

(上接B117版)				
(84) 万联证券股份有限公司				
住所、办公地址	广州市中山二路18号电信广36、37层	联系人	罗创斌	
法定代表人	张建军	传真		
电话	(020) 37986470	联系电话	020-2237718-1013	
网址	www.wljz.com.cn	客服电话	4008981313	
(85) 民生证券股份有限公司				
住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层	联系人		
法定代表人	冯鹤年	联系人	赵明	
电话	(010)85127766	传真	(010)85127917	
网址	www.mszq.com	客服电话	400-6119-8888	
(86) 国元证券股份有限公司				
住所、办公地址	安徽省合肥市寿春路179号	联系人		
法定代表人	凤良志	联系人	陈玲玲	
电话	(0651) 2246273	传真	(0651) 2272100	
网址	www.gyzq.com.cn	客服电话	96678	
(87) 渤海证券股份有限公司				
住所、办公地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室	联系人		
办公地址	天津市南开区复水道9号	联系人	樊建	
法定代表人	王春峰	联系人		
电话	(022)28451991	传真	(022)28451852	
网址	www.bhzq.com.cn	客服电话	4006516888	
(88) 山西证券股份有限公司				
住所、办公地址	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	联系人		
法定代表人	魏晨	联系人	郭熠	
电话	(0351) 8839369	传真	(0351) 8886619	
网址	www.sxjz.com.cn	客服电话	400-666-1618	
(89) 东兴证券股份有限公司				
住所、办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层	联系人		
法定代表人	杨勇力	联系人	陈海威	
电话	(010) 66565316	传真	(010) 66565246	
网址	www.dxzq.net.cn	客服电话	400-8888-993	
(90) 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	联系人	方锦丹	
法定代表人	范力	联系人		
电话	(0512)65958136	传真	(0512)65568821	
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	95330	
(91) 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2号楼	联系人	尹旭航	
法定代表人	张志刚	联系人		
电话	(010)68614888	传真	(010)63061344	
网址	www.cindasc.com	客服电话	95321	
(92) 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	联系人		
法定代表人	李剑刚	联系人	王万青	
电话	(025)846119623	传真	(025)83389725	
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	95386	
(93) 上海证券有限责任公司				
住所、办公地址	上海市四川中路213号久事商务大厦7楼	联系人		
法定代表人	李俊杰	联系人	邵珍珍	
电话	(021)36399888	传真	(021)36391100-7008	
网址	www.962518.com	客服电话	(021)962518, 4008918918	
(94) 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	联系人		
法定代表人	叶卫刚	联系人	田芳芳	
电话	(010)62661146	客服电话		
网址	www.xndzq.cn	客服电话	95339	
(95) 大同证券有限责任公司				
住所、办公地址	大同市城区迎宾路15号恒城国际21层	联系人		
办公地址	山西省太原市长治南路111号山西世贸中心A座P12、P13	联系人	薛伟	
法定代表人	董祥	联系人	薛伟	
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 14130322	
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212	
(96) 国联证券股份有限公司				
办公地址	江苏省无锡市金融一街9号	联系人		
注册地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦	联系人		
法定代表人	葛卫东	联系人	郝奕	
电话	(0510) 82831662	传真	(0510) 82830162	
网址	www.gliac.com.cn	客服电话	95570	
(97) 浙商证券股份有限公司				
住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼	联系人	齐亚行	
法定代表人	吴秉康	联系人		
电话	(0571) 87901912	传真	(0571) 87901913	
网址	www.stock.com.cn	客服电话	(0571) 967777	
(98) 平安证券股份有限公司				
住所、办公地址	深圳市福田区金田路4039号安联大厦16-20层	联系人		
办公地址	深圳市福田区金田路4039号安联大厦16-20层(519048)	联系人		
法定代表人	刘世安	联系人	石静武	
电话	021-39831117	传真	021-56891896	
网址	stock.pingan.com	客服电话	96111-8	
(99) 国海证券股份有限公司				
住所、办公地址	广西桂林市福城路13号	联系人		
法定代表人	张雅维	联系人	牛圣杰	
电话	0755-83700350	传真	0755-83700305	
网址	www.gthzq.com.cn	客服电话	95563 (全国)	
(100) 东莞证券股份有限公司				
住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	联系人		
联系人	李荣	联系人		
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712	
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	95328	
(101) 中原证券股份有限公司				
住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路10号	联系人		
法定代表人	菅明军	联系人	程月梅、李盼盼	
电话	0371-69069882	传真	0371-65658899	
网址	www.cnewe.com	客服电话	95377	
(102) 国都证券股份有限公司				
住所、办公地址	北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层	联系人	黄静	
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311	
网址	www.guoduc.com	客服电话	400-818-8118	
(103) 中银国际证券股份有限公司				
住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	联系人		
法定代表人	宁敬	联系人	王伟莉	
电话	(821)60372474	客服电话	4006208888	
(104) 恒泰证券股份有限公司				
住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街111号	联系人	王旭华	
法定代表人	庞介怀	联系人		
电话	(010) 166297386	传真	(0471) 4961259	
网址	www.zht.com.cn	客服电话	(0471) 4972343	
(105) 国盛证券有限责任公司				
住所、办公地址	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融中心A座4楼	联系人	周欣婷	
法定代表人	徐晓峰	联系人		
电话	(0791)86281305	传真	(0791)86281305	
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	4008222111	
(106) 金元证券股份有限公司				
住所、办公地址	湖南省海口市南滨路36号证券大厦4层	联系人		
法定代表人	王作义	联系人	马洪涛	
电话	(0755)83052022	传真	(0755)83052625	
网址	www.jysec.com	客服电话	400-8888-228	
(107) 德邦证券股份有限公司				
住所、办公地址	上海市普陀区曹杨路510号南华90楼	联系人		
办公地址	上海市浦东新区福山路450号“鼎建国际中心”20楼	联系人		
法定代表人	姚文平	联系人	罗芳	
电话	(021) 168761616	传真	(021) 168767981	
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128	
(108) 西部证券股份有限公司				
住所、办公地址	陕西省西安市东大街222号信托大厦16-17楼	联系人		
法定代表人	刘建武	联系人	熊承华	
电话	(029)4716188	传真	(029)47406710	
网址	www.westsecu.com	客服电话	95362	
(109) 华龙证券股份有限公司				
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	联系人		
法定代表人	李选安	联系人	李昕田	
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4498026	
网址	www.hljzq.com	客服电话	(0931) 196668、4006989988	
(110) 财通证券有限责任公司				
住所、办公地址	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心	联系人	乔璇	
法定代表人	沈晓明	联系人	林芳	
电话	(0571) 167925129	传真	(0571) 87918329	
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571) 983936、953336 (上海地区)	
(111) 上海华信证券有限责任公司				
注册地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼	联系人		
法定代表人	刘剑	联系人	倪丹	
电话	021-387848187	传真	021-68775878	
网址	www.shhxzq.com	客服电话	88777777	
(112) 华鑫证券有限责任公司				
住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(01)单元	联系人	杨利娟	
法定代表人	俞萍	联系人		
电话	021-54967552	传真	021-54967032	
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	021-32109999、029-68918888、4001099918	
(113) 湘银证券有限责任公司				
住所、办公地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层	联系人		
法定代表人	程亚超	联系人	曾冲	
电话	(010) 158528112	传真	(010)68328748	
网址	www.xbsecurities.com	客服电话	400-887-8827	
(114) 中山证券有限责任公司				
办公地址	深圳市南山区科技一路西华强高新大厦7楼A座	联系人		
注册地址	深圳市南山区科技一路西华强高新大厦7楼A座	联系人		
法定代表人	杨锦添	联系人	罗艺璇	
电话	0755-82057886	传真	0755-82860582	
网址	www.zszq.com	客服电话	95329	
(115) 国融证券股份有限公司				
住所、办公地址	呼和浩特市新城区锡林南路18号	联系人		
办公地址	北京市西城区南口大街1号长安兴融中心西楼11层	联系人	董嘉琳	
法定代表人	孔佑杰	联系人		
电话	(010)963991727	传真	(010)696412537	
网址	www.xrzq.com.cn	客服电话	4006609839	
(116) 江海证券有限公司				
办公地址	黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路333号	联系人		
注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号	联系人		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊	
电话	0451-59063726	传真	0451-82272729	
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288	

(117) 国金证券股份有限公司				
办公地址	四川省成都市东城根路上99号		联系人	
法定代表人	冉云	联系人	刘尚鹏、曹鹏	
电话	028-86690067、028-86690068		传真	028-86690126
网址	www.gjzq.com.cn		客服电话	95310
(118) 中国民族证券有限责任公司				
住所、办公地址	北京市朝阳区东四环中路盘古大观A座40层			
法定代表人	何亚刚	联系人	齐冬妮	
电话	(010)65355807	传真	(010)66437013	
网址	www.cf618.com	客服电话	400-889-5618	
(119) 华宝证券有限责任公司				
住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心67层			
法定代表人	陈林	联系人	夏元	
电话	(021) 168777222	传真	(021) 168777822	
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008200898	
(120) 长城国瑞证券有限公司				
住所、办公地址	厦门市莲前西路2号莲前大厦十七楼			
法定代表人	王勇	联系人	林丹	
电话	(0592)2079259	传真	(0592)2079602	
网址	www.gwgsc.com	客服电话	400-0090-886	
(121) 爱建证券有限责任公司				
住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼			
法定代表人	宫龙云	联系人	陈敏	
电话	(021) 32238888	传真	(021) 68728782	
网址	www.aijzq.com	客服电话	(021) 163404678	
(122) 华融证券股份有限公司				
住所	北京市西城区金融大街8号			
法定代表人	杨敏忠	联系人	李慧灵	
电话	010-85564100	传真	010-85565000	
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	400-488-4889	
(123) 天风证券股份有限公司				
办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼			
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼			
法定代表人	余磊	联系人	梁成	
电话	027-87610052	传真	027-87618963	
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008006000	
(124) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司				
办公地址	北京市西城区广安门内大街28号嘉泰大厦A座4层			
注册地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1008#			
法定代表人	张维	联系人	文雯	
电话	010-83363101	传真	010-83363072	
网址	8lj.com.cn	客服电话	400-118-1166	
(125) 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F			
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	韩菱彬	
电话	021-60897940	传真	0571-26897013	
网址	http://www.fund123.cn/	客服电话	4000-766-123	
(126) 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108			
注册地址	北京市海淀区中关村大街11号11层108			
法定代表人	王伟刚	联系人	丁向坤	
电话	010-56282140	传真	010-62608827	
网址	www.huilicfund.com	客服电话	400-918-9069	
(127) 北京新浪乐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9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	李阳熙	联系人	付文红	
电话	010-62676405	传真	010-62676882	
网址	http://www.xinlei.com/	客服电话	010-62675369	
(128) 上海万得投资顾问有限公司				
办公地址	上海市浦东新区福山路33号建工大厦8楼			
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区福民路108号33号11楼E座			
法定代表人	王廷富	联系人	葛吉灵	
电话	021-68862280	传真	021-68862281	
客服电话	400-921-0203	客服电话		
(129) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司				
办公地址	宁夏回族自治区银川市18号宁夏高新技术产业园18号楼			
注册地址	宁夏回族自治区银川市金凤区上海滩国际商务区金凤区上海滩国际商务区142号14层1402办公用房			
法定代表人	程刚	联系人	程旭	
电话	010-58160168	传真	010-58160173	
网址	http://www.fengd.com/	客服电话	400-810-5619	
(130) 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软件园6号1号楼22层2603-06			
注册地址	北京市海淀区中关村软件园6号1号楼22层2603-06			
法定代表人	江丹	联系人	江丹	
电话	4008885511	传真	010-89188000	
网址	fund123.com	客服电话	400-088-8816	
(131) 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	袁永蛟	
电话	010-61940688	传真	010-61940699	
网址	https://danjuanapp.com/	客服电话	400-618-5118	
(132) 深圳前海微众银行股份有限公司				
办公地址	深圳市南山区桃园路微众银行国际中心A座3楼			
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室			
法定代表人	顾敏	联系人	苏豪	
电话	13496962231	传真	(0755-86700688)	
网址	www.weobank.com	客服电话	400-999-8777	

(二) 场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

(三) 基金注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司			
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街17号			
法定代表人	金颖	联系人	程刚	
电话	(010) 59378982	传真	(010) 58589807	

(四) 律师事务所和经办律师

名称	北京市金杜律师事务所			
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环中环路17号北京财富中心写字楼A座40层			
负责人	王玲	联系人	彭雷	
电话	(010) 5878 5688	传真	(010) 58785666	
经办律师	彭雷、唐丽子			

(五) 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、办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼			
负责人	上海黄浦区四川路202号世纪2号2楼普华永道中天11楼			
法定代表人	李丹	联系人	张勇	
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238900	
经办注册会计师	薛焱、张勇			

四、基金名称

嘉实中证悦联基金面50指数证券投资基金(LOF)

五、基金类型

本基金类型:上市契约开放式、股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、货币市场工具、权证和法律法规和中国证监会允许基金管理人投资的其他金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将纳入本基金的投资范围。

本基金投资组合中成份股及备选股票投资比例不低于基金资产的90%;权证市值不超过基金资产净值的3%;现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在10个工作日内调整投资组合以满足规定。法律法规另有规定的,从其规定。

八、基金的投资策略

本基金采取完全指数复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人(将采用其他投资技术手段适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差率不超过1.4%。在跟踪误差允许的情况下,本基金投资于标的指数的成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、金融衍生品工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资范围包括国债、金融债、可转债、次级债、资产支持证券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、回购(包括正回购和逆回购)、资产支持证券等。

如果未来法律法规或监管机构允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将纳入本基金投资。

九、基金投资将遵循:

1.决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资管理,基金投资决策的重大事项需向投资决策委员会报告。

3.投资组合

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保障投资理念的正確执行,避免重大风险的发生。

(1) 研究:投资研究人员依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展跟踪跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策:投资决策委员会依据指数投资小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资组合的日常决策。

(3) 组合构建:基金经理根据标的指数的相关信息,结合内部指数投资研究,以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的投资方法,以降低投资成本、控制跟踪误差。

(4) 交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5) 投资组合评估:投资组合与风险管理定期和不定期进行基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够判断组合是否实现了投资目标,组合误差的来源及投资策略成败为基金管理人提供及时的投资策略、投资组合调整的依据。

(6) 组合监控与调整:基金经理跟踪标的指数投资情况,结合成份基金基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数的。

九、基金的风险控制

95% + 中证悦联基金面 50 指数收益率 + 5% + 银行间同业存款收益率

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的投资股票型基金,其预期的风险和收益高于证券市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十一、基金投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月20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。

本报告投资组合报告所载数据截至2017年9月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据