

---

## 中海量化策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2020年第1号)

本基金基金合同于2009年6月24日生效。

### 重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

本基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

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《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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年12月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

邮政编码：200120

成立日期：2004年3月18日

---

法定代表人：杨皓鹏

总经理：杨皓鹏

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

联系人：葛玮赓

电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

|            |         |
|------------|---------|
| 中海信托股份有限公司 | 41.591% |
|------------|---------|

|            |         |
|------------|---------|
| 国联证券股份有限公司 | 33.409% |
|------------|---------|

|                   |         |
|-------------------|---------|
| 法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司 | 25.000% |
|-------------------|---------|

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司董事长、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理，中海信托股份有限公司总裁。

庞建先生，董事。中国人民大学本科毕业，高级会计师。现任中海石油财务有限责任公司总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计，渤海13/03合作区联管会财务专业代表，10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表，中国海洋石油总公司审计部干部，中海会计审计公司第三业务处干部、审计业务三部经理（副处级），中国海洋石油总公司（有限公司）审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查

---

经理、内审岗经理，中国海洋石油有限公司审计监察部总经理，中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任，中国海洋石油国际有限公司副总经理，中国海洋石油总公司资金部总经理。

杨皓鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委秘书、人力资源部经理、资产经营部经理，中海基金管理有限公司总经理助理、代理督察长。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司董事，兼华英证券有限责任公司董事。历任无锡市证券公司（国联证券前身）交易员，国联证券有限责任公司投资经理，无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理，锡洲国际有限公司投资部经理，中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司证券投资部总经理、副总裁、总裁。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、资产管理部总经理、总裁助理、副总裁。

Philippe CIEUTAT先生，董事。法国国籍。ESSEC管理研究生院硕士。现任爱德蒙得洛希尔（法国）执行委员、总干事。历任Mazars & Guerard审计咨询公司高级金融审计员，汇丰银行集团金融服务高级审计经理，汇丰银行全球资产管理公司财务总监，汇丰银行（法国）战略和计划主管，爱德蒙得洛希尔（巴黎）执行委员、财务及行政总监/爱德蒙得洛希尔（南非）执行副总监/爱德蒙得洛希尔集团财务总监、爱德蒙得洛希尔（法国）执行副总监。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDONG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。

---

现任北京市中伦律师事务所合伙人。历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

## 2、监事会成员

张悦女士，监事长。中海石油大学硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司党委委员、合规总监。历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监、党办主任、信托事务管理总部总经理、总稽核。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学硕士、法国国立电信管理学院硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理(香港)有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长以及爱德蒙得洛希尔（瑞士）业务发展经理。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司财务总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员、爱德蒙得洛希尔（瑞士）商务拓展部高级副总裁。

吴幸，职工监事。悉尼大学硕士。现任中海基金管理有限公司人力资源部副总经理。历任中海基金管理有限公司人力资源专员、人力资源高级经理。

章悦，职工监事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司监察稽核部总经理。历任德勤华永会计师事务所审计员，蒂森克虏伯电梯有限公司中国区总部内审经理，华宝兴业基金管理有限公司内控审计风险管理部高级内审经理、监察稽核部部门主管、监察稽核部部门总经理助理。

---

### 3、高级管理人员

杨皓鹏先生，总经理。复旦大学世界经济专业硕士。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委秘书、人力资源部经理、资产经营部经理。2017年7月进入本公司工作，曾任总经理助理，2017年8月至今任本公司总经理（期间2017年11月至2018年3月兼任本公司代理督察长），2017年9月至今任本公司董事，2017年11月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，历任本公司督察长、副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理，2014年5月至2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理，2019年5月至今兼任本公司首席信息官。

黄乐军先生，督察长。厦门大学法律硕士。历任北京近铁运通运输有限公司厦门分公司职员、上海市公安局副主任科员、上海证监局主任科员、海富通基金管理有限公司监察稽核总监。2018年2月进入本公司工作，2018年3月至今任本公司督察长。

### 4、基金经理

彭海平先生，中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2015年7月至2019年1月任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年4月至2019年3月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至2019年4月任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至2019年4月任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理，2016年4月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2018年9月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理。

## 5、历任基金经理

本基金基金合同于2009年6月24日生效，历任基金经理如下表：

| 基金经理姓名           | 管理本基金时间                |
|------------------|------------------------|
| YAN GANG LI（李延刚） | 2009年6月24日-2012年2月3日   |
| 笪菲               | 2012年2月4日-2013年2月7日    |
| 俞忠华              | 2013年2月8日-2013年10月23日  |
| 俞忠华、周其源          | 2013年10月24日-2015年1月17日 |
| 周其源              | 2015年1月18日-2016年12月19日 |
| 彭海平              | 2016年12月20日-至今         |

## 6、投资决策委员会成员

杨皓鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。

陆成来先生，委员。现任中海基金管理有限公司总经理助理, 代固定收益部总经理、代固定收益投资总监，代资产管理一部总经理、代投资总监。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司权益投资部总经理、权益投资总监、基金经理。

邱红丽女士，委员。现任中海基金管理有限公司研究部总经理、基金经理。

刘俊先生，委员。现任中海基金管理有限公司基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

---

联系人：郭明

## （二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## 三、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：杨皓鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

公司网址：www.zhfund.com

##### （2）中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：刘承来

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：郑健

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

---

公司网站: [www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

2、代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 陈四清

联系人: 杨菲

客户服务电话: 95588

公司网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(2)中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

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

法定代表人: 周慕冰

联系电话: 010-66060069

传真: 010-68121816

联系人: 林葛

客户服务电话: 95599

公司网址: [www.abccchina.com](http://www.abccchina.com)

(3)中国银行股份有限公司

住所: 北京西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 刘连舸

托管部门信息披露联系人: 王永民

传真: (010) 66594942

客户服务电话: 95566

公司网站: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(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

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(5)交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

电话：021—58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6)招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755—83199084

传真：0755-83195049

资产托管部信息披露负责人：张燕

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(7)中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

客户服务电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

---

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

电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：王志刚

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(9)平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系电话：(0755) 2219 7701

传真电话：021-50979507

联系人：高希泉

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(10)上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：021-61616206，021-61162137

传真：021-63604196

联系人：虞谷云、周毅

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(11)温州银行股份有限公司

住所：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

---

联系电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务电话：96699（浙江省内）、962699（上海地区）、0577-96699  
（其他地区）

公司网址：www.wzbank.cn

(12) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：王者凡

电话：010-85238890

客户服务电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

(13) 上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：施传荣

电话：(021) 38576666

传真：(021) 50105124

客户服务电话：(021) 962999

公司网站：www.srcb.com

(14) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

---

客户服务电话：95574

网址：<http://www.nccb.com.cn/>

(15)国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(16)中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

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：陈共炎

电话：010-83574507

传真：010-83574807

联系人：辛国政

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(17)长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

---

(18)海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(19)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：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：95587/400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

(20)申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(21)湘财证券股份有限公司

住所：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

---

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

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

客户服务电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

(22) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(23) 东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

(24) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

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：吴坚

电话：023-63786633

传真：023-63786212

联系人：张煜

客户服务电话：95355 、4008096096

公司网址： [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(25) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38676666

联系人：钟伟镇

客户服务电话：400-888-8666/95521

公司网址： [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(26) 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 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555305

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址： [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(27) 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：王作义

电话：0755-83025693

传真：0755-83025625

联系人：刘萍

客户服务电话：95372

公司网址：www.jyzq.cn

(28)招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

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：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(29)东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：陈耀庭

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客户服务电话：95531 或 400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

(30)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

电话：021-68604866



---

传真：021-50372474

联系人：许慧琳

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

(31)平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

公司网址：stock.pingan.com

(32)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 34 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

法定代表人：王连志

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(33)光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

---

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(34) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：021-95503 或 4008-888-506

公司网址：www.dfzq.com.cn

(35) 华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656、4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：400-689-8888

公司网址：www.hlzqgs.com

(36) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

---

(37) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(38) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：<https://www.zts.com.cn/>

(39) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：0755-23838750

传真：0755-82485081

客户服务电话：95358

公司网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(40) 万联证券股份有限公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层

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：甘蕾

电话：020—37865070

联系人：王鑫

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

公司网址：www.wlzq.com.cn

(41)中国中金财富证券有限公司

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：胡芷境

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

客服电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

(42)申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

---

(43) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李飞

客户服务电话：400-8888-777

公司网址：www.gyzq.com.cn

(44) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市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

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

(45) 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：武晋婧

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

(46) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

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：唐静

---

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(47)方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远中心 4、5 号楼  
3701-3717

法定代表人：施华

联系人：丁敏

联系电话：010-59355997

传真：010-57398130

客户服务电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

根据《方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司关于实施经纪业务及客户整体迁移合并的联合公告》，方正证券、民族证券定于2019年5月24日日终清算完成后，实施客户及业务整体迁移合并，将民族证券的客户及业务整体迁移合并入方正证券。

(48)中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：王一通

客户服务电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(49)东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

---

法定代表人：李福春

客服热线：95360

邮编：130119

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

公司网站：www.nesc.cn

(50) 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：王虹

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(51) 东兴证券股份有限公司

住所：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：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net.cn

(52) 华宝证券有限责任公司

住所：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：宋歌

电话：021-68778010

---

传真：021-68778117

客服电话：400-820-9898、021-38929908

网址：www.cnhbstock.com

(53) 长城国瑞证券有限公司

住所：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

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：赵钦

客户服务电话：0592-5163588

公司网站：www.xmzq.cn

(54) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(55) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

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 20 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

联系电话：0532-89606165

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

(56) 华鑫证券有限责任公司



---

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）  
单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨丽娟

业务联系电话：021-64339000-807

客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918

公司网址：www.cfsc.com.cn

(57) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13  
层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13  
层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(58) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客户服务电话：95584 和 4008-888-818

公司网址：http://www.hx168.com.cn

(59) 中国国际金融股份有限公司

---

住所：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  
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  
联系电话：01065051166  
客服电话：4009101166  
公司网址：www.cicc.com.cn

(60)联讯证券股份有限公司

注册地址：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  
办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼  
法定代表人：严亦斌  
联系人：彭莲  
电话：0755-83331195  
传真：0752-2119660  
客户服务电话：95564  
网址：<http://www.ykzq.com>

(61)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳  
市前海商务秘书有限公司）  
办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A  
法定代表人：高锋  
联系人：廖苑兰  
电话：0755-83655588  
传真：0755-83655518  
客户服务电话：4008048688  
网址：[www.keynesasset.com](http://www.keynesasset.com)

(62)上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

---

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

(63) 东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法人代表：张运勇

电话：0769-22115712、0769-22119348

传真：0769-22119423

联系人：李荣、孙旭

客户服务电话：95328

公司网址：<http://www.dgzq.com.cn/>

(64) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(65) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

---

(66) 上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

业务联系人：郑茵华

联系电话：021-20691831

客服电话：400-089-1289

公司网址：www.erichfund.com

(67) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

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：余翼飞

联系电话：021-80358749

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(68) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835787

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

(69) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

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：朱玉

---

联系电话：021-54509977

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（70）浦领基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

公司网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（71）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～  
906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗珩

联系电话：021-20613999

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（72）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

联系电话：021-50583533

传真：021-61101630

客服电话：400-921-7755

公司网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

---

(73) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 号

法定代表人：罗细安

联系人：史丽丽

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(74) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：周斌

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址：www.chtfund.com

(75) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层 727 室

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系电话：010-63130889-8369

客服电话：400-166-1188

公司网址：8.jrj.com.cn

(76) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

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

法定代表人：凌顺平

---

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（77）中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号中期大厦 8 层

法定代表人：姜新

联系人：方艳美

联系电话：010-65807865

客服电话：010-65807865

公司网址：[www.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com)

（78）浙江金观诚基金销售有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系人：周圣熙

联系电话：0571-88337560

客服电话：400-068-0058

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

注：公司自 2019 年 2 月 1 日起暂停该机构办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。

（79）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

联系人：甄宝林

联系电话：021-34013996

---

客服电话：021-34013999

公司网址：<https://www.hotjijin.com>

（80）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

联系人：徐江

联系电话：0411-88891212-119

传真：0411-84396536

客服电话：400-0411-001

公司网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

（81）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

（82）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层

法定代表人：董浩

联系人：陈铭洲

联系电话：010-65951887

传真：010-65951887

客服电话：4000681176

公司网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)



---

(83) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 102 号 708 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

注：公司自 2019 年 1 月 30 日起暂停该机构办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。

(84) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：高皓辉

联系电话：021-63333389

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

公司网址：[www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

(85) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

---

公司网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(86) 奕丰基金销售有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEO WEE HOWE

联系人: 叶健

联系电话: 0755-89460500

传真: 0755-21674453

客服电话: 400-684-0500

公司网址: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(87) 安粮期货股份有限公司

住所: 安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层

办公地址: 安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层 (总部)

法定代表人: 朱中文

联系人: 梁蕾

联系电话: 0551-62870125

传真: 0551-62870131

客服电话: 400 626 9988

公司网址: <http://www.alqh.com/>

(88) 上海联泰基金销售有限公司

住所: 中国 (上海) 自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人: 燕斌

联系人: 陈东

联系电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客服电话: 4000-466-788

公司网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

---

(89) 北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(90) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：翟文

客户服务电话：4008188000

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(91) 深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

联系人：刘昕霞

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(92) 北京广源达信基金销售有限公司

---

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

电话：4006236060

传真：010-82055860

联系人：王英俊

客户服务电话：400-623-6060

公司网址：[www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

（93）上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客户服务电话：4006767523

公司网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

（94）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

联系电话：18601207732

传真：010-82057741

客服电话：4000888080

公司网址：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

（95）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

---

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

（96）北京懒猫金融信息服务有限公司

住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

电话：010-57649619

传真：010-57649620

联系人：朱翔宇

客户服务电话：010-57649619

公司网址：[www.lanmao.com](http://www.lanmao.com)

（97）一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312877

联系人：徐越

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

（98）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

---

电话：025-66996699-887226

传真：025-66008800-887226

联系人：张慧

客户服务电话：95177

公司网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

（99）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：吴季林

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com>

（100）上海景谷基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

法定代表人：袁飞

电话：61621602

传真：61621602\*819

联系人：袁振荣

客户服务电话：61621602

公司网址：[www.g-fund.com.cn](http://www.g-fund.com.cn)

（101）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

---

联系人：熊小满

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

（102）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122672

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客户服务电话：400-9180808

公司网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

（103）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块  
新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

电话：010-62675768

传真：010-62676582

联系人：赵芯蕊

客户服务电话：010-62675369

公司网址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

（104）天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-1 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

---

联系人：郭宝亮

客服电话：400-111-0889

公司网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

（105）上海华信证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：郭林

电话：021-63898427

传真：021-68776977-8427

联系人：徐璐

客户服务电话：400-820-5999

公司网址：[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

（106）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

（107）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：江辉



---

客户服务电话：400-820-1515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

（108）南京途牛基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

联系人：张士帅

联系电话：025-86853969

客服电话：4007-999-999

公司网址：<http://jr.tuniu.com>

（109）上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服电话：400-821-0203

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（110）杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：张丽琼

联系电话：0571-85262700

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86915761

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

（111）北京植信基金销售有限公司

---

住所：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：杨纪锋

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：400-680-2123

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

（112）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客服电话：95118

网址：<http://fund.jd.com/>

（113）上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系人：郑秋月

联系电话：021-80234888-6694

传真：021-80234898

客服电话：4006991888

公司网址：[www.998fund.com](http://www.998fund.com)

（114）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

---

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：徐英

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

（115）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

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：010-63136184

客服电话：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

（116）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）

第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客户服务电话：4000279899

公司网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

（117）和耕传承基金销售有限公司

住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

法定代表人：李淑慧

联系人：罗聪

---

客户服务电话：0371-85518396

公司网址：www.hgccpb.com

（118）徽商期货有限责任公司

住所：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

办公地址：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

法定代表人：吴国华

联系人：申倩倩

客户服务电话：4008878707

公司网址：[www.hsqh.net](http://www.hsqh.net)

（119）北京微动利基金销售有限公司

住所：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：季长军

联系人：何鹏

客户服务电话：400-819-6665

公司网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

（120）成都华羿恒信基金销售有限公司

住所：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

法定代表人：赵壁

联系人：徐莉

客户服务电话：400-8010-009

公司网址：<http://www.huayihengxin.com>

（121）上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

---

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

联系电话：021-50810687

客服电话：021-50810673

公司网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

（122）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

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

联系电话：021-20219988

客服电话：021-20292031

网址：<https://www.wg.com.cn/>

（123）北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68292940

传真：010-68292964

客户服务电话：400-600-0030

网址：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

（124）北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层

法定代表人：蒋煜

---

联系人：刘聪慧/徐晓荣

电话：010-58170905/010-58170876

传真：010-58100800

客户服务电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com.cn

（125）北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

（126）北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

联系人：赵立芳

客户服务电话：400-100-3391

公司网址：<http://www.dianyingfund.com/>

（127）万家财富基金销售（天津）有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓  
2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客户服务电话：010-59013825

公司网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

（128）深圳前海财厚基金销售有限公司

---

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室

法定代表人：杨艳平

联系人：胡闻智

客户服务电话：400-128-6800

公司网址：[www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

（129）西藏东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

（130）北京百度百盈基金销售有限公司

住所：北京市海淀区上地十街10号百度大厦

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

联系人：孙博超

电话：010-61952703

客服电话：95055-4

公司网址：[www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

---

(二) 注册登记机构

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：杨皓鹏

总经理：杨皓鹏

成立日期：2004 年 3 月 18 日

电话：021-38429808

传真：021-68419328

联系人：周琳

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

法定代表人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：廖海、黎明

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-58153000



---

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、蔺育化

#### 四、基金的名称

中海量化策略混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

根据量化模型，精选个股，积极配置权重，谋求基金资产的长期稳定增值。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品（如股指期货、期权等衍生品），基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 八、基金的投资理念

以量化模型作为资产配置与构建投资组合的基础，以理性的积极投资管理获取长期的稳健收益。

---

## 九、基金的投资策略

本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上，通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置，动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。同时，本基金运用现代金融工程技术，对各类宏观经济指标与股票市场的领先滞后关系与相关性进行分析，筛选出一组针对股票市场的宏观经济领先指标。此外，本基金将采用我公司的市场泡沫度模型（SMBMM, Stock Market Bubble Measure Model）定期计算股票市场的泡沫度，以度量市场情绪状况。这些宏观经济领先指标和市场泡沫度模型将用于辅助大类资产配置。

### 1、股票投资

本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略，施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。

首先，选取代表性最强的反映公司盈利能力的指标，主要包括过去三年平均 EPS、ROE、毛利率三项指标，对所有 A 股上市公司进行筛选从而得到一级股票库。

其次，在一级股票库初选的基础之上，本基金选取相应的盈利性指标、估值指标以及一致预期指标，基于熵值法确定各个指标权重，对一级库股票进行打分排名，从而筛选出二级股票库。其中，盈利性指标包括过去三年平均毛利率、EPS 及 ROE；估值指标包括 PE、PB、PS、PCF 及 PEG 等指标；一致预期指标包括 EG、RC、RA 及 EY 等指标。

在选股指标权重的确定上，以往对于选股指标权重的确定主要采用主观评定法或是简单等权法。“熵值法”动态赋权的特点在于可根据市场情况的变化而动态量化赋权，即若所有股票的某项选股指标差异度高，则该指标的权重就会相对较高；相反，若所有股票的某项指标差异度低，则该指标的权重就会相对较低。

最后，在行业权重配置方面，我们采用 Black-Litterman 模型（以下简称 BL 模型），结合市场均衡状态和一致预期数据计算出最优行业配置权重。结合 BL 模型给出的行业配置权重，我们确定股票组合每只股票的配置比例。

### 2、债券投资

---

债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

本基金债券投资组合资产配置采用自上而下的方法，个券选择采用自下而上的方法，具体债券资产配置、个券选择及投资流程如下：

（1）债券资产配置方法：自上而下。

1) 根据利率变化趋势，确定债券投资组合的久期配置和风险管理方案。

利用中海宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置和风险管理方案。

2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析，选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3) 依据信用利差分析，对债券类别进行自上而下资产配置

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

（2）个券选择方法：自下而上。

通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择基于相对价值和流动性进行。

---

普通债券上，本基金认为普通债券，包括国债、金融债、企业债和公司债的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并帮助找出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择投资于定价低估的债券品种。

企业债券类证券（包括企业债、公司债、可分离债的债券部分）是获得较高投资收益不可忽视的一部分，也是本基金在力争在低风险下获取较高收益时将采取的主要投资策略。本基金结合对宏观经济态势的判断与企业的盈利性、成长性评估债券的信用风险，本基金将在该风险评估基础上，依据对企业所处行业的研究以及企业自身发展与偿还能力的分析选择符合目标久期和资产配置需要的企业债券类证券以期获得高于基准的收益。

可转债品种上，本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资，着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行投资。

### （3）债券投资流程

具体流程上，本基金债券投资组合管理分为三个主要阶段：投资规划、投资实施、投资反馈调整阶段。按照以下步骤进行：

#### 第一阶段：投资规划

##### 1) 分析研究

研究发展部、固定收益部根据宏观经济数据，并跟踪中国人民银行及各部委的各项政策，研究各种政策的力度和影响，分析判断宏观经济变化趋势，确定市场利率变化方向，定期或不定期地出具债券市场研究报告。

##### 2) 投资计划

在上述研究的基础上，由基金经理结合市场情况，拟定投资计划，供投资决策委员会讨论。

##### 3) 资产配置策略

投资决策委员会定期召开会议，依据研究发展部、固定收益部、基金经理的研究分析报告，确定债券组合的久期等配置。

---

## 第二阶段：投资实施

### 4) 投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的资产配置策略，结合债券研究报告，确定券种的具体选择，并负责日常的维护和调整。

### 5) 投资决策交易执行

交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行交易计划。在各种交易平台完成交易，并将交易结果反馈基金经理。

## 第三阶段：投资反馈调整

### 6) 投资组合动态调整

基金经理负责对投资组合进行动态调整。金融工程研究小组分析当前收益率曲线的形态，以及各市场之间的差异，发掘其中可能的套利机会，供基金经理参考，适时调整组合。

## 3、资产支持证券投资

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，深入分析影响资产支持证券定价的多种因素，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。基于稳健投资规避信用风险，本基金只投资于信用评级为 AAA 的资产支持证券品种。

## 4、权证投资

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，利用 Black-Scholes-Merton 模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，权证投资策略主要从价值投资的角度出发，采用如下策略进行权证投资：

### （1）套利投资策略

在权证和标的股票之间出现套利机会时，对权证进行套利投资。

### （2）风险锁定策略

根据认沽权证和标的股票之间的价差，在投资标的股票的时候，同时投

---

资认沽权证，锁定投资风险。

### （3）股票替代策略

在价值投资的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，寻找溢价率低（甚至折价）的权证，利用权证替代股票，以期降低风险或提高潜在收益。

由于权证市场的高波动性，本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险，寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。

### （4）杠杆投资策略

对以根据量化模型所选品种为标的的股票权证进行模型定价研究，利用权证的杠杆效应，以期获得超额收益。

## 十、基金的投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定。

（5）现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

---

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用登记下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

（10）本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。

（11）一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整。

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（13）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（14）本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

（15）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合

---

比例符合《基金合同》的有关约定。

除上述第(5)、(6)、(12)、(13)项另有规定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。

2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券。
- (2) 向他人贷款或者提供担保。
- (3) 从事承担无限责任的投资。
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券。
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。因此业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。

本基金股票组合的业绩基准采用沪深300指数；本基金债券组合的业绩基准采用中国债券总指数。

沪深300指数于2005年4月正式发布，是反映沪深两个市场整体走势的“晴



---

雨表”。沪深300指数的运行结果显示，该指数走势强于上证综合指数和深证综合指数。沪深300指数成份股为A股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于2003年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息（[www.chinabond.com.cn](http://www.chinabond.com.cn)）上公开发布。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十二、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

## 十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定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为截至2019年9月30日报告期末的第三季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

### 1、基金资产组合情况

截至2019年9月30日，中海量化策略混合型证券投资基金资产净值为403,175,458.86元，基金份额净值为1.017元，累计基金份额净值为1.554元。其资产组合情况如下：

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 382,572,716.41 | 87.70        |
|    | 其中：股票             | 382,572,716.41 | 87.70        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 21,118,887.90  | 4.84         |
|    | 其中：债券             | 21,118,887.90  | 4.84         |
|    | 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      | 25,863,833.06  | 5.93         |
| 8  | 其他资产              | 6,678,050.60   | 1.53         |
| 9  | 合计                | 436,233,487.97 | 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              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 138,734,838.88 | 34.41        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 156,179,549.33 | 38.74        |
| J  | 金融业              | 87,655,738.20  | 21.74        |
| K  | 房地产业             | 2,590.00       | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 382,572,716.41 | 94.89 |

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  | 300253 | 卫宁健康 | 2,061,503 | 32,736,667.64 | 8.12         |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 2,163,300 | 31,973,574.00 | 7.93         |
| 3  | 600588 | 用友网络 | 1,033,277 | 31,917,926.53 | 7.92         |
| 4  | 603690 | 至纯科技 | 1,400,390 | 31,648,814.00 | 7.85         |
| 5  | 002371 | 北方华创 | 479,671   | 31,456,824.18 | 7.80         |
| 6  | 600845 | 宝信软件 | 875,828   | 31,319,609.28 | 7.77         |
| 7  | 300451 | 创业慧康 | 1,607,844 | 28,008,642.48 | 6.95         |
| 8  | 300604 | 长川科技 | 1,330,964 | 27,923,624.72 | 6.93         |
| 9  | 603019 | 中科曙光 | 708,920   | 24,337,223.60 | 6.04         |
| 10 | 300567 | 精测电子 | 494,808   | 23,132,274.00 | 5.74         |

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      | 21,118,887.90 | 5.24         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 21,118,887.90 | 5.24         |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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  | 019611 | 19 国债 01 | 211,210 | 21,118,887.90 | 5.24         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

（3）本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 截至 2019 年 9 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 180,006.73   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 346,071.13   |
| 5  | 应收申购款   | 6,151,972.74 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 6,678,050.60 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 十四、基金的业绩

本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。基金业绩数据截至 2019 年 9 月 30 日。

基金本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

|                           |          |        |          |        |          |         |
|---------------------------|----------|--------|----------|--------|----------|---------|
| 2009. 06. 24-2009. 12. 31 | 4. 10%   | 1. 81% | 13. 08%  | 1. 68% | -8. 98%  | 0. 13%  |
| 2010. 01. 01-2010. 12. 31 | 6. 38%   | 1. 34% | -9. 35%  | 1. 27% | 15. 73%  | 0. 07%  |
| 2011. 01. 01-2011. 12. 31 | -20. 27% | 1. 19% | -19. 41% | 1. 04% | -0. 86%  | 0. 15%  |
| 2012. 01. 01-2012. 12. 31 | 7. 27%   | 1. 19% | 6. 87%   | 1. 02% | 0. 40%   | 0. 17%  |
| 2013. 01. 01-2013. 12. 31 | -6. 01%  | 1. 25% | -6. 22%  | 1. 12% | 0. 21%   | 0. 13%  |
| 2014. 01. 01-2014. 12. 31 | 18. 37%  | 0. 91% | 42. 96%  | 0. 97% | -24. 59% | -0. 06% |
| 2015. 01. 01-2015. 12. 31 | 31. 76%  | 2. 62% | 7. 38%   | 1. 99% | 24. 38%  | 0. 63%  |
| 2016. 01. 01-2016. 12. 31 | -1. 84%  | 1. 69% | -8. 54%  | 1. 12% | 6. 70%   | 0. 57%  |
| 2017. 01. 01-2017. 12. 31 | -2. 65%  | 1. 13% | 16. 89%  | 0. 51% | -19. 54% | 0. 62%  |
| 2018. 01. 01-2018. 12. 31 | -25. 59% | 2. 35% | -19. 05% | 1. 07% | -6. 54%  | 1. 28%  |
| 2019. 1. 1-2019. 6. 30    | 34. 70%  | 2. 25% | 21. 78%  | 1. 11% | 12. 92%  | 1. 14%  |
| 2019. 7. 1-2019. 9. 30    | 14. 92%  | 1. 97% | 0. 09%   | 0. 76% | 14. 83%  | 1. 21%  |
| 自基金合同生效起至今                | 52. 82%  | 1. 68% | 34. 07%  | 1. 20% | 18. 75%  | 0. 48%  |

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费。
- 2、基金托管人的托管费。
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费。
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金的证券交易费用。
- 7、基金的银行汇划费用。
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金合同终止、基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场

---

价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

---

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用。

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理人费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理人费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理人费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

#### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十六、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”部分，对相关内容进行补充。

（二）在“基金管理人”部分，对“主要人员情况”进行了更新。

（三）对“基金托管人”部分进行了更新。

（四）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（五）在“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（六）对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。

（七）在“其他应披露的事项”部分，披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇二〇年二月十二日