539 客服电话:400 600 8008 网址: http://www.china-invs.cn
69	兴业证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:福建省福州市湖东路 268 号 法定代表人:杨华辉 联系人:乔琳雪 电话:021-38565547 客服电话:95562 网址: http://www.xyzq.com.cn
70	东方证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券 大厦 法定代表人:潘鑫军 联系人:孔亚楠 电话:(021)63325888 传真:(021)63326729 客服电话:95503 网址: http://www.dfzq.com.cn
71	方正证券股份有限公司	办公地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36

	(注:只代销 A 份额。)	号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 法定代表人:施华 联系人:丁敏 电话:(010)59355997 传真:(010)56437013 客服电话:95571 网址: http://www.foundersc.com
72	长城证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:曹宏 联系人:金夏 电话:(021)62821733 传真:(0755)83515567 客服电话:4006666888、(0755)33680000 网址: http://www.cgws.com
73	光大证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市静安区新闻路 1508 号 法定代表人:周健男 联系人:刘晨、李芳芳 电话:(021) 22169999 传真:(021) 22169134 客服电话:4008888788、10108998 网址: http://www.ebscn.com
74	广州证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 法定代表人:张永衡 联系人:林洁茹 电话:020-88836999 传真:020-88836654 客服电话:(020) 961303 网址: http://www.gzs.com.cn
75	东北证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:长春市生态大街 6666 号 法定代表人:李福春 联系人:安岩岩 电话:(0431)85096517 传真:(0431)85096795 客服电话:95360 网址: http://www.nesc.cn
76	华安证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 法定代表人:章宏韬 联系人:范超 电话:0551-65161821 传真:0551-65161672 客服电话:95318

		网址: http://www.hazq.com
77	财富证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际 财富中心 26-28 层 法定代表人:刘宛晨 联系人:郭静 电话:(0731)84403347 传真:(0731)84403439 客服电话:95317 网址: http://www.cfzq.com
78	华西证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号 法定代表人:杨炯洋 联系人:谢国梅 电话:(010)52723273 传真:(028)86150040 客服电话:95584 网址: http://www.hx168.com.cn
79	申万宏源西部证券有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦 法定代表人:李琦 联系人:王怀春 电话:0991-2307105 传真:0991-2301927 客服电话:4008-000-562 网址: http://www.swhysc.com/index.jsp
80	中泰证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 济南市市中区经七路 86 号 法定代表人:李玮 联系人:许曼华 电话:021-20315290 客服电话:95538 网址: http://www.zts.com.cn/
81	世纪证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层 法定代表人:姜昧军 联系人:方文 电话:(0755) 83199599 传真:(0755) 83199545 客服电话:(0755) 83199511 网址: http://www.csco.com.cn
82	第一创业证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 9、16-20 楼 法定代表人:刘学民 联系人:毛诗莉 电话:(0755)23838750 传真:(0755)25838701 客服电话:95358

		网址: http://www.firstcapital.com.cn
83	中航证券有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 中国北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 中航资本大厦 法定代表人:王晓峰 联系人:戴蕾 电话:(0791) 86768681 传真:(0791) 86770178 客服电话:400-8866-567 网址: http://www.avicsec.com/
84	华福证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层 法定代表人:黄金琳 联系人:张腾 电话:(0591) 87383623 传真:(0591) 87383610 客服电话:(0591) 96326 网址: http://www.hfzq.com.cn/
85	中国国际金融股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 法定代表人:丁学东 联系人:杨涵宇 电话:(010)65051166 传真:(010)85679203 客服电话:400 910 1166 网址: http://www.cicc.com.cn
86	联讯证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层 法定代表人:徐刚 联系人:彭莲 电话:0755-83331195 客服电话:95564 网址: http://www.lxsec.com
87	英大证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 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:杨洪飞 电话:0755-83007323 传真:0755-83007034 客服电话:4000-188-688 网址: http://www.vsun.com
88	宏信证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 法定代表人:吴玉明 联系人:刘进海

		电话:028-86199278 传真:028-86199382 客服电话:4008366366 网址: http://www.hx818.com
89	东海期货有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号、上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼 法定代表人:陈太康 联系人:李天雨 电话:021-68757102 传真:021-68757102 客服电话:95531/4008888588 网址: http://www.qh168.com.cn/
90	长江证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号 法定代表人:陈佳(代) 联系人:李良 电话:(027) 65799999 传真:(027) 85481900 客服电话:95579 或 4008-888-999 网址: http://www.cjsc.com
91	西南证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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:廖庆轩 联系人:张煜 电话:(023)63786141 传真:(023)6378212 客服电话:4008096096 网址: http://www.swsc.com.cn
92	湘财证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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:孙永祥 联系人:李欣 电话:(021)38784580 传真:(021)68865680 客服电话:95351 网址: http://www.xcsc.com
93	万联证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼 法定代表人:张建军 联系人:甘蕾 电话:020-38286026 客服电话:95322 网址: http://www.wlzq.com.cn
94	民生证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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

		<p>法定代表人:冯鹤年 联系人:程博怡 电话:(010)59355807 传真:(010)56437013 客服电话:400-619-8888 网址:http://www.mszq.com/</p>
95	国元证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:安徽省合肥市梅山路 18 号 法定代表人:蔡咏 联系人:陈玲玲 电话:(0551) 2246273 传真:(0551) 2272100 客服电话:95578 网址:http://www.gyzq.com.cn</p>
96	渤海证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦 A 座 法定代表人:王春峰 联系人:蔡霆 电话:(022)28451991 传真:(022)28451892 客服电话:4006515988 网址:http://www.bhzq.com</p>
97	山西证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心西塔楼 21 层 法定代表人:侯巍 联系人:郭熠 电话:(0351) 8686659 传真:(0351) 8686619 客服电话:400-666-1618 网址:http://www.i618.com.cn</p>
98	东兴证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)6、10、12、15、16 层 法定代表人:魏庆华 联系人:汤漫川 电话:(010) 66555316 传真:(010) 66555246 客服电话:400-8888-993 网址:http://www.dxzq.net</p>
99	东吴证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址:江苏省苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人:范力 联系人:方晓丹 电话:(0512)65581136 传真:(0512)65588021 客服电话:95330 网址:http://www.dwzq.com.cn</p>

100	信达证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人:张志刚 联系人:尹旭航 电话:(010)63081493 传真:(010)63081344 客服电话:95321 网址: http://www.cindasc.com
101	南京证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:江苏省南京市江东中路 389 号 法定代表人:步国旬 联系人:王万君 电话:(025)58519523 传真:(025)83369725 客服电话:95386 网址: http://www.njqz.com.cn
102	上海证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼 法定代表人:李俊杰 联系人:邵珍珍 电话:(021)53686888 传真:(021)53686100-7008 客服电话:(021)962518、4008918918 网址: http://www.shzq.com
103	新时代证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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:叶顺德 联系人:田芳芳 电话:(010)83561146 客服电话:95399 网址: http://www.xsdzq.cn
104	大同证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层 法定代表人:董祥 联系人:薛津 电话:(0351) 4130322 传真:(0351) 4130322 客服电话:4007121212 网址: http://dtsbc.com.cn/
105	国联证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:无锡市金融一街 8 号 法定代表人:姚志勇 联系人:祁昊 电话:0510-82831662 传真:0510-82830162 客服电话:95570 网址: http://www.glsc.com.cn

106	浙商证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:浙江省杭州市五星路 201 号 法定代表人:吴承根 联系人:许嘉行 电话:(0571) 87901912 传真:(0571) 87901913 客服电话:(0571) 967777 网址: http://www.stocke.com.cn
107	平安证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层 法定代表人:何之江 联系人:周一涵 电话:021-38637436 传真:021-58991896 客服电话:95511—8 网址: stock.pingan.com
108	国海证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦 法定代表人:何春梅 联系人:牛孟宇 电话:0755-83709350 传真:0771-5530903 客服电话:95563 (全国) 网址: http://www.ghzq.com.cn
109	东莞证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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:李荣 电话:(0769)22115712 传真:(0769)22115712 客服电话:95328 网址: http://www.dgzq.com.cn
110	中原证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:河南省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、李盼盼 电话:0371--69099882 传真:0371--65585899 客服电话:95377 网址: http://www.ccnew.com
111	国都证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 法定代表人:王少华 联系人:黄静 电话:(010)84183389

		传真:(010)84183311 客服电话:400-818-8118 网址: http://www.guodu.com
112	东海证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 客服电话:95531;400-888-8588 网址: http://www.longone.com.cn
113	中银国际证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层 法定代表人:宁敏 联系人:王炜哲 传真:(021)50372474 客服电话:4006208888 网址: http://www.bocichina.com
114	恒泰证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼 法定代表人:庞介民 联系人:熊丽 电话:(0471) 4972675 客服电话:4001966188 网址: http://www.cnht.com.cn
115	国盛证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:江西省南昌市北京西路 88 号 法定代表人:徐丽峰 联系人:占文驰 电话:(0791)86283372 传真:(0791)86281305 客服电话:4008222111 网址: http://www.gsstock.com
116	金元证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼 法定代表人:王作义 联系人:马贤清 电话:(0755)83025022 传真:(0755)83025625 客服电话:400-8888-228 网址: http://www.jyzq.cn
117	德邦证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼 法定代表人:武晓春 联系人:刘熠 电话:(021) 68761616

		传真:(021) 68767981 客服电话:4008888128 网址: http://www.tebon.com.cn
118	西部证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室 法定代表人:徐朝晖 联系人:梁承华 电话:(029)87416168 传真:(029)87406710 客服电话:95582 网址: http://www.west95582.com
119	华龙证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼 法定代表人:李晓安 联系人:范坤 电话:(0931) 4890208 传真:(0931) 4890628 客服电话:95368 网址: http://www.hlzq.com
120	财通证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716 室 法定代表人:陆建强 联系人:陶志华 电话:0571 - 87789160 传真:0571-87818329 客服电话:(0571)96336、962336(上海地区) 网址: http://www.ctsec.com
121	上海华信证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼 法定代表人:陈灿辉 联系人:倪丹 电话:021-38784818? 传真:021-68775878 客服电话:68777877 网址: http://www.shhxzq.com/
122	华鑫证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	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:俞洋 联系人:杨莉娟 电话:021-54967552 传真:021-54967032 客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918 网址: http://www.cfsc.com.cn
123	瑞银证券有限责任公司	办公地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金

	(注:只代销 A 份额。)	融中心 12、15 层 法定代表人:钱于军 联系人:牟冲 电话:(010) 58328112 传真:(010)58328748 客服电话:400-887-8827 网址: http://www.ubssecurities.com
124	中山证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层 法定代表人:黄扬录 联系人:罗艺琳 电话:0755-82570586 传真:0755-82960582 客服电话:95329 网址: http://www.zszq.com.cn
125	国融证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路 18 路 法定代表人:张智河 联系人:董晶珊 电话:(010)83991737 传真:(010)66412537 客服电话:4006609839 网址: http://www.grzq.com
126	江海证券有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:哈尔滨市松北区创新三路 833 号 法定代表人:赵洪波 联系人:周俊 电话:0451-85863726 传真:0451-82337279 客服电话:400-666-2288 网址: http://www.jhzt.com.cn/
127	中国民族证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层 法定代表人:姜志军 联系人:齐冬妮 电话:(010)59355807 传真:(010)56437013 客服电话:400-889-5618 网址: http://www.e5618.com
128	华宝证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层 法定代表人:陈林 联系人:夏元 电话:(021) 68777222 传真:(021) 68777822 客服电话:4008209898 网址: http://www.cnhbstock.com

129	长城国瑞证券有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼 法定代表人:王勇 联系人:林丹 电话:(0592)2079259 传真:(0592)2079602 客服电话:400-0099-886 网址: https://www.gwgsc.com/
130	爱建证券有限责任公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼 (陆家嘴商务广场) 法定代表人:祝健 联系人:姚盛盛 电话:(021) 32229888 传真:021-68728703 客服电话:4001962502 网址: http://www.ajzq.com
131	华融证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 18 层 法定代表人:祝献忠 联系人:李慧灵 电话:010-85556100 传真:010-85556088 客服电话:400-898-4999 网址: http://www.hrsec.com.cn
132	天风证券股份有限公司 (注:只代销 A 份额。)	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 法定代表人:余磊 联系人:岑妹妹 电话:027-87617017 传真:027-87618863 客服电话:4008005000 网址: http://www.tfzq.com
133	深圳众禄基金销售股份有限公司	办公地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:4006-788-887 网址: http://www.jjmmw.com ; https://www.zlfund.cn
134	奕丰基金销售有限公司	办公地址: 深圳市南山区蛇口街道后海滨路与海德三道交汇处航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人:TAN YIK KUAN 联系人:叶健

		<p>电话:0755-89460500 传真:0755-21674453 网址:https://www.ifastps.com.cn/</p>
135	广发证券股份有限公司	<p>办公地址: 广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、18 楼、19 楼、36 楼、38 楼、39 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼 法定代表人:孙树明 联系人:黄岚 电话:(020) 87555888 传真:(020) 87555305 客服电话:95575 或致电各地营业网点 网址:http://www.gf.com.cn</p>
136	中信证券股份有限公司	<p>办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 联系人:郑慧 电话:010-60838888 客服电话:95558 网址:http://www.cs.ecitic.com</p>
137	中信证券(山东)有限责任公司	<p>办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层 法定代表人:姜晓林 联系人:焦刚 电话:(0531) 89606166 传真:(0532) 85022605 客服电话:95548 网址:http://www.zxwt.com.cn</p>
138	中信期货有限公司	<p>办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1303-1305 室、14 层 法定代表人:张皓 联系人:刘宏莹 电话:010-60833754 传真:0755-83217421 客服电话:400-990-8826 网址:http://www.citicsf.com</p>
139	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 (注:只代销 A 份额。)	<p>办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006 法定代表人:马勇 联系人:文雯 电话:010-83363101 传真:010-83363072 客服电话:400-118-1166 网</p>

		址: http://www.xinlande.com.cn
140	腾安基金销售(深圳)有限公司 (注:只代销 C 份额。)	办公地址: 深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼 法定代表人:刘明军 联系人:谭广锋 电话:0755-86013388-80618 传真:- 客服电话:95017 网 址: http://www.tenganxinxi.com 或 http://www.txfund.com
141	北京百度百盈基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101 法定代表人:张旭阳 联系人:杨琳 电话:010-61952702 传真:010-61951007 客服电话:95055
142	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 12 楼 法定代表人:祖国明 联系人:韩爱彬 电话:021-60897840 传真:0571-26697013 客服电话:4000-766-123 网址: http://www.fund123.cn
143	北京汇成基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室 法定代表人:王伟刚 联系人:丁向坤 电话:010-56282140 传真:010-62680827 客服电话:400-619-9059 网址: http://www.hcjijin.com/
144	北京新浪仓石基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室 联系人:付文红 电话:010-62676405 传真:010-62676582 客服电话:010-62675369

		网址: http://www.xincai.com
145	上海万得基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 中国 (上海) 浦东新区福山路 33 号 9 楼 法定代表人:王廷富 联系人:姜吉灵 电话:021-68882280 传真:021-68882281 客服电话:400-821-0203 网 址: https://www.520fund.com.cn/
146	凤凰金信(银川)基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路 142 号 14 层办公房 法定代表人:程刚 联系人:张旭 电话:010-58160168 传真:010-58160173 客服电话:400-810-55919 网址: http://www.fengfd.com/
147	北京肯特瑞基金销售有限公司	办公地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06 法定代表人:江卉 联系人:江卉 电话:4000988511 传真:010-89188000 客服电话:010-89188462 网址: http://fund.jd.com
148	北京蛋卷基金销售有限公司	办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人:钟斐斐 联系人:侯芳芳 电话:010-61840688 传真:010-61840699 客服电话:400-159-9288 网址: http://www.ncfjj.com

(二) 基金注册登记机构

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) 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 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) 审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

四、基金名称

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%，以实现对

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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2019 年 1 月 17 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 2018 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	113,089,140.88	0.67
	其中: 股票	113,089,140.88	0.67
2	基金投资	15,801,236,109.69	93.14
3	固定收益投资	200,623,000.00	1.18
	其中: 债券	200,623,000.00	1.18
	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	706,111,557.42	4.16
8	其他资产	144,114,116.19	0.85
9	合计	16,965,173,924.18	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	215,625.00	0.00
B	采矿业	4,181,975.91	0.02
C	制造业	46,291,939.03	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,446,378.22	0.02
E	建筑业	4,421,489.95	0.03
F	批发和零售业	1,875,259.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,574,836.01	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,902,432.02	0.02
J	金融业	37,063,815.61	0.22
K	房地产业	5,360,711.06	0.03
L	租赁和商务服务业	1,385,465.48	0.01
M	科学研究和技术服务业	97,318.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理	265,477.73	0.00

	业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	618,467.60	0.00
R	文化、体育和娱乐业	387,949.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	113,089,140.88	0.67

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	127,663	7,161,894.30	0.04
2	600519	贵州茅台	5,362	3,163,633.62	0.02
3	600036	招商银行	121,651	3,065,605.20	0.02
4	600485	信威集团	200,616	2,926,987.44	0.02
5	601166	兴业银行	148,521	2,218,903.74	0.01
6	000651	格力电器	57,495	2,051,996.55	0.01
7	000333	美的集团	55,500	2,045,730.00	0.01
8	601328	交通银行	331,469	1,919,205.51	0.01
9	600016	民生银行	298,219	1,708,794.87	0.01
10	601288	农业银行	461,167	1,660,201.20	0.01

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	200,536,000.00	1.19
	其中:政策性金融债	200,536,000.00	1.19
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)	87,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,623,000.00	1.19

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	180209	18 国开 09	1,000,000	100,320,000.00	0.59
2	140303	14 进出 03	800,000	80,168,000.00	0.47
3	180207	18 国开 07	200,000	20,048,000.00	0.12
4	110049	海尔转债	870	87,000.00	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 支债券。

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 (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	15,801,236,109.69	93.60

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
IF1901	IF1901	100	90,108,000.00	-5,661,480.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-5,661,480.00
股指期货投资本期收益 (元)					-1,680,720.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-5,441,640.00

(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) 2018 年 3 月 16 日,中国人民银行发布银支付罚决字【2018】1 号,对中国民生银行股份有限公司厦门分行(新兴支付清算中心),违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,于 2018 年 3 月 14 日作出行政处罚决定,给予警告,没收违法所得 48,418,193.27 元,并处罚款 114,639,752.47 元,合计处罚金额 163,057,945.74 元。2018 年 12 月 7 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕8 号),对中国民生银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,同业投资违规接受担保等违规事实,于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定,罚款 3160 万元。2018 年 12 月 7 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕5 号),对中国民生银行股份有限公司贷款业务严重违反审慎经营规则的违规事实,于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定,罚款 200 万元。

2018 年 5 月 4 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕1 号),对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产等违规事实,于 2018 年 4 月 19 日作出行政处罚决定,罚款 5870 万元。

2018 年 8 月 1 日,中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1 号-5 号,于 2018 年 7 月 26 日作出行政处罚决定,对交通银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,处以 50 万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以 40 万元罚款;存在与身份不明的客户进行交易的行为,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(四)项规定,处以 40 万元罚款;对交通银行合计处以 130 万元罚款,并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项、第(三)项和第(四)项规定,对相关责任人共处以 8 万元罚款。2018 年 12 月 7 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕12 号),对交通银行股份有限公司不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权、未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产等违规事实,于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定,罚款 690 万元。2018 年 12 月 7 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕13 号),对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违规事实,于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定,罚款 50 万元。

2018 年 5 月 4 日, 中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表 (银监罚决字 (2018) 1 号), 对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则, 违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实, 于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定, 罚款 6570 万元, 没收违法所得 3.024 万元, 罚没合计 6573.024 万元。

本基金投资于“民生银行 (600016)”、“兴业银行 (601166)”、“交通银行 (601328)”、“招商银行 (600036)”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, 民生银行、兴业银行、交通银行、招商银行为标的指数的成份股, 本基金投资于“浦发银行”、“民生银行”、“兴业银行”、“交通银行”、“招商银行”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, 其他六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	12,461,519.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,310,058.45
5	应收申购款	125,342,537.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,114,116.19

(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	600485	信威集团	2,926,987.44	0.02	重大事项停牌

十二、基金业绩

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) 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

嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)A

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年年度	6.98%	2.35%	5.70%	2.36%	1.28%	-0.01%
2016年年度	-8.72%	1.32%	-10.63%	1.33%	1.91%	-0.01%
2017年年度	22.18%	0.60%	20.63%	0.60%	1.55%	0.00%
2018年年度	-22.78%	1.27%	-24.12%	1.27%	1.34%	0.00%

嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)C

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
2018年8月9日基金合同	-8.11%	1.43%	-8.68%	1.43%	0.57%	0.00%

生效日至 2018 年 12 月 31 日						
-----------------------------	--	--	--	--	--	--

(二) 自基金合同生效以来基金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

嘉实沪深300ETF联接(LOF)A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

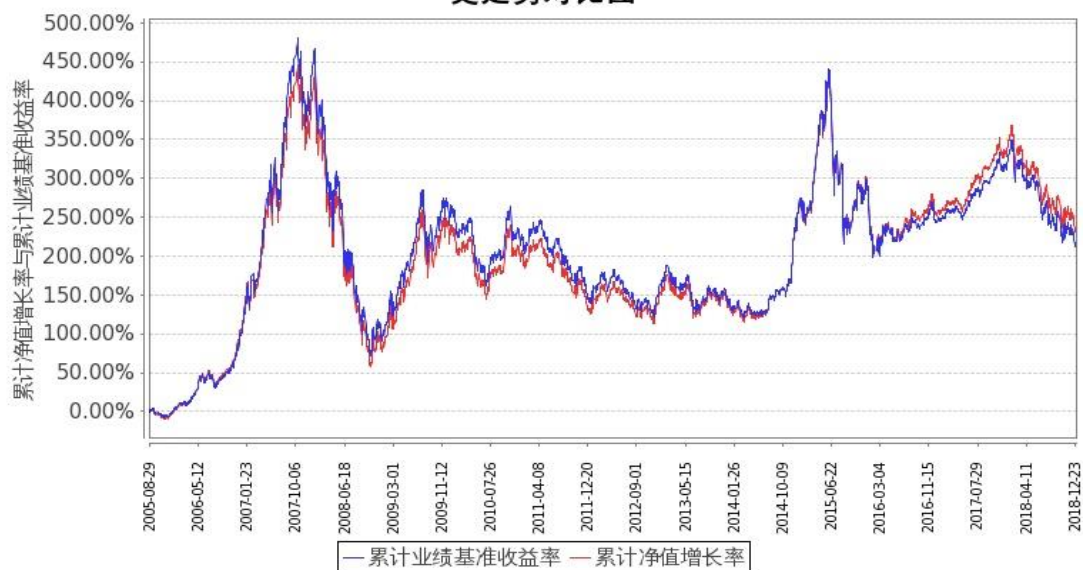


图 1：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005 年 8 月 29 日至 2018 年 12 月 31 日)

嘉实沪深300ETF联接(LOF)C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

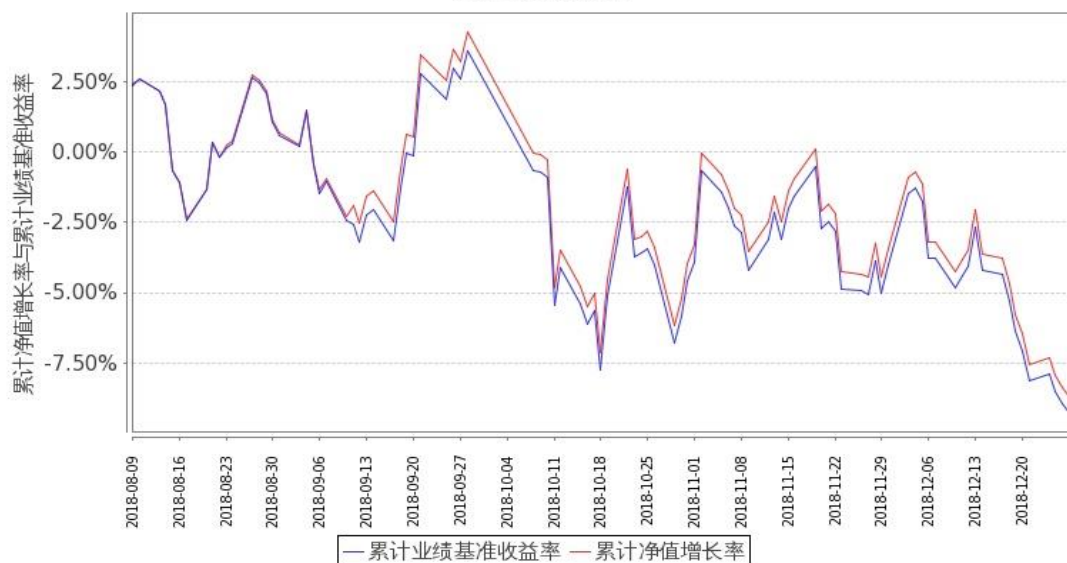


图 2: 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 8 月 9 日至 2018 年 12 月 31 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三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三个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3) 销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人, 经基金管理人分别支付给各个基金销售机构。

(4) 上述 1、与基金运作有关的费用的种类第 (3) — (6) 项、第 (8) 项费用, 除前款规定的费用外, 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。

(5) 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、基金托管费和/或销售服务费, 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、申购费率

(1) A 类基金份额的申购费率

本基金 A 类基金份额的申购费率不高于 1.5%, 随申购金额的增加而递减, 可适用以下前端收费费率标准:

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 A 类基金份额的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持卡人, 申购本基金 A 类基金份额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 A 类基金份额, 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 A 类基金份额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 A 类基金份额的, 前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注: 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

(2) 本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

2、赎回费率

(1) A 类基金份额的赎回费率

本基金 A 类基金份额的赎回费率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)。

1) A 类基金份额的场外赎回费率如下:

持有期限	赎回费率
持有期 < 七天	1.5%
七天 ≤ 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) A 类基金份额的场内赎回费率如下:

持有期限	赎回费率
持有期 < 七天	1.5%
持有期 ≥ 七天	0.5%

(2) C 类基金份额的赎回费率

本基金对持续持有 C 类基金份额少于 7 天的投资者收取的赎回费率为 1.5%。

具体如下表所示:

C 类基金份额		
赎回费率 (持有期 T)	T < 7 天	1.50%
	T ≥ 7 天	0

(3) 本基金 A 类基金份额的申购费率、本基金的赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内, 基金管理人可按中国证监会规定的程序调整 A 类基金份额申购费率、本基金的赎回费率, 并在《招募说明书》及其他公告进行公开披露。基金管理人调整 A 类基金份额申购费率、本基金的赎回费率应最迟在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站公告。

3、转换费

(1) 嘉实基本面 50 指数(LOF)A、嘉实中证中期企业债指数(LOF)A/C、嘉实惠泽混合(LOF)场外份额与嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)A 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:

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

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

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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 为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率 \geq 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。

其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,其余赎回费的 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)

转出基金有赎回费用的,收取该基金的赎回费用。从 0 申购费用基金向非 0 申购费用基金转换时,每次按照非 0 申购费用基金申购费用收取申购补差费;非 0 申购费用基金互转时,不收取申购补差费用。

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。

基金转换份额的计算方式如下:

$$\text{转出基金金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费用} = \text{转出基金金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转换费用} = \text{转出基金赎回费用} + \text{申购补差费用}$$

$$\text{净转入金额} = \text{转出基金金额} - \text{转换费用}$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

其中:① 若转出基金为 0 申购费用基金,则申购补差费用=转入基金申购费用,即:

申购补差费用 = (转出基金金额 - 转出基金赎回费用) \times 转入基金申购费率 \div (1 + 转入基金申购费率)

② 若转出基金为非 0 申购费用基金,则申购补差费用=0

(3) 通过网上直销系统办理基金转换业务(“后端转后端”模式)

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。

转出基金有赎回费用的, 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。

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, 针对以特定交易方式 (如网上交易等) 或在特定时间段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, 基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注: 嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币 A、嘉实逆向策略股票、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实稳祥纯债债券 C、嘉实稳华纯债债券、嘉实债券、嘉实货币 A、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 A、嘉实多元债券 B、嘉实信用债券 A、嘉实信用债券 C、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实纯债债券 A、嘉实纯债债券 C、嘉实货币 B、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 有单日单个基金账户账户的累计申购 (转入) 限制, 嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购和转入业务, 具体请见嘉实基金网站刊载的相关公告。定期开放类基金在封闭期内无法转换。

(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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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内容。
3. 在“四、基金托管人”部分: 更新了基金托管人的相关内容。
4. 在“五、相关服务机构”部分: 更新相关代销机构的信息。

5. 在“八、基金份额的申购与赎回”部分：更新了申购赎回的相关内容。
6. 在“九、基金份额的非交易过户和基金间转换”部分：更新了基金转换的相关内容。
7. 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。
8. 在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至 2018 年 12 月 31 日。
9. 在“二十五、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2018 年 8 月 28 日至 2019 年 2 月 28 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2019 年 4 月 12 日