# 中海量化策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第2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。

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2018年6月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31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总裁、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。

庞建先生，董事。中国人民大学本科学历，高级会计师。现任中国海洋石油总公司资金部总经理。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。

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总裁、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。

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。

MOLING CHEN（陈末翎）女士，董事。澳大利亚国籍。澳洲莫纳什大学工商管理硕士。现任爱德蒙罗斯柴尔德中国私募股权基金I期和II期主管合伙人。历任澳大利亚墨尔本药物技术研究所化学分析师，澳大利亚墨尔本凯龙生物区域经理，百奥维达中国基金高级投资总监。

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。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核、党办主任、信托事务管理总部总经理。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。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学金融系硕士，法国国立电信管理学院金融系硕士。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）商务拓展部高级副总裁。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。

康铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风控稽核部总经理。历任山东省招远市绣品厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理兼风控总监。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

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总经理、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。

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。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，2015年7月至今任中海中证高铁产业指数分级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，2017年4月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年4月至今任中海鑫灵活配置混合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 |
| 苴菲 | 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。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、基金经理。

夏春晖先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、首席策略分析师、基金经理。

江小震先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、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）基金托管人基本情况

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：易会满
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

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：李想
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

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：易会满
联系人：郭明
客户服务电话：95588
公司网址：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.abcchina.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：陈四清
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

（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：021－61616193
传真：021-63604196
联系人：朱萍
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.nbcb.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

（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
法定代表人：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
客户服务电话：4008-888-888
公司网址：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

（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：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：林俊波
电话：021-68634510-8193
传真：021-68865680
联系人：张新媛
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

（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：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：芮敏祺
客户服务电话：400-888-8666/95521
公司网址：www.gtja.com

（26）广发证券股份有限公司
住所：广州市天河区天河北路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

（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：陆涛
电话：0755-83025666
传真：0755-83025625
联系人：马贤清
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：秦湘
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：赵俊
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：李丹
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：牛冠兴
电话：021-68801217
传真：021-68801210
联系人：张勤
客户服务电话：4008-001-001
公司网址：www.essence.com.cn

（33）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路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：0931-4784656，4890208
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

（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：www.qlzq.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：吴军
电话：0755-23838751
传真：0755-82485081
客户服务电话：400-888-1888
公司网址：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：张建军
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）中国中投证券有限责任公司
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：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
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：刘婧漪、贾鹏
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：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
联系电话：0731-85832343
传真：0731-85832214
客户服务电话：95571
公司网址：www.foundersc.com

（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：王东明
联系电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：顾凌
客户服务电话： 400-889-5548
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：张腾
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：尹伶
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：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20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：杨宝林
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客服电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

（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：陈敏
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：洪诚
电话：0755-23953913
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惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话：0752-2119700
传真：0752-2119660
客户服务电话：95564
网址：www.lxsec.com

（61）中经北证（北京）资产管理有限公司
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

（62）北京晟视天下投资管理有限公司
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

（63）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

（64）中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址：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：高洋
电话：010-5935 5546
传真：010-5643 7030
客户服务电话：4008895618
网址：www.e5618.com

（65）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

（66）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

（67）深圳前海财厚资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室
法定代表人：孙方厚
联系人：李军
客户服务电话：400-699-0071
公司网址：www.caiho.cn

(68)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/

（69）东莞证券股份有限公司
住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心22楼
联系人：李荣
电话：0769-22115712
传真：0769-22115712
客户服务电话：95328
公司网址：http://www.dgzq.com.cn/

（70）天津万家财富资产管理有限公司
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/

（71）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

（72）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

（73）上海长量基金销售投资顾问有限公司
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

（74）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
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

（75）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：吴卫东
联系电话：021-20835787
客服电话：400-920-0022/ 021-20835588
公司网址：licaike.hexun.com

（76）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

（77）众升财富（北京）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

（78）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：王诗玙
联系电话：021-20613999
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

（79）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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦10楼
法定代表人：李兴春
联系人：郑茂
联系电话：021-50583533
传真：021-50583535
客服电话：400-921-7755
公司网址：www.leadfund.com.cn

（80）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

（81）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

（82）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

（83）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

(84) 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

（85）浙江金观诚财富管理有限公司
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：孙成岩
联系电话：0571-88337717
客服电话：400-068-0058
公司网址：www.jincheng-fund.com

（86）上海汇付基金销售有限公司
住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
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：臧静
联系电话：13818223736
客服电话：400-820-2819
公司网址：https://www.hotjijin.com

（87）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龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园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

（88）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号西裙楼
法定代表人：胡学勤
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

（89）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

（90）大泰金石基金销售有限公司
住所：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
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：袁顾明
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

（91）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

（92）珠海盈米财富管理有限公司
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：黄敏嫦
联系电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn

（93）奕丰金融服务（深圳）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

（94）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/

（95）上海联泰资产管理有限公司
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

（96）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

（97）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

（98）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
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
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

(99) 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

（100）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

（101）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

（102）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

（103）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

（104）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/

（105）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：钱燕飞
电话：025-66996699-887226
传真：025-66008800-887226
联系人：王锋
客户服务电话：95177
公司网址：www.snjijin.com

（106）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

（107）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

（108）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

（109）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

（110）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
电话：010-62676405
传真：8610-62675979
联系人：付文红
客户服务电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com

（111）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

（112）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

（113）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

（114）上海云湾投资管理有限公司
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

（115）南京途牛金融信息服务有限公司
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：王旋
联系电话：025-86853969
客服电话：4007-999-999
公司网址：http://jr.tuniu.com

（116）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

（117）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

（118）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

（119）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
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/

（120）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：裘爱萍
联系电话：021-802348888
传真：021-80234898
客服电话：4006991888
公司网址：www.998fund.com

（121）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

（122）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

（123）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

（124）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

（125）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

（126）北京微动利投资管理有限公司
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：梁洪军
联系人：季长军
客户服务电话：400-819-6665
公司网址：www.buyforyou.com.cn

（127）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

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、朱昀

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％，本基金保持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地赋权，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、可分离可转债券产品，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，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产品和投资进行风险评估，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）是本基金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采取的主要投资策略。本基金将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满足投资者目标和风险管理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，研究各种影响的力度和影响，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，统一执行投资交易计划。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，兼持稳健投资原则，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股票的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，不得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）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2018年3月31日报告期末的第一季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至2018年3月31日，中海量化策略混合型证券投资基金资产净值为76，182，749.17元，基金份额净值为0.956元，累计基金份额净值为1.493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 | 72，372，715.44 | 93.62 |
| | 其中：股票 | 72，372，715.44 | 93.62 |
| 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 | 3，865，288.35 | 5.00 |
| 8 | 其他资产 | 1，063，502.28 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 77，301，506.07 | 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 | 27，770，261.40 | 36.45 |
| 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 | 1，372，580.00 | 1.80 |
| 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 | 31，988，352.12 | 41.99 |
| J | 金融业 | 1，611，587.92 | 2.12 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1，367，772.00 | 1.80 |
| 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 | 8，262，162.00 | 10.85 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 72，372，715.44 | 95.00 |

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 | 000977 | 浪潮信息 | 115，900 | 2，854，617.00 | 3.75 |
| 2 | 002049 | 紫光国芯 | 52，500 | 2，728，425.00 | 3.58 |
| 3 | 002156 | 通富微电 | 218，000 | 2，703，200.00 | 3.55 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 159，019 | 2，692，191.67 | 3.53 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 51，400 | 2，357，718.00 | 3.09 |
| 6 | 300373 | 扬杰科技 | 79，300 | 2，325，076.00 | 3.05 |
| 7 | 600570 | 恒生电子 | 38，100 | 2，277，618.00 | 2.99 |
| 8 | 600584 | 长电科技 | 99，800 | 2，169，652.00 | 2.85 |
| 9 | 600136 | 当代明诚 | 131，100 | 2，142，174.00 | 2.81 |
| 10 | 002153 | 石基信息 | 78，600 | 2，108，838.00 | 2.77 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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2018年3月31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 | 32，727.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 785.72 |
| 5 | 应收申购款 | 1，029，989.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1，063，502.28 |

（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2018年3月31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％ |
| 2018.01.01-2018.03.31 | 8.27％ | 2.35％ | -2.15％ | 0.94％ | 10.42％ | 1.41％ |
| 自基金合同生效起至今 | 43.66％ | 1.55％ | 32.95％ | 1.22％ | 10.71％ | 0.33％ |

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×1.5％÷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×0.25％÷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费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、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“绪言”部分，对相关法律法规的名称进行了补充。

（三）在“释义”部分，对相关释义进行了补充。

（四）在“基金管理人”部分，对“主要人员情况”进行了更新。

（五）对“基金托管人”部分进行了更新。

（六）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（七）在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的数额限制”、“申购费用和赎回费用”、“拒绝或暂停申购的情形及处理方式”、“暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”和“巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容进行了更新。

（八）在“基金的投资”部分，对“投资范围”和“投资限制”的相关内容进行了更新，并对 “基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（九）对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。

（十）在“基金资产的估值”部分，对“估值方法”和“暂停估值的情形”的相关内容进行了更新。

（十一）在“基金的信息披露”部分，对“信息披露的种类、披露时间和披露形式”的相关内容进行了更新。

（十二）在“风险揭示”部分，对“基金管理风险”的相关内容进行了更新。

（十三）对“基金托管协议的内容摘要”部分按最新《中海量化策略混合型证券投资基金托管协议》进行了更新。

（十四）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
二〇一八年八月七日

---

# 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当中海中证高铁B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时，中海中证高铁份额（场内简称：高铁分级，基金代码：502030）、中海中证高铁A份额（场内简称：高铁A，代码：502031）、中海中证高铁B份额（场内简称：高铁B，基金代码：502032）将进行份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年8月6日，中海中证高铁B份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注中海中证高铁B份额近期的基金份额参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对前述情形下的不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

1、触发不定期折算当日，中海中证高铁B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元或以下，而折算基准日在触发日后才能确定，因此折算基准日中海中证高铁B份额的基金份额参考净值可能与0.250元有差异。

2、特别提示：如果发生不定期份额折算，中海中证高铁B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意中海中证高铁B份额高溢价交易所带来的风险。

3、中海中证高铁B份额表现为高风险、高预期收益的特征。随着中海中证高铁B份额的基金份额参考净值降低，其杠杆率升高。在不定期份额折算后，中海中证高铁B份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

4、中海中证高铁A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。但在发生不定期份额折算后，中海中证高铁A份额的份额持有人会获得一定比例的中海中证高铁份额，因此其持有的部分基金份额的风险收益特征将发生较大变化，中海中证高铁A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

5、根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位。场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

6、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买中海中证高铁A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的中海中证高铁份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将中海中证高铁A份额卖出，或者在折算后将新增的中海中证高铁份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示：

1、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额的上市交易和中海中证高铁份额的申购、赎回、配对转换等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

2、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话：400-888-9788（免长途话费）、021-38789788。

3、本基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件和临时公告。

特此公告。

中海基金管理有限公司
2018年8月7日