

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会 2015 年 10 月 27 日证监许可

[2015]2380 号《关于准予嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，并于 2016 年 12 月 8 日经机构部函[2016]3122 号《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》确认。本基金基金合同于 2017 年 7 月 4 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

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。

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 2018 年 1 月 4 日（特别事项注明除外），有关财务数据 and 净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日（未经审计）。

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、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

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，代任公司总经理，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。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任证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，JPMorgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JPMorgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990 年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990 年 2 月至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限

公司总经理；1994 年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004 年至今任万盟并购集团董事长。

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。

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

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

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

2、基金经理

（1）现任基金经理

张自力先生，理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有 20 年公募基金从业经验。曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。2013 年 6 月 14 日起担任嘉实美国成长股票型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月 9 日起担任嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理。2017 年 7 月 1 日至今任嘉实量化阿尔法混合基金经理。2017 年 7 月 4 日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

无。

3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼股票投资业务联席 CIO 邵健先生，公司代总经理赵学军先生，股票投资业务联席 CIO 兼研究总监陈少平女士，助理 CIO 兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理胡涛先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

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

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016中国最佳银行，《环球金融》2016中国最佳消费者银行、2016亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016年世界银行1000强排名中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常态化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珺，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持以客户为中心的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。

截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家QFII等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家最佳托管银行。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构:

(1) 嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址 北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心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 电话 0591-88013670

联系人 吴志锋

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址 南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室

电话 (025) 66671118 传真 (025) 66671100

联系人 徐莉莉

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元

电话 (020) 87555163 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

2、代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所、办公地址 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人 易会满 联系人 杨菲

传真 010-66107914

网址 www.icbc.com.cn 客服电话 95588

(2) 中国银行股份有限公司

办公地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

注册地址 北京市西城区复兴门内大街 1

法定代表人 陈四清

电话 (010)66596688 传真 (010)66594946

网址 www.boc.cn 客服电话 95566

(3) 中国建设银行股份有限公司

住所 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人 田国立

网址 www.ccb.com 客服电话 95533

(4) 招商银行股份有限公司

住所、办公地址 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人 李建红 联系人 邓炯鹏

电话 (0755) 83198888 传真 (0755) 83195050

网址 www.cmbchina.com 客服电话 95555

(5) 中信银行股份有限公司

住所、办公地址 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人 李庆萍 联系人 廉赵峰

网址 bank.ecitic.com 客服电话 95558

(6) 上海银行股份有限公司

住所、办公地址 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人 金煜 联系人 汤征程

电话 021-68475888 传真 021-68476111

网址 www.bankofshanghai.com 客服电话 95594

(7) 北京农村商业银行股份有限公司

办公地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

注册地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

法定代表人 王金山 联系人 王薇娜

电话 (010)85605006 传真 (010)85605345

网址 www.bjrcb.com 客服电话 96198

(8) 乌鲁木齐商业银行股份有限公司

住所 乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址 乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦

法定代表人 农惠臣 联系人 何佳

电话 (0991)8824667 传真 (0991)8824667

网址 www.uccb.com.cn 客服电话 (0991)96518

(9) 苏州银行股份有限公司

办公地址 江苏省苏州市钟园路 728 号

注册地址 江苏省苏州市东吴北路 143 号

法定代表人 王兰凤 联系人 熊志强

电话 0512-69868390 传真 0512-69868370

网址 www.suzhoubank.com 客服电话 0512-96067

(10) 福建海峡银行股份有限公司

办公地址 福建省福州市国货西路 188 号

注册地址 福建省福州市六一北路 158 号

法定代表人 郭运濂 联系人 吴白玫

电话 0591-87838759 传真 0591-87388016

网址 www.fjhxbank.com 客服电话 4008939999

(11) 桂林银行股份有限公司

办公地址 广西桂林市象山区中山南路 76 号

注册地址 广西桂林市象山区中山南路 76 号

法定代表人 王能 联系人 周佩玲

传真 0773-3851691

网址 www.guilinbank.com.cn 客服电话 4008696299

(12) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

注册地址 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人 汪静波 联系人 张裕

电话 021-38509735 传真 021-38509777

网址 www.noah-fund.com 客服电话 400-821-5399

(13) 深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

注册地址 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 II 单元

法定代表人 薛峰 联系人 童彩平

电话 0755-33227950 传真 0755-33227951

网址 www.zlfund.cn 客服电话 4006-788-887

(14) 上海天天基金销售有限责任公司

办公地址 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

注册地址 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人 其实 联系人 潘世友

电话 021-54509998 传真 021-64385308

网址 <http://www.1234567.com.cn/> 客服电话 95021

(15) 上海好买基金销售有限公司

办公地址 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

注册地址 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人 杨文斌 联系人 张茹

电话 021-20613999 传真 021-68596916

网址 www.ehowbuy.com 客服电话 4007009665

(16) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

注册地址 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人 张跃伟 联系人 单丙焯

电话 021-20691869 传真 021-20691861

网址 www.erichfund.com 客服电话 400-089-1289

(17) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

注册地址 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人 凌顺平 联系人 林海明

传真 0571-86800423

网址 www.5ifund.com 客服电话 4008-773-772

(18) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

注册地址 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人 闫振杰 联系人 李静如

电话 010-59601366-7024

网址 www.myfund.com 客服电话 4008886661

(19) 上海利得基金销售有限公司

办公地址 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

注册地址 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人 李兴春 联系人 曹怡晨

电话 021-50583533 传真 021-50583633

网址 www.leadfund.com.cn 客服电话 400-921-7755

(20) 嘉实财富管理有限公司

住所 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人 赵学军 联系人 景琪

电话 021-20289890 传真 021-20280110

网址 www.harvestwm.cn 客服电话 400-021-8850

(21) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

办公地址 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

注册地址 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人 戎兵 联系人 魏晨

电话 010-52413385 传真 010-85894285

网址 www.yixinfund.com 客服电话 400-6099-200

(22) 深圳腾元基金销售有限公司

办公地址 广东省深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 室

注册地址 广东省深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 室

法定代表人 曾革 联系人 鄢萌莎

电话 0755-33376922 传真 0755-33065516

网址 www.tenyuanfund.com 客服电话 4006877899

(23) 北京植信基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑 10 号

注册地址 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人 于龙 联系人 吴鹏

电话 010-56075718 传真 010-67767615

网址 www.zhixin-inv.com 客服电话 400-680-2123

(24) 北京广源达信基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

注册地址 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人 齐剑辉 联系人 王英俊

电话 010-57298634 传真 010-82055860

网址 www.niuniufund.com 客服电话 4006236060

(25) 上海汇付金融服务有限公司

办公地址 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

注册地址 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人 冯修敏 联系人 陈云卉

电话 021-33323998 传真 021-33323837

网址 暂无 客服电话 400-820-2819

(26) 上海中正达广投资管理有限公司

办公地址 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

注册地址 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人 黄欣 联系人 戴珉微

电话 021-33768132 传真 021-33768132*802

网址 <http://www.zzwealth.cn> 客服电话 400-6767-523

(27) 北京虹点基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼 2 层

注册地址 北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼 2 层

法定代表人 董浩 联系人 姜颖

电话 13522549431 传真 010-65951887

网址 www.jimufund.com 客服电话 400-068-1176

(28) 大泰金石基金销售有限公司

办公地址 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼中心

注册地址 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人 袁顾明 联系人 朱海涛

电话 15921264785 传真 021-20324199

网址 <http://www.dtfunds.com> 客服电话 400-928-2266

(29) 珠海盈米财富管理有限公司

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

注册地址 广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人 肖雯 联系人 黄敏嫦

电话 020-89629019 传真 020-89629011

网址 www.yingmi.cn 客服电话 020-89629066

(30) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

办公地址 北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

注册地址 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人 彭运年 联系人 仲甜甜

电话 010-59336492 传真 010-59336510

网址 www.jnlc.com/ 客服电话 010-59336512

(31) 广发证券股份有限公司

住所 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址 广东省广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人 孙树明 联系人 黄岚

电话 (020) 87555888 传真 (020) 87555305

网址 www.gf.com.cn 客服电话 95575 或致电各地营业网点

(32) 中信证券股份有限公司

住所、办公地址 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人 张佑君 联系人 郑慧

电话 010-60838888

网址 www.cs.ecitic.com 客服电话 95558

(33) 申万宏源证券有限公司

住所、办公地址 上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

注册地址 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人 李梅 联系人 王叔胤

电话 021-33389888 传真 021-33388224

网址 www.swhysc.com 客服电话 021-962505/95523

(34) 安信证券股份有限公司

住所 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人 牛冠兴 联系人 陈剑虹

电话 (0755) 82825551 传真 (0755) 82558355

网址 www.essence.com.cn 客服电话 4008001001

(35) 中信证券(山东)有限责任公司

住所、办公地址 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼

法定代表人 杨宝林 联系人 吴忠超

电话 (0532) 85022326 传真 (0532) 85022605

网址 www.citicssd.com 客服电话 95548

(36) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人 薛峰 联系人 刘晨、李芳芳

电话 (021) 22169999 传真 (021) 22169134

网址 www.ebscn.com 客服电话 4008888788、10108998

(37) 广州证券股份有限公司

住所、办公地址 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人 邱三发 联系人 林洁茹

电话 020-88836999 传真 020-88836654

网址 www.gzs.com.cn 客服电话 (020) 961303

(38) 申万宏源西部证券有限公司

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

注册地址 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 258 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人 韩志谦 联系人 王怀春

电话 0991-2307105 传真 0991-2301927

网址 www.hysec.com 客服电话 4008-000-562

(39) 中泰证券股份有限公司

住所、办公地址 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人 李玮 联系人 许曼华

电话 021-20315290

网址 www.zts.com.cn 客服电话 95538

(40) 第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人 刘学民 联系人 毛诗莉

电话 (0755)23838750 传真 (0755)25838701

网址 www.firstcapital.com.cn 客服电话 95358

(41) 华福证券有限责任公司

住所 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人 黄金琳 联系人 张腾

电话 (0591) 87383623 传真 (0591) 87383610

网址 www.hfq.com.cn 客服电话 (0591) 96326

(42) 联讯证券股份有限公司

办公地址 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

注册地址 深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人 徐刚 联系人 彭莲

电话 0755-83331195

网址 www.lxsec.com 客服电话 95564

(43) 宏信证券有限责任公司

办公地址 四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 10 楼

注册地址 四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 11 楼

法定代表人 吴玉明 联系人 刘进海

电话 028-86199278 传真 028-86199382

网址 www.hxzq.cn 客服电话 4008366366

(44) 长江证券股份有限公司

住所、办公地址 湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人 杨泽柱 联系人 李良

电话 (027) 65799999 传真 (027) 85481900

网址 www.95579.com 客服电话 95579 或 4008-888-999

(45) 万联证券有限责任公司

住所、办公地址 广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

法定代表人 张建军 联系人 罗创斌

电话 (020) 37865070 传真 020-22373718-1013

网址 www.wlzq.com.cn 客服电话 4008888133

(46) 渤海证券股份有限公司

住所 天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人 王春峰 联系人 蔡霆

电话 (022)28451991 传真 (022)28451892

网址 www.ewww.com.cn 客服电话 4006515988

(47) 东吴证券股份有限公司

住所、办公地址 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

网址 www.dwzq.com.cn 客服电话 95330

(48) 信达证券股份有限公司

住所、办公地址 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人 张志刚 联系人 尹旭航

电话 (010)63081493 传真 (010)63081344

网址 www.cindasc.com 客服电话 95321

(49) 南京证券股份有限公司

住所、办公地址 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

网址 www.njq.com.cn 客服电话 95386

(50) 中原证券股份有限公司

住所、办公地址 郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人 菅明军 联系人 程月艳、李盼盼

电话 0371--69099882 传真 0371--65585899

网址 www.ccnew.com 客服电话 95377

(51) 国都证券股份有限公司

住所、办公地址 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人 王少华 联系人 黄静

电话 (010)84183389 传真 (010)84183311

网址 www.guodu.com 客服电话 400-818-8118

(52) 东海证券股份有限公司

住所、办公地址 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

法定代表人 赵俊 联系人 王一彦

电话 (021)20333333 传真 (021)50498825

网址 www.longone.com.cn 客服电话 95531;400-888-8588

(53) 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 联系人 马贤清

电话 (0755)83025022 传真 (0755)83025625

网址 www.jyzq.cn 客服电话 400-8888-228

(54) 西部证券股份有限公司

住所、办公地址 陕西省西安市东新街 232 号信托大厦 16-17 楼

法定代表人 刘建武 联系人 梁承华

电话 (029)87416168 传真 (029)87406710

网址 www.westsecu.com 客服电话 95582

(55) 华龙证券有限责任公司

住所、办公地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法定代表人 李晓安 联系人 李昕田

电话 (0931) 4890208 传真 (0931) 4890628

网址 www.hlzqgs.com 客服电话 (0931) 96668、4006898888

(56) 国金证券股份有限公司

办公地址 四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人 冉云 联系人 刘婧漪、贾鹏

电话 028-86690057、028-86690058 传真 028-86690126

网址 www.gjq.com.cn 客服电话 95310

(57) 华融证券股份有限公司

住所 北京市西城区金融大街 8 号

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

法定代表人 祝献忠 联系人 李慧灵

电话 010-85556100 传真 010-85556088

网址 www.hrsec.com.cn 客服电话 400-898-4999

(58) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

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

注册地址 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人 陈柏青 联系人 韩爱彬

电话 021-60897840 传真 0571-26697013

网址 <http://www.fund123.cn/> 客服电话 4000-766-123

(59) 北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址 北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦

注册地址 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

法定代表人 李昭琛 联系人 付文红

电话 010-62676405 传真 010-62676582

网址 <http://www.xincai.com/> 客服电话 010-62675369

(60) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司

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

注册地址 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 办公用房

法定代表人 程刚 联系人 张旭

电话 010-58160168 传真 010-58160173

网址 <http://www.fengfd.com/> 客服电话 400-810-55919

(61) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

注册地址 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

网址 fund.jd.com 客服电话 400-088-8816

(62) 北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区望京 SOHO

注册地址 北京市朝阳区望京 SOHO

法定代表人 钟斐斐 联系人 袁永姣

电话 010-61840688 传真 010-61840699

网址 <https://danjuanapp.com/> 客服电话 4000-618-518

(二) 登记机构

名称 嘉实基金管理有限公司

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

办公地址 北京市建国门北大街8号华润大厦8层

法定代表人 赵学军

联系人 彭鑫

电话 (010) 65215588

传真 (010) 65185678

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市源泰律师事务所

住所、办公地址 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人 廖海 联系人 刘佳

电话 (021) 51150298-827 传真 (021) 51150398

经办律师 廖海、刘佳

(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 号企业天地 2 号楼普华永道中心 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、基金的名称

本基金名称：嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采用积极、主动的量化投资策略，以中小企业经营、发展和创新的内在活力为研究基础，通过系统的专业性研究分析，积极挖掘符合经济规律及产业发展规律的优质中小企业所蕴含的投资机会，在严控投资风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。

七、基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、大额存单、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，本基金投资于本基金界定的中小企业类股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

立足于中国资本市场独特的变化，利用综合评价对中小企业经营、发展和创新的内在活力进行由点到面的多层次量化分析，构建包含中小企业投资价值、成长性、创新力、经营质量、管理层模式以及企业文化等方面的全方位投资策略，优选增长潜力最大的中小企业股票进行投资。

1、大类资产配置

本基金重点配置股票资产，同时将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经

济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

2、股票投资策略

(1) 中小企业的定义

本基金每半年对中证 500 指数成分股按总市值从小到大进行排序，剔除 ST、*ST 类股票，全市场 A 股总市值小于等于中证 500 指数成分股中最大市值的所有股票，称之为中小企业类股票。对于未纳入最近一次排序范围的股票（如未上市新股、长期停牌股票等），如果本基金管理人预计的总市值可满足以上标准，将纳入本次排序范围。

本基金对于中小企业股票的界定方式将随中国证券市场未来的发展与变革情况作出相应的调整。

(2) 多层次的量化投资策略

本基金管理人认为，中小企业活力是指中小企业作为市场经济的参与者，遵循客观的经济规律，在参与市场经济活动的过程中，发挥自身的优势特征如变革精神、主动性以及创新性，在市场经济活动中呈现出来一种良性循环的企业发展模式。以中小企业活力为基础研究对象，融合金融理论和数量统计分析，采用综合评级的模式分析优势中小企业投资群体的行为特征，通过对量化投资因子的数量研究，把握中小企业活力动态变化的本质规律和演化过程，为投资实践提供有效的决策依据。

A. 中小企业的投资价值分析

中小企业的投资价值受到宏观经济形势、国家产业政策、行业自身基本面等多种因素的共同影响，本基金通过对中小企业群体性活力特征的梳理，将分析经济周期的不同阶段对中小企业投资价值的影响，并利用综合评级的模式系统分析国家产业政策、消费者需求变化、行业技术发展趋势等因素，研判中小企业的投资价值。本基金将重点关注具有优势投资价值的中小企业进行长期投资。

B. 中小企业的成长性分析

本基金充分利用综合评级的分析模式，研判中小企业所处的生命周期阶段，重点配置处于成长期与成熟期的中小企业，对处于幼稚期的中小企业保持积极跟踪，对处于衰退期的中小企业则予以回避。将自上而下和自下而上的分析模式相结合，通过细分中小企业的群体特征，对某些中小企业通过科技创新及经营业务转型所获得的成长动力，本基金也给予投资。

C. 中小企业的创新力分析

随着经济增长方式的转变和产业结构的升级，居民的需求也会发生变化，为了能适应居民需求的变化，中小企业需要具有一定的创新能力，才能不断满足居民健康和优质生活需求。本基金利用综合评价的分析模式，对基于差异化战略的中小企业创新能力进行由点到面的系统分析，筛选出具有创新能力的中小企业产业集群，在此基础上，优选出财务品质优秀、成长性良好、价值低估的中小企业群体性创新组合，构建本基金的股票投资组合。

D. 中小企业的经营质量分析

本基金对中小企业的经营质量进行系统分析。主要关注分析中小企业是否为行业领先，其企业净利润增长率及主营业务的市场占有率是否高于上市公司平均水平、行业平均水平等方面。在综合评价的分析框架内，重点关注未来经济驱动中具有稳定经营质量特征的中小企业产业集群。此外，本基金还通过量化分析模式，对企业的资产重组、收购兼并等经营事件进行群体性事件

分析。

E. 中小企业的管理模式及企业文化分析

良好的企业管理模式及企业文化是中小企业持续、健康发展的基础。本基金利用综合评价的分析模式，从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、管理层和股东的利益是否协调和平衡、是否具有清晰的发展战略、企业文化是否具有凝聚力等方面，对中小企业的企业管理模式及企业文化进行系统分析，优选具有稳定企业管理模式及优秀企业文化的中小企业进行长期投资。

(3) 构建最优的投资组合

在对中小企业群体性活力特征进行系统分析的基础上，考虑中小企业的行业竞争优势、国家产业政策等影响因素，在有效管理投资风险的前提下，构建资产组合。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

5、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

8. 投资决策依据和决策程序

(1) 投资决策依据

法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的相关规定。

宏观经济和上市公司的基本面数据。

投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

(2) 投资决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的量化投资决策投资流程。

投资决策委员会：投资决策委员会根据本基金的投资目标和投资模式，审核并判断基金经理提出的量化投资决策或重大资产配置方案。

量化投资总监：量化投资总监在投资决策委员会授权和认可的投资范围内，负责评估审核量化投资策略的可行性、科学性以及有效性，形成有效的量化投资策略，监督量化投资策略的执行，并组织、管理、协调量化投资的研究工作。

量化基金经理：量化基金经理根据量化投资策略的分析框架，严格纪律化执行量化投资策略，确保量化投资策略可以高效执行，实现量化投资的既定目标，并根据量化策略的执行效果进行有效评估，持续改进量化投资策略。

风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

九、基金的业绩比较基准

中证 500 指数*80%+中证综合债券指数*20%

其中，中证 500 指数是中证指数有限公司所开发的指数中的一种，其样本空间内股票是扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为中证 500 指数样本股。中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。而中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商，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，而无须召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品

种。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2017 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	86,029,565.00	56.00
---	------	---------------	-------

其中：股票 86,029,565.00 56.00

2	基金投资	--	--
---	------	----	----

3	固定收益投资	--	--
---	--------	----	----

其中：债券 --

资产支持证券 --

4	贵金属投资	--	--
---	-------	----	----

5	金融衍生品投资	--	--
---	---------	----	----

6	买入返售金融资产	--	--
---	----------	----	----

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7	银行存款和结算备付金合计	67,013,915.34	43.62
---	--------------	---------------	-------

8	其他资产	574,221.66	0.37
---	------	------------	------

9	合计	153,617,702.00	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	269,808.00	0.18
---	----------	------------	------

B	采矿业	460,224.00	0.30
---	-----	------------	------

C	制造业	63,346,582.00	41.43
---	-----	---------------	-------

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
---	------------------	----	----

E 建筑业 2,606,087.00 1.70

F 批发和零售业 3,266,975.00 2.14

G 交通运输、仓储和邮政业 787,328.00 0.51

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 10,566,152.00 6.91

J 金融业 2,887,739.00 1.89

K 房地产业 1,263.00 0.00

L 租赁和商务服务业 576.00 0.00

M 科学研究和技术服务业 806,194.00 0.53

N 水利、环境和公共设施管理业 364,410.00 0.24

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 666,227.00 0.44

S 综合 --

合计 86,029,565.00 56.27

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	002236	大华股份	107,400	2,479,866.00	1.62
2	300083	劲胜智能	298,700	2,267,133.00	1.48
3	600585	海螺水泥	75,200	2,205,616.00	1.44
4	600460	士兰微	139,100	2,146,313.00	1.40
5	300274	阳光电源	108,200	2,030,914.00	1.33
6	601318	中国平安	28,900	2,022,422.00	1.32
7	601933	永辉超市	197,700	1,996,770.00	1.31
8	002517	恺英网络	75,200	1,670,192.00	1.09
9	002241	歌尔股份	87,400	1,516,390.00	0.99
10	300349	金卡智能	38,100	1,508,760.00	0.99

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

9.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
----	----	----------	---------	-----------	------

IC1801	中证500股指期货	IC1801	合约 2,250,760.00	32,320.00	-
--------	-----------	--------	-----------------	-----------	---

公允价值变动总额合计(元) 32,320.00

股指期货投资本期收益(元) 83,610.00

股指期货投资本期公允价值变动(元) -33,920.00

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃、超额收益显著的股指期货合约进行投资。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。

10.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。

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

(2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 534,783.67

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 26,963.47

5 应收申购款 12,474.52

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 574,221.66

(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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

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

金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2017年7月4日(基金合同生效日)至2017年12月31日 -4.60% 0.47% 1.08% 0.77% -5.68% -0.30%

2. 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

图：嘉实中小企业量化活力灵活配置混合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

(2017年7月4日至2017年12月31日)

注：本基金基金合同生效日2017年7月4日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效

日起6个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》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、律师费和仲裁费或诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券、期货交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (9) 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。

2、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：

$$H = E \times 1.5\% \times \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(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：

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

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力

力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述（一）基金费用的种类中第 3—9 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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

1、本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费） 申购费率

$M < 100$ 万元 1.5%

$100 \text{ 万元} \leq M < 200 \text{ 万元}$ 1.0%

$200 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$ 0.6%

$M \geq 500 \text{ 万元}$ 按笔收取，单笔 1000 元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6% 执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6% 时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

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

注：2014 年 9 月 2 日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自 2017 年 8 月 14 日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（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，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T） 基金网上直销

后端申购优惠费率

$0 < T < 1$ 年 0.20%

$1 \text{ 年} \leq T < 3 \text{ 年}$ 0.10%

$T \geq 3 \text{ 年}$ 0.00%

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、赎回费

本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费，对持续持有期大于等于 7 天少于 30 日的投资人收取 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天少于 90 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 天少于 180 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 180 天少于 365 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，将赎回费总额的 25% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 365 天少于 730 天的投资人收取 0.25% 的赎回费，将赎回费总额的 25% 计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（T） 赎回费率

T < 7 天 1.5%

7 天 ≤ T < 30 天 0.75%

30 天 ≤ T < 365 天 0.5%

365 天 ≤ T < 730 天 0.25%

T ≥ 730 天 0

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

(3) 《基金合同》生效前的相关费用；

(4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(5) 基金税收

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

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。

(三) 转换费

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

1、通过代销机构办理基金转换业务（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。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时,每次收取申购补差费用;从高申购费用基金向低申购费用基金转换时,不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

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。

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。

4、基金转换份额的计算

基金转换采取未知价法,以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下:

转出基金金额=转出份额转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额转出基金赎回费率

转出基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)转出基金申购费率(1+转出基金申购费率)

转入基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)转入基金申购费率(1+转入基金申购费率)

申购补差费用=MAX(0, 转入基金申购费用-转出基金申购费用)

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

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法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

注:嘉实安心货币、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实信用债券、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实超短债、嘉实多元收益债券、嘉实周期优选混合、嘉实逆向策略股票、嘉实快线货币基金 A、嘉实货币、嘉实新兴产业股票、嘉实优化红利混合有单日单个基金账户的累计申购(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,具体请参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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实

施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

- 1.在重要提示部分：增加了本基金合同生效日，明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
- 2.在三、基金管理人部分：更新了基金管理人的相关信息。
- 3.在四、基金托管人部分：更新了基金托管人的相关信息。
- 4.在五、相关服务机构部分：更新了直销机构、代销机构信息、经办注册会计师信息。
- 5.在六、基金的募集部分：增加了募集期限。
- 6.在七、基金合同的生效部分：增加了基金合同生效日。
- 7.在八、基金份额的申购、赎回部分：增加了本基金开始办理申购与赎回业务的起始日期、更新了申购与赎回费率的相关内容。
- 8.增加九、基金的转换：增加了基金转换的相关信息。
- 9.在十、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。
- 10.增加十一、基金的业绩：基金业绩更新至 2017 年第四季度末。
- 11.在二十三、其他应披露事项部分：列示了本基金自 2017 年 4 月 7 日首次披露本基金招募说明书至 2018 年 1 月 4 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2018 年 2 月 10 日