

嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金更 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：招商银行股份有限公司

重要提示

嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年2月28日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]238号）的注册进行募集，本基金基金合同于2014年5月16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。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年5月16日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2018年3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，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。

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。

经雷先生，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，现兼任公司固定收益业务首席投资官。

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

刘斌先生，12年基金从业经历，曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013年12月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作。博士，具有基金从业资格。2014年5月15日至2016年7月27日任嘉实研究阿尔法股票基金经理。2014年5月15日至今任嘉实绝对收益策略定期混合基金经理。2015年12月7日至今任嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金经理。2016年7月22日至今任本基金基金经理。2018年1月19日至今任嘉实润泽量化定期混合基金经理。2018年2月9日至今任嘉实润和量化定期混合基金经理。

龙昌伦先生，4年证券从业经历，曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投资部。2017年6月22日至今任嘉实腾讯自选股大数据策略股票和本基金基金经理。

(2) 历任基金经理

2014年5月16日至2016年7月22日，张琦女士任本基金基金经理。

3、股票投资决策委员会

股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼股票投资业务联席 CIO 邵健先生，公司总经理经雷先生，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、张金涛先生和谭丽女士。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

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

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2018年3月31日，本集团总资产62,522.38亿元人民币，高级法下资本充足率15.51%，权重法下资本充足率12.79%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工81人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财

资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项，同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；

2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

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

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

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

（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

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

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

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

(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) 8013670	传真	(0591) 88013670
联系人	吴志锋		

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

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

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

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

2、代销机构

(1) 中国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		
注册地址	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	http://www.icbc.com.cn http://www.icbc-ltd.com	客服电话	95588
----	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------	-------

(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	中国北京市东城区建国门内大街 69 号		
注册地址	北京市东城区建国门内大街 69 号		
法定代表人	周慕冰		
电话	(010)85108227	传真	(010)85109219
网址	http://www.abchina.com	客服电话	95599

(3) 中国银行股份有限公司

办公地址	中国北京市复兴门内大街 1 号		
注册地址	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
网址	http://www.boc.cn	客服电话	95566

(4) 中国建设银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 25 号		
注册地址	北京市西城区金融大街 25 号		
法定代表人	田国立		
网址	http://www.ccb.com	客服电话	95533

(5) 交通银行股份有限公司

办公地址	上海市浦东新区银城中路 188 号		
注册地址	上海市自由贸易试验区银城中路 188 号		
法定代表人	彭纯	联系人	张宏革
电话	021-58781234	传真	021-58408483
网址	http://www.bankcomm.com	客服电话	95559

(6) 招商银行股份有限公司

住所	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦		
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号		
注册地址	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
网址	http://www.cmbchina.com	客服电话	95555

(7) 中信银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 9 号		
注册地址	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	http://www.citicbank.com	客服电话	95558

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址	上海市中山东一路 12 号		
注册地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	高国富	联系人	高天、虞谷云
电话	(021)61618888	传真	(021)63604199
网址	http://www.spdb.com.cn	客服电话	95528

(9) 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	中国北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦		
注册地址	中国北京市西城区复兴门内大街 2 号		
法定代表人	洪崎	联系人	王志刚
电话	(010)58560666		
网址	http://www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

(10) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街 3 号 A 座		
注册地址	北京市西城区金融大街 3 号		
法定代表人	李国华	联系人	王硕
传真	(010) 68858057		
网址	http://www.psbc.com	客服电话	95580

(11) 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		
注册地址	上海市自由贸易试验区银城中路 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	http://www.bosc.cn	客服电话	95594

(12) 平安银行股份有限公司

住所	广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦		
办公地址	深圳市深南东路 5047 号		
注册地址	深圳市罗湖区深南东路 5047 号		
法定代表人	谢永林	联系人	张青
电话	0755-22166118	传真	0755-82080406
网址	http://www.bank.pingan.com	客服电话	95511-3 或 95501

	m		
--	---	--	--

(13)宁波银行股份有限公司

住所	宁波市鄞州区宁南南路 700 号		
办公地址	浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号		
注册地址	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
网址	http://www.nbcb.com.cn	客服电话	96528, 962528 上海、北京地区

(14)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		
注册地址	北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼		
法定代表人	王金山	联系人	王薇娜
电话	(010)85605006	传真	(010)85605345
网址	http://www.bjrcb.com	客服电话	96198

(15)徽商银行股份有限公司

住所、办公地址	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座		
注册地址	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座		
法定代表人	李宏鸣	联系人	叶卓伟
电话	(0551) 62667635	传真	(0551) 62667684
网址	http://www.hsbank.com.cn	客服电话	4008896588

(16)南京银行股份有限公司

住所	南京市玄武区中山路 288 号		
办公地址	江苏省南京市玄武区中山路 288 号		
注册地址	江苏省南京市玄武区中山路 288 号		
法定代表人	胡昇荣	联系人	刘静
电话	(025) 86775044	传真	(025) 86775376
网址	http://www.njcb.com.cn	客服电话	4008896400

(17)江苏银行股份有限公司

住所	南京市中华路 26 号江苏银行总部大厦		
办公地址	江苏省南京市中华路 26 号		
注册地址	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
网址	http://www.jsbchina.cn	客服电话	95319

(18)渤海银行股份有限公司

住所	天津市河西区马场道 201-205 号		
办公地址	天津市河东区海河东路 218 号		
注册地址	天津市河东区海河东路 218 号		
法定代表人	李伏安	联系人	王宏
电话	(022)58316666	传真	(022)58316569
网址	http://www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

(19)乌鲁木齐银行股份有限公司

住所	乌鲁木齐市新华北路 8 号		
办公地址	新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号		
注册地址	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
网址	http://www.uccb.com.cn	客服电话	(0991)96518

(20)烟台银行股份有限公司

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

(21)天津银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区友谊路 15 号		
注册地址	天津市河西区友谊路 15 号		
法定代表人	李宗唐	联系人	杨森
电话	(022) 28405330	传真	(022) 28405631
网址	http://www.bankoftianjin.com	客服电话	4006-960296

(22)河北银行股份有限公司

住所	石家庄市平安北大街 28 号		
办公地址	河北省石家庄市平安北大街 28 号		
注册地址	河北省石家庄市平安北大街 28 号		
法定代表人	乔志强	联系人	王娟
电话	0311-88627587	传真	0311-88627027
网址	http://www.hebbank.com	客服电话	4006129999

(23)重庆农村商业银行股份有限公司

办公地址	重庆市江北区金沙门路 36 号		
注册地址	重庆市江北区金沙门路 36 号		
法定代表人	刘建忠	联系人	范亮
电话	023-67637962	传真	023-67637709
网址	http://www.cqrcb.com	客服电话	966866

(24)江苏江南农村商业银行股份有限公司

办公地址	江苏省常州市和平中路 413 号		
注册地址	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
网址	http://www.jnbank.com.cn	客服电话	96005

(25)江苏昆山农村商业银行股份有限公司

办公地址	江苏省昆山市前进东路 828 号		
注册地址	江苏省昆山市前进东路 828 号		
法定代表人	张哲清	联系人	黄怡
电话	0512-57379810	传真	0512-57370750
网址	http://www.ksrcb.cn/	客服电话	0512-96079

(26)苏州银行股份有限公司

办公地址	江苏省苏州工业园区钟园路 728 号		
注册地址	江苏省苏州工业园区钟园路 728 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	http://www.suzhoubank.com	客服电话	0512-96067

(27)福建海峡银行股份有限公司

办公地址	福州市六一北路 158 号		
注册地址	福州市六一北路 158 号		
法定代表人	苏素华	联系人	吴白玫
电话	0591-87838759	传真	0591-87388016
网址	http://www.fjhxbank.com	客服电话	4008939999

(28)泉州银行股份有限公司

办公地址	泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
注册地址	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
网址	http://www.qzccb.com	客服电话	4008896312

(29)锦州银行股份有限公司

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

(30)浙江乐清农村商业银行股份有限公司

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

(31)桂林银行股份有限公司

办公地址	广西壮族自治区桂林市中山南路 76 号		
注册地址	广西壮族自治区桂林市中山南路 76 号		
法定代表人	王能	联系人	周佩玲
传真	0773-3851691		
网址	http://www.guilinbank.com.c n	客服电话	4008696299

(32)浙江杭州余杭农村商业银行股份有限公司

办公地址	浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街 72 号		
注册地址	杭州市余杭区临平南大街 72 号		
法定代表人	来煜标	联系人	蔡亮
电话	0571-86209980	传真	0571-86137150
网址	http://www.yhrcb.com/	客服电话	96596/4008896596

(33)天相投资顾问有限公司

办公地址	西城区新街口外大街 28 号院 C 座 505		
注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701		
法定代表人	林义相	联系人	谭磊
电话	010-66045182	传真	010-66045518
网址	txsec.com	客服电话	010-66045678

(34)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋		
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	http://www.noah-fund.com	客服电话	400-821-5399
----	-----------------------------------------------------------------	------	--------------

(35)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		
注册地址	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
网址	http://www.jjmmw.com ; https://www.zlfund.cn	客服电话	4006-788-887

(36)上海天天基金销售有限公司

办公地址	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座		
注册地址	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层		
法定代表人	其实	联系人	潘世友
电话	021-54509977	传真	021-64385308
网址	http://www.1234567.com.cn	客服电话	95021

(37)上海好买基金销售有限公司

办公地址	上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼		
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	https://www.howbuy.com/	客服电话	4007009665

(38)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 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层		
注册地址	浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室		
法定代表人	张跃伟	联系人	单丙焱
电话	021-20691869	传真	021-20691861
网址	http://www.erichfund.com	客服电话	400-089-1289

(39)浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市西湖区古荡街道		
注册地址	浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903		
法定代表人	凌顺平	联系人	林海明
传真	0571-86800423		
网址	http://www.5ifund.com	客服电话	4008-773-772

(40)北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址	北京市朝阳区安苑路 15 号邮电新闻大厦		
注册地址	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		
网址	http://www.myfund.com	客服电话	4008886661

(41)上海利得基金销售有限公司

办公地址	上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室		
注册地址	中国上海宝山区蕴川路 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
网址	http://www.leadfund.com.cn	客服电话	400-921-7755

(42)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八号国金中心二期 53 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	http://www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

(43)北京创金启富投资管理有限公司

办公地址	中国北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A		
注册地址	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
网址	http://www.5irich.com	客服电话	400-6262-818

(44)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 号楼 15 层 1809		
注册地址	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
网址	http://www.yixinfund.com	客服电话	400-6099-200

(45)南京苏宁基金销售有限公司

办公地址	南京市玄武区苏宁大道 1-5 号		
注册地址	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
网址	http://www.snjjin.com/	客服电话	95177

(46)贵州省腾元基金销售有限公司

办公地址	贵州省黔东南苗族侗族自治州麻江县杏山镇		
注册地址	贵州省黔东南苗族侗族自治州麻江县杏山镇		
法定代表人	曾革	联系人	鄢萌莎
电话	0755-33376922	传真	0755-33065516
网址	http://www.tenyuanfund.com	客服电话	4006877899

(47)通华财富(上海)基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东新区新金桥路 28 号新金桥大厦 5 楼		
注册地址	上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室		
法定代表人	马刚	联系人	褚志朋
电话	021-60818730	传真	021-60818187
网址	http://www.tonghuafund.com	客服电话	40066-95156

(48)北京植信基金销售有限公司

办公地址	北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67		
注册地址	北京市密云区兴盛南路 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	http://www.zhixin-inv.com	客服电话	400-680-2123

(49)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	http://www.niuniufund.com	客服电话	4006236060

(50)上海大智慧基金销售有限公司

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		
注册地址	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
网址	https://www.wg.com.cn	客服电话	021-20292031

(51)中经北证(北京)资产管理有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 C 座 709 室		
注册地址	北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室		
法定代表人	曲阳	联系人	徐娜
电话	010-68292940	传真	010-68292941
网址	http://www.bzfunds.com	客服电话	010-68292745

(52) 济安财富(北京)基金销售有限公司

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		
注册地址	北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室		
法定代表人	杨健	联系人	李海燕
电话	010-65309516	传真	010-65330699
网址	http://www.jianfortune.com	客服电话	400-673-7010

(53) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址	上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室		
法定代表人	燕斌	联系人	兰敏
电话	021-52822063	传真	021-52975270
网址	http://www.66zichan.com	客服电话	400-166-6788

(54) 上海汇付基金销售有限公司

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	上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层		
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		

(55) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址	上海昆明路 518 号北美广场 A1002		
注册地址	上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）		
法定代表人	王翔	联系人	蓝杰
电话	021-65370077	传真	021-55085991
网址	http://www.jiyufund.com.cn	客服电话	4008-205-369

(56) 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
----	-------------------------------------------------------------	------	--------------

(57)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场北路甲2号裙房2层222单元		
注册地址	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
网址	http://www.hongdianfund.com	客服电话	400-068-1176

(58)上海陆金所基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路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
网址	http://www.lufunds.com	客服电话	4008219031

(59)大泰金石基金销售有限公司

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		
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.dtfortune.com /	客服电话	400-928-2266

(60)珠海盈米财富管理有限公司

办公地址	珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491		
注册地址	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
网址	http://www.yingmi.cn	客服电话	020-89629066

(61)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

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		
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	钱昊旻	联系人	仲甜甜
电话	010-59336492	传真	010-59336510
网址	http://www.jnlc.com	客服电话	010-59336512

(62)中民财富管理(上海)有限公司

办公地址	上海市黄浦区老太平弄88号A、B单元		
注册地址	上海市黄浦区中山南路100号7层05单元		
法定代表人	弭洪军	联系人	茅旦青

电话	021-33355392	传真	021-63353736
网址	http://www.cmiwm.com /	客服电话	400-876-5716

(63)上海华夏财富投资管理有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层		
注册地址	上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室		
法定代表人	毛淮平	联系人	仲秋玥
电话	010-88066632	传真	010-88066214
网址	https://www.amcfortune.com /	客服电话	400-817-5666

(64)国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路 618 号		
办公地址	上海市浦东新区银城路 168 号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
法定代表人	杨德红	联系人	芮敏祺
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	http://www.gtja.com	客服电话	4008888666

(65)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	北京市东城区朝内大街 188 号		
注册地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	http://www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

(66)国信证券股份有限公司

办公地址	广东省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		
注册地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	周杨
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

(67)招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
注册地址	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	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	4008881111、95565

(68)中信证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
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		
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		
法定代表人	张佑君	联系人	郑慧
电话	010-60838888		
网址	http://www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

(69)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 号国际企业大厦 C 座		
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		
注册地址	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
网址	http://www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

(70)申万宏源证券有限公司

住所	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层		
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
法定代表人	李梅	联系人	王叔胤
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	021-962505/95523

(71)中信证券(山东)有限责任公司

住所	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼		
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		
注册地址	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
法定代表人	姜晓林	联系人	吴忠超
电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	http://www.zxwt.com.cn	客服电话	95548

(72)方正证券股份有限公司

住所	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
注册地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013

网址	http://www.foundersc.com	客服电话	95571
----	-----------------------------------------------------------------	------	-------

(73)长城证券股份有限公司

住所	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
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		
注册地址	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	丁益	联系人	金夏
电话	(021)62821733	传真	(0755)83515567
网址	http://www.cgws.com	客服电话	4006666888、 (0755)33680000

(74)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		
注册地址	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
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	4008888788、 10108998

(75)广州证券股份有限公司

住所	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		
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		
注册地址	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	胡伏云	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	http://www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

(76)华安证券股份有限公司

办公地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号		
注册地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号		
法定代表人	章宏韬	联系人	范超
电话	0551-65161821	传真	0551-65161672
网址	http://www.hazq.com	客服电话	95318

(77)财富证券有限责任公司

住所	湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼		
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		
注册地址	长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层		
法定代表人	蔡一兵	联系人	郭静
电话	(0731)84403347	传真	(0731)84403439
网址	http://www.cfzq.com	客服电话	95317

(78)申万宏源西部证券有限公司

住所	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		
办公地址	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
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		
法定代表人	韩志谦	联系人	王怀春
电话	0991-2307105	传真	0991-2301927
客服电话	4008-000-562		

(79)中泰证券股份有限公司

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
办公地址	济南市市中区经七路 86 号		
注册地址	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	http://www.zts.com.cn/	客服电话	95538

(80)中国国际金融股份有限公司

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
注册地址	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
网址	http://www.cicc.com.cn	客服电话	400 910 1166

(81)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	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		
网址	http://www.lxsec.com	客服电话	95564

(82)东海期货有限责任公司

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		
注册地址	江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号		
法定代表人	陈太康	联系人	李天雨
电话	021-68757102	传真	021-68757102
网址	http://www.qh168.com.cn	客服电话	95531/4008888588

(83)长江证券股份有限公司

住所	湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦		
----	----------------------	--	--

办公地址	湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号		
注册地址	湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号		
法定代表人	尤习贵	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
网址	http://www.cjsc.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

(84)万联证券股份有限公司

住所	广州市中山二路 18 号电信广场 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		
注册地址	广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层		
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	http://www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

(85)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		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022)28451991	传真	(022)28451892
网址	http://www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(86)山西证券股份有限公司

住所	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
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		
注册地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	(0351) 8686659	传真	(0351) 8686619
网址	http://www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

(87)东吴证券股份有限公司

住所	苏州工业园区星阳街 5 号		
办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街 5 号		
注册地址	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
网址	http://www.dwzq.com.cn	客服电话	95330

(88)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		
---------	-----------------------	--	--

注册地址	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	http://www.cindasc.com	客服电话	95321

(89)上海证券有限责任公司

住所	上海市四川中路213号久事商务大厦7楼		
办公地址	上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼		
注册地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	李俊杰	联系人	邵珍珍
电话	(021)53686888	传真	(021)53686100-7008
网址	http://www.shzq.com	客服电话	(021)962518、 4008918918

(90)新时代证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501		
注册地址	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		
网址	http://www.xsdzq.cn	客服电话	95399

(91)大同证券有限责任公司

住所	大同市城区迎宾街15号桐城中央21层		
办公地址	山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A座12、13层		
注册地址	大同市城区迎宾街15号桐城中央21层		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 4130322
网址	http://dtsbc.com.cn/	客服电话	4007121212

(92)浙商证券股份有限公司

住所	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼		
办公地址	浙江省杭州市五星路201号		
注册地址	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
网址	http://www.stocke.com.cn	客服电话	(0571) 967777

(93)平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层		
办公地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层		
注册地址	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层		
法定代表人	刘世安	联系人	周一涵

电话	021-38637436	传真	021-58991896
网址	http://www.stock.pingan.com	客服电话	95511—8

(94)东莞证券股份有限公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
注册地址	广东东莞市莞城区可园南路1号		
法定代表人	张运勇	联系人	李荣
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712
网址	http://www.dgzq.com.cn	客服电话	95328

(95)中原证券股份有限公司

住所	郑州市郑东新区商务外环路10号		
办公地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号		
注册地址	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
网址	http://www.ccnew.com	客服电话	95377

(96)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		
注册地址	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	翁振杰	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311
网址	http://www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(97)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		
注册地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	http://www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

(98)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	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
注册地址	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
网址	http://www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(99)华龙证券股份有限公司

住所	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心		
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		
注册地址	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	李昕田
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
网址	http://www.hlzq.com	客服电话	(0931) 96668、 4006898888

(100) 瑞银证券有限责任公司

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

(101) 中山证券有限责任公司

办公地址	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层		
注册地址	深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层		
法定代表人	黄扬录	联系人	罗艺琳
电话	0755-82570586	传真	0755-82960582
网址	http://www.zszq.com.cn	客服电话	95329

(102) 江海证券有限公司

办公地址	哈尔滨市松北区创新三路 833 号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路 5 6 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊
电话	0451-85863726	传真	0451-82337279
网址	http://www.jhzb.com.cn	客服电话	400-666-2288

(103) 国金证券股份有限公司

办公地址	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼		
注册地址	四川省成都市青羊区东城根上街 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	http://www.gjzq.com.cn	客服电话	95310

(104) 中国民族证券有限责任公司

住所	北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层		
----	--------------------------	--	--

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		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼		
法定代表人	何亚刚	联系人	齐冬妮
电话	(010)59355807	传真	(010)56437013
网址	http://www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

(105) 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	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼		
注册地址	厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼		
法定代表人	王勇	联系人	林丹
电话	(0592)2079259	传真	(0592)2079602
网址	https://www.gwgsc.com	客服电话	400-0099-886
	/		

(106) 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	北京朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 18 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 8 号		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010-85556100	传真	010-85556088
网址	http://www.hrsec.com.cn	客服电话	400-898-4999

(107) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006		
注册地址	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
网址	http://www.xinlande.com.cn	客服电话	400-118-1166

(108) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

办公地址	杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室		
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

(109) 北京汇成基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室		
注册地址	北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号		
法定代表人	王伟刚	联系人	丁向坤
电话	010-56282140	传真	010-62680827

网址	http://www.hcjijin.com/	客服电话	400-619-9059
----	---------------------------------------------------------------	------	--------------

(110) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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		
注册地址	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
网址	http://www.xincai.com	客服电话	010-62675369

(111) 上海万得基金销售有限公司

办公地址	中国（上海）浦东新区福山路 33 号 9 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座		
法定代表人	王廷富	联系人	姜吉灵
电话	021-68882280	传真	021-68882281
网址	https://www.520fund.com.cn /	客服电话	400-821-0203

(112) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

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		
注册地址	宁夏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

(113) 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	北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15		
法定代表人	江卉	联系人	江卉
电话	4000988511	传真	010-89188000
网址	https://keterui.jd.com/	客服电话	400-088-8816

(114) 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		
注册地址	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	袁永姣
电话	010-61840688	传真	010-61840699
网址	http://www.ncfjj.com	客服电话	4000-618-518

（二）基金登记机构

嘉实基金管理有限公司（同上）

（三）律师事务所和经办律师

名称	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	中国上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层		
负责人	廖海	联系人	张兰
电话	(021) 51150298	传真	(021) 51150398
经办律师	刘佳、张兰		

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号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、基金的名称

本基金名称：嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。本基金为混合型发起式证券投资基金。

六、基金的投资目标

在控制基金股票市场性风险暴露的前提下，利用各种金融工具力争为投资人实现较高的投资收益。

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、创业板及其他经中国证监会核

准上市的股票），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）、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、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）。

本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

待基金参与融资融券和转融通业务及投资其他品种（包括但不限于：其他基金份额、期权、收益互换等）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控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务、转融通业务及投资其他品种，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种的风险控制原则、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宜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

本基金采用“多空”（long-short）投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。多头股票部分主要采用基本面分析的方式进行筛选，

空头部分以被动对冲（passive hedging）方式构建，首要目标为剥离多头股票部分的系统性风险。根据宏观策略部提供的宏观数据预测及相关研究分析建议并结合公司投资决策委员会有关大类资产配置的安排，本基金可以适时主动调整多头股票系统性风险敞口。

1、股票投资策略

本基金通过系统地分析中国证券市场的特点和运作规律，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，精选具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力大的投资标的，构建本基金的现货组合。

深入的基本面研究和分析是挖掘优质股票的核心，本基金通过定量和定性相结合的方法精选个股。主要需要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等，并对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

2、对冲策略

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

3、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他对冲套利策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

（1）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

① 期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

② 跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

(2) 其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

4、其他投资策略

(1) 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。

(2) 中小企业私募债券投资策略

本基金将通过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，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

(3) 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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率

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，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，且无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过多空投资策略在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于多空策略投资结果的不确定性，因此收益不一定能超过业绩比较基准。

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。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年3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	67,808,067.53	64.92
	其中：股票	67,808,067.53	64.92
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	13,000,000.00	12.45
	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	12,338,328.02	11.81
8	其他资产	11,296,339.98	10.82
9	合计	104,442,735.53	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	1,903,991.92	1.85
C	制造业	35,794,369.51	34.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,114,732.00	2.05
E	建筑业	1,812,762.00	1.76
F	批发和零售业	3,961,149.00	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	2,096,883.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,551,188.00	3.44
J	金融业	10,607,833.70	10.29
K	房地产业	3,788,830.00	3.67
L	租赁和商务服务业	1,350,998.40	1.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	763,560.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,770.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,808,067.53	65.76

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	600519	贵州茅台	2,400	1,640,688.00	1.59
2	601318	中国平安	23,500	1,534,785.00	1.49
3	601166	兴业银行	65,000	1,084,850.00	1.05
4	000651	格力电器	22,900	1,074,010.00	1.04
5	601398	工商银行	165,300	1,006,677.00	0.98
6	601288	农业银行	232,000	907,120.00	0.88
7	600309	万华化学	23,040	839,577.60	0.81
8	600015	华夏银行	92,600	825,066.00	0.80
9	000786	北新建材	32,700	823,386.00	0.80
10	600887	伊利股份	28,500	811,965.00	0.79

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
IC1804	IC1804	-18	-21,885,120.00	14,120.00	-
IC1806	IC1806	-9	-10,790,640.00	-110,680.00	-
IF1806	IF1806	-10	-11,523,000.00	920,280.00	-
IF1804	IF1804	-17	-19,813,500.00	908,520.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,732,240.00
股指期货投资本期收益（元）					126,894.29
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,037,925.71

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货完全对冲，剥离股票组合的系统性风险，同时在市场情绪剧烈波

动的市场环境中积极参与和把握期限套利机会，以获取绝对收益。

本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资策略和投资目标。

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	11,291,611.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,728.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,296,339.98

(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	600309	万华化学	839,577.60	0.81	重大事项停牌

十二、基金的业绩

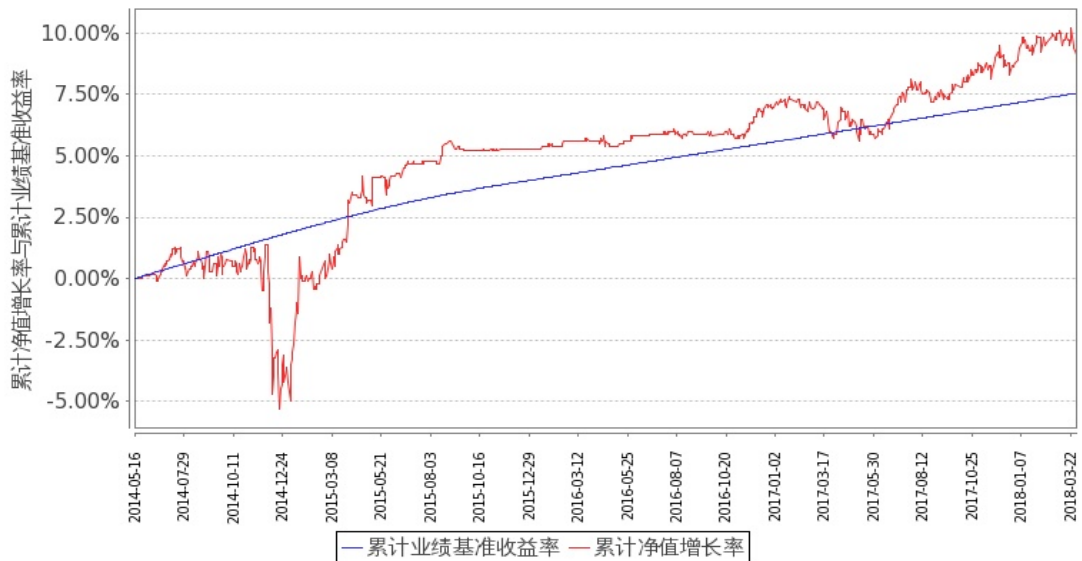
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
2014年5月16日（合同生效日）至2014年12月31日	-4.20%	0.41%	1.85%	0.01%	-6.05%	0.40%
2015年	9.92%	0.28%	2.12%	0.01%	7.80%	0.27%
2016年	1.61%	0.07%	1.50%	0.00%	0.11%	0.07%
2017年	1.68%	0.17%	1.50%	0.00%	0.18%	0.17%
2018年1月1日至3月31日	0.28%	0.20%	0.37%	0.00%	-0.09%	0.20%

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

嘉实对冲套利定期混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实对冲套利定期混合基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走

势对比（2014年5月16日至2018年3月31日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》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、律师费和诉讼或仲裁费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的相关账户的开户及维护费用；
- （7）基金的证券、期货交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （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

基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

1) 基金管理人的基本管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托

管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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) 基金管理人的附加管理费

A. 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

① 符合基金收益分配条件

② 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日：每次基金封闭期的最后一个工作日

B. 附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为

$$\text{附加管理费} = (P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$$

其中：

P_A 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

$P_A =$ 提取评价日基金份额净值 \times 提取评价日的折算因子 $+$

$$\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{次基金份额分红} \times \text{第}i\text{次分红的折算因子}$$

P_H 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，其中首次封闭期的 P_H 为1

S_A 为提取评价日的基金份额 = 提取评价日基金总份额 \div 提取评价日的折算因子

特定日期.的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积

折算系数 = 基金折算日除权前基金份额净值 \div 基金折算日除权后基金份额净值

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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：

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

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日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。

(3) 证券账户开户费用

证券账户开户费经基金管理人与托管人核对无误后，自产品成立一个月内由托管人从基金财产中划付，如资产余额不足支付该开户费用，由管理人于产品成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，托管人不承担垫付开户费用义务。

上述“1、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

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

本基金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 < 1000 万元	1.3%
M ≥ 1000 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。

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2014年9月5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年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3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。

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。

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30天的投资者收取1.5%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 (H)	赎回费率
H<30天	1.50%

30 天 \leq H<365 天	0.50%
365 天 \leq H<730 天	0.25%
H \geq 730 天	0

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

基金管理人可以在不违反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)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。

3、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。

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。

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）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金转换费率。

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、嘉实债券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。

（三）不列入基金费用的项目

- 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。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在指定媒体刊登公告。

（五）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：更新了代销机构、会计师事务所的相关信息。
- 5.在“九、基金转换”部分：更新了基金转换的相关内容。
- 6.在“十二、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
- 7.在“十三、基金的业绩”：基金业绩更新至 2018 年 3 月 31 日。
- 8.在“二十六、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2017 年 11 月 16 日至 2018 年 5 月 16 日相关临时公告事项。
- 9.根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人 2018 年 3 月 22 日发布的《关于修改嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同及托管协议的公告》，更新了“基金份额的封闭期、开放期、申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露、风险揭示”等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司

2018年6月28日