# 华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

2018年第2号

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2013年4月26日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】610号）进行募集。本基金的基金合同于2013年8月2日正式生效。

本基金名称自2015年8月6日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2015年8月6日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

重要提示

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为2018年8月1日，有关财务和业绩表现数据截止日为2018年6月30日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：贾波
成立日期：2004年11月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178号
经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：汪莹白
联系电话：400-888-0001，（021）38601777
股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001年7月至2016年11月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016年12月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

翟军先生：董事，学士，曾任职于江苏省国际信托投资公司、信泰证券，2009年9月进入华泰证券工作，曾任零售客户服务总部总经理助理、经纪业务总部副总经理、浙江分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司上海分公司总经理。

Rajeev Mittal先生：董事，学士，1992年加入美国国际集团，2009至2011年担任柏瑞投资（欧洲分公司）总经理，新兴市场投资主管，全球固定收益研究团队主管和行政总裁（欧洲分公司）。2011年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁（亚洲，日本除外）、总经理、新兴市场投资总管，全球固定收益研究团队主管。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限公司，1992年4月至1996年12月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997年1月至2001年7月任AIG友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001年7月至2010年2月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理。2010年2月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

杨科先生：独立董事，学士，2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。

李亦宜女士：独立董事，硕士，曾任职于Lazard & Co.旧金山办事处以及Lazard Asia香港办事处，2010年至2013年曾担任Japan Residential Assets Management Limited董事。2002年至今历任Argyle Street Management Limited基金经理、执行董事，2006年至今同时担任在伦敦证券交易所创业板上市公司TIH Limited董事。

文光伟先生：独立董事，博士，1983年至2015年先后任中国人民大学会计系助教、会计系讲师、中国人民大学商学院会计系副教授、硕士生导师，1989年12月至1991年6月期间兼职于香港普华会计公司审计部。2015年3月从中国人民大学退休。

沈志群先生：独立董事，学士，1978年至1987年先后在中国建筑科学研究院、国家建委政策研究室、国家建设部经济研究所从事研究工作，任研究室副主任，1987年至1997年先后任国家计委投资研究所研究室主任、所长助理、副所长（副司级），1997年任国家计委宏观经济研究院科研部主任（正司级），2000年任国家计委（国家发改委）宏观经济研究院院长助理，2001年至2014年任北京国宏物业管理有限公司（宏观院下属）总经理。2014年退休，现任中国投资协会副会长。

2、监事会成员

吴海云女士：监事长，硕士，于香港银行与资产管理业拥有丰富经验。曾任汇丰环球投资管理财务部副总裁，以及曾在富国银行，瑞银全球资产管理，瑞信私人银行，东方汇理资产管理等公司任多个重要职位。2017年6月起任柏瑞投资财务总监－亚洲(日本及台湾除外)。

刘晓冰先生：监事，二十三年证券从业经历。1993年12月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF基金及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。2018年3月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

童辉先生：监事，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司研发部，1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任信息技术与电子商务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004年任华泰证券股份有限公司北京总部副总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算门总监。2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年8月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013年10月起任公司副总经理，2014年12月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，2016年5月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，2017年3月起任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年12月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

高山先生，副总经理，博士。2001.5-2013.7任职于全国社会保障基金理事会投资部，任处长；2013.7起加入华泰柏瑞基金管理有限公司。本科毕业于山东大学经济管理学院，硕士毕业于中国人民银行研究生部，博士毕业于财政部财政科学研究所研究生部。

董元星先生，副总经理，博士。2006.9-2008.12任巴克莱资本（纽约）债券交易员，2009.3-2012.8任华夏基金管理有限公司基金经理。2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部总监。2013年10月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2014年2月起任总经理助理。2015年12月起任公司副总经理。北京大学经济学学士，纽约大学STERN商学院金融学博士。

程安至先生，副总经理，硕士。1997.9-2001.1任中国工商银行上海市分行信贷经理，2001.2-2012.4任华安基金管理有限公司市场部销售总监。2012年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任总经理助理。2015年12月起任公司副总经理。本科毕业于华东师范大学国际金融专业，硕士毕业于上海财经大学国民经济学专业，EMBA毕业于上海交通大学中欧国际工商学院。

4、本基金基金经理

田汉卿女士，同上。

5、权益投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理高山先生；副总经理田汉卿女士；投资部总监方伦煜先生；投资部总监吕慧建先生；研究部副总监李磊先生。

列席人员：督察长陈晖女士；权益投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；
（2）违反基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
（6）玩忽职守、滥用职权；
（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以抬高自己；
（10）以不正当手段谋求业务发展；
（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

（6）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，公司各部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

（5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
（2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

基金份额A类份额的发售机构包括基金管理人的直销机构和A类份额代销机构的销售网点。

1、直销机构：

华泰柏瑞基金管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：贾波
电话：（021）38784638
传真：（021）50103016
联系人：汪莹白
客服电话：400-888-0001，（021）38784638
公司网址：www.huatai-pb.com

2、A类份额代销机构

1）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市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
传真：（010）66594853
客服电话：95566
公司网址：www.boc.cn

2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街55号
办公地址：北京市复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
传真：（010）66107914
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

3）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：田国立
传真：（010）66275654
客服电话：95533
公司网址：www.ccb.com

4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：曹榕
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
客服电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

5）招商银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道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）83195109
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

6）平安银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：谢永林
联系人：施艺帆
电话：（021）50979384
传真：（021）58585432
客服电话：95511-3
公司网址：www.bank.pingan.com

7）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：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
联系人：杨宁
电话：（010）65556612
传真：（010）65550828
客服电话：95558
公司网址：bank.ecitic.com

8）中国民生银行股份有限公司
注册地址：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：董文标
联系人：董云巍
客服电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

嘉兴银行股份有限公司
注册地址：嘉兴市建国南路409号
办公地址：嘉兴市建国南路409号
法定代表人：许洪明
联系人：陈兢
电话：0573-82082676
传真：0573-82099678
客服电话：0573-96528
公司网址：www.bojx.com

9）哈尔滨银行股份有限公司
注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
法定代表人：郭志文
联系人：遇玺
电话：（0451）86779018
传真：（0451）86779018
客服电话：95537或400-609-5537
公司网址：www.hrbb.com.cn

10）爱建证券有限责任公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人：钱华
联系人：王威雅
电话：（021）32229888
传真：（021）68728703
客服电话：4001-962502
公司网站：www.ajzq.com

11）渤海证券股份有限公司
注册地址：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：王春峰
联系人：王星
电话：（022）28451922
传真：（022）28451892
客服电话：400-651-5988
公司网址：www.ewww.com.cn

12）财富证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
法定代表人：蔡一兵
联系人：郭磊
电话：（0731）84403319
传真：（0731）84403439
客服电话：400-88-35316
公司网址：www.cfzq.com

13）财通证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
联系人：夏吉慧
电话：（0571）87925129
传真：（0571）87818329
客服电话：96336（浙江），400-869-6336（全国）
公司网址：www.ctsec.com

14）长城证券股份有限公司
注册地址：广东省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：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：高峰
电话：（0755）83516094
传真：（0755）83515567
客服电话：（0755）33680000、400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

15）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
联系人：奚博宇
电话：（021）61118795
传真：（021）68751151
客服电话：95579或4008-888-999
公司网址：www.95579.com

16）德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市福山路500号26楼
办公地址：上海市福山路500号26楼
法定代表人：姚文平
联系人：朱磊
电话：（021）68761616
传真：（021）68767981
客服电话：400-888-8128
公司网址：www.tebon.com.cn

17）第一创业证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
办公地址：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）23838750
客服电话：400-888-1888
公司网址：www.firstcapital.com.cn

18）东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：（0512）65581136
传真：（0512）65588021
客服电话：400-860-1555或96288
公司网址：www.dwzq.com.cn

19）光大证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：周洁瑾
电话：（021）22169999
传真：（021）22169134
客服电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

20）国都证券股份有限公司
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
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：常喆
联系人：黄静
电话：(010)84183333
传真：（010）84183311-3389
客服电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com

21）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
联系人：芮敏祺
电话：（021）38676666
传真：（021）38670666
客服电话：95521
公司网址：www.gtja.com

22）国信证券股份有限公司
注册地址：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
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
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：（0755）82130833
传真：（0755）82133952
客服电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

23）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35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北京南路358号大成国际大厦20楼
法定代表人：韩志谦
联系人：王怀春
电话：0991-2307105
传真：0991-2301802
客服电话：400-800-0562
公司网址：www.swhysc.com

24）华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
电话：68778790
传真：68777992
客服电话：4008209898
公司网址：www.cnhbstock.com

25）华龙证券股份有限公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
联系人：邓鹏怡
电话：（0931）4890208
传真：（0931）4890118
客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618
公司网址：www.hlzqgs.com

26）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号华融大厦A座3层
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：（010）58315221
传真：（010）58568062
客服电话：400-898-9999
公司网址：www.hrsec.com.cn

27）华泰证券股份有限公司
注册地址：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、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人：周易
联系人：庞晓芸
电话：025-83389093
传真：0755-82492962（深圳）
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

28）华西证券股份有限公司
注册地址：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
客服电话：95584
公司网址：www.hx168.com.cn

29）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
电话：（021）64316642
传真：（021）64333051
客服电话：400-109-9918、021-32109999、029-68918888
公司网址：www.cfsc.com.cn

30）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层（518048）
法定代表人：谢永林
联系人：石静武
电话：（021）38631117
传真：（021）58991896
客服电话：95511*8
公司网址：stock.pingan.com

31）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：（0531）68889155
传真：（0531）68889752
客服电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn

32）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：（0351）8686659
传真：（0351）8686619
客服电话：400-666-1618、（0351）95573
公司网址：www.i618.com.cn

33）申万宏源证券有限公司
注册地址：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
联系人：黄莹
电话：（021）33389888
传真：（021）33388224
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.com

34）天风证券股份有限公司
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4楼
办公地址：中国武汉武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：崔成
电话：027-87610052
传真：027-87618863
客服电话：400-800-5000
公司网址：www.tfzq.com

35）天相投资顾问有限公司
注册地址：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
联系人：尹伶
电话：（010）66045152
传真：（010）66045518
客服电话：（010）66045678
公司网址：www.txsec.com或www.jjm.com.cn

36）信达证券股份有限公司
注册地址：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：尹旭航
电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

37）浙商证券股份有限公司
注册地址：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：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人：吴承根
联系人：张梦莹
电话：（021）64718888
传真：（0571）87901913
客服电话：（0571）95345
公司网址：www.stocke.com.cn

38）中国银河证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：宋明
电话：（010）66568450
传真：（010）66568990
客服电话：400-888-8888
公司网址：www.chinastock.com.cn

39）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：戴蕾
电话：（0791）86768681
传真：（0791）86770178
客服电话：400-886-6567
公司网址：www.avicsec.com

40）中国国际金融股份有限公司
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
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
电话：（010）6505 1166 － 6493
传真：（010）8567 9535
客服电话：410-910-1166
公司网址：www.cicc.com.cn

41）中国中投证券有限责任公司
注册地址：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）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：400-8888-108
传真：（010）65182261
客服电话：400-888-8108
公司网址：www.csc108.com

43）中信证券(山东)有限责任公司
注册地址：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
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(266061)
法定代表人：杨宝林
联系人：赵艳青
电话：（0532）85022326
传真：（0532）85022605
客服电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

44）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：郑慧
电话：010-60838888
传真：010-60836029
客服电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

45）华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：李工
联系人：范超
电话：0551-65161821
传真：0551-65161672
客服电话：400-809-6518（全国） 96518（安徽）
公司网址：www.hazq.com

46）东亚银行（中国）有限公司
注册地址：上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦29楼
办公地址：上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦
法定代表人：李国宝
联系人：杨俊
电话：021-38663866
客服电话：95382
公司网址：www.hkbea.com.cn

47）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
客服电话：400-990-8826
公司网址：www.citicsf.com

48）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：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：张晓辉
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212
客服电话：400-641-1999
公司网址：www.taichengcaifu.com

49）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客服电话：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com

50）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
传真：0351-7219891
客服电话：400-712-1212
公司网址：http://www.dtsbc.com.cn

51）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址：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：余永键
电话：010-85097570
传真：010-85097308
客服电话：400-021-8850
公司网址：www.harvestwm.cn

52）开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：袁伟涛
电话：029-81887060
传真：029-81887060
客服电话：4008608866
公司网址：www.kysec.cn

53）徽商银行股份有限公司
注册地址：安徽合肥安庆路79号天徽大厦A座
办公地址：安徽合肥安庆路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
客服电话：96588
公司网址：www.hsbank.com.cn

54）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号北美广场A座1002室
法定代表人：王翔
联系人：俞申莉
电话：021-65370077
传真：021-55085991
客服电话：4008-205-369
公司网址：www.jiyufund.com.cn

55）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址：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：宋子琪
电话：18500501595
传真：010-82057741
客服电话：4000888080
公司网址：www.qiandaojr.com

56）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人：王伟刚
联系人：李瑞真
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客服电话：4006199059
公司网址：www.hcjijin.com

57）大连网金基金销售有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室
办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室
法定代表人：卜勇
联系人：贾伟刚
电话：0411-3902-7828
传真：（0411）3902 7888
客服电话：4000-899-100
公司网址：www.yibaijin.com

58）奕丰金融服务（深圳）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，pss-team@ifastfinancial.com.cn
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

59）北京懒猫金融信息服务有限公司
注册地址：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
（国投尚科大厦5层）
法定代表人：许现良
联系人：李雪
电话：13426481033
传真：010-87723200
客服电话：4001-500-882
公司网址：www.lanmao.com

60）北京新浪仓石基金销售有限公司
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
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
联系人：付文红
电话：010-60616511
传真：8610-62676582
客服电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com

61）尚智逢源（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市门头沟区石龙经济开发区永安路20号3号楼B1-6525室
办公地址：北京市门头沟区石龙经济开发区永安路20号3号楼B1-6525室
法定代表人：刘磊
联系人：刘蕾
电话：010-65602060 / 15618301166
传真：010-65602060
客服电话：400-920-6677
公司网址：http://www.szfyfund.com

62）北京微动利基金销售有限公司
注册地址：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：何鹏
电话：010-52609656
传真：010-51957430
客服电话：4001885687
公司网址：www.buyforyou.com.cn

63）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504
法定代表人：陈洪生
联系人：陈承智
电话：0592-3122673
传真：0592-3122701
客服电话：4009180808
公司网址：www.xds.com.cn

64）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
法定代表人：蒋煜
联系人：姜斌 徐长征 刘聪慧
电话：010-58170708
传真：010-58170900
客服电话：400-818-8866
公司网址：http://www.shengshiview.com/

65）联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址：广东省惠州市江北东江三路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：0752-2119700
传真：0752-2119660
客服电话：95564
公司网址：www.lxsec.com

66）江苏银行股份有限公司
注册地址：中国江苏省南京市中华路26号
办公地址：中国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：025-58588720
客服电话：95319
公司网址：www.jsbchina.cn

67）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：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北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：李悦
联系人：张晔
电话：010-56642600
传真：010-56642623
客服电话：4007868868
公司网址：www.chtfund.com

68）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516-814
传真：010-65330699
客服电话：400-673-7010
公司网址：www.jianfortune.com

69）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
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
客服电话：400-804-8688
公司网址：www.keynesasset.com

70）上海攀赢基金销售有限公司
注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室
办公地址：上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦603单元
法定代表人：田为奇
联系人：吴卫东
电话：13918302493
传真：021-68889283
客服电话：021-68889082
公司网址：www.pytz.cn

71）徽商期货有限责任公司
注册地址：芜湖路258号
办公地址：芜湖路258号
法定代表人：吴国华
联系人：蔡芳
电话：0551-62862801
传真：0551-62862801
客服电话：400 887 8707
公司网址：www.hsqh.net

72）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
电话：025—86853969
传真：025-86853960
客服电话：4007-999-999转3
公司网址：http://jr.tuniu.com

73）上海东证期货有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路500号期货大厦14楼
办公地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼22楼
法定代表人：卢大印
联系人：龚榈生
电话：021-63325888-3916
传真：021-63326752
客服电话：95503
公司网址：www.dzqh.com.cn

74）华泰期货有限公司
注册地址：广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
办公地址：广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
法定代表人（代为履职）：徐炜中
联系人：黄韵钰/刘昆/张帆
电话：0755-23887950/0755-23887975/0755-82776680
传真：0755-82777490
客服电话：400-628-0888
公司网址：www.htfc.com

75）民生证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座18层
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18层
法定代表人：冯鹤年
联系人：李微
电话：010-85127570
传真：010-85127641
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

76）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：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：李一梅
联系人：仲秋玥
电话：010-88066632
传真：010-88066552
客服电话：400-817-5666
公司网址：www.amcfortune.com

77）金惠家保险代理有限公司
注册地址：北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址：北京西城区阜成门外大街2号万通新世界A2106
法定代表人：夏予柱
联系人：胡明哲
电话：010-68091380
传真：010-68091380
客服电话：400-855-7333
公司网址：www.jhjfund.com

78）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：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
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：沈怡
电话：027-87006009-8027
传真：027-87008010
客服电话：400-027-9899
公司网址：www.buyfunds.cn

79）大有期货有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
法定代表人：沈众辉
联系人：马科
电话：0731-84409106
传真：0731-84409009
客服电话：4006 365 058
公司网址：www.dayouf.com

80）联储证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑B座26楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦8楼
法定代表人：沙常明
联系人：丁倩云
电话：010-56177851
传真：010-56177855
客服电话：400-620-6868
公司网址：www.lczq.com

81）上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
联系人：李娟
电话：021-50810687
传真：021-58300279
客服电话：021-50810673
公司网址：www.wacaijijin.com

82）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：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：刘汉青
联系人：喻明明
电话：18671197190
传真：025-66008800-884131
客服电话：95177
公司网址：www.snjijin.com

83）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：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：王芳芳
电话：010-59013828
传真：暂无
客服电话：010-59013842
公司网址：http://www.wanjiawealth.com

84）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
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(750000)
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 (100000)
法定代表人：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
传真：010-58160173
客服电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com

85）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人：张冠宇
联系人：刘美薇
电话：010-85870662
传真：4008875666-129666
客服电话：400-819-9868
公司网址：wwww.datangwealth.com

86）深圳信诚基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3906室
法定代表人：周文
联系人：殷浩然
电话：010-84865370
传真：010-84865051
客服电话：0755-23946579
公司网址：www.ecpefund.com

87）上海爱建财富管理有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室
办公地址：上海市徐汇区肇嘉浜路746号爱建金融大厦
法定代表人：马金
联系人：蔡俊
电话：021-64382399
传真：64388012
客服电话：021-64382363
公司网址：www.ajcf.com.cn

88）扬州国信嘉利基金销售有限公司
注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋
办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320
法定代表人：刘晓光
联系人：苏曦
电话：0514-82099618-805
传真：021-68811007
客服电话：4000216088
公司网址：www.gxjlcn.com

89）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：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
联系人：张佳琳
电话：021-20691831
传真：021-2069-1861
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com

90）上海好买基金销售有限公司
注册地址：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：陆敏
电话：021-20211847
传真：021-68596916
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

91）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号二号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座（北楼）25层
法定代表人：其实
联系人：朱钰
传真：021-54509953
客服电话：400-181-8188
公司网址：www.1234567.com.cn

92）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：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8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

93）北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：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
联系人：马林
电话：010-59601366-7024
传真：010-62020355
客服电话：4008188000
公司网址：www.myfp.com

94）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：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：李珍珍
电话：0571-88911818—8653
传真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com

95）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网站：http://www.fund123.cn

96）中期资产管理有限公司
注册地址：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：北京市朝阳区光华路16号中期大厦A座8层
法定代表人：姜新
联系人：尹庆
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客服电话：010-65807865
公司网站：www.cifcofund.com

97）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：刘洋
电话：010-85650628
客服电话：400-920-0022
公司网址：licaike.hexun.com

98）众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：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：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
客服电话：400-059-8888
公司网址：www.zscffund.com

99）中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人：王兵
联系人：孟夏
电话：010-65807829
公司网址：www.cifco.net
客服电话：95162、400-8888-160

100）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层
法定代表人：沈伟桦
联系人：张得仙
电话：010- 52413390
公司网址：www.yixinfund.com
客服电话：400-6099-200

101）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人：申健
联系人：宋楠
电话：（021）20219988*37492
公司网址：https://8.gw.com.cn/
客服电话：021-20219931

102）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人：马勇
联系人：文雯
电话：010-83363101
公司网址：http://8.jrj.com.cn/
客服电话：400-166-1188

103）恒丰银行股份有限公司
注册地址：山东省烟台市芝罘区南大街248号
办公地址：山东省烟台市芝罘区南大街248号
法定代表人：蔡国华
联系人：李胜贤
电话：021-20601975
公司网址：www.egbank.com.cn
客服电话：95395

104）泉州银行股份有限公司
注册地址：泉州市云鹿路3号
办公地址：泉州市云鹿路3号
法定代表人：傅子能
联系人：傅彩芬
电话：0595-22551071
公司网址：www.qzccbank.com
客服电话：400-88-96312

105）上海财咖啡基金销售有限公司
注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1168号B座1701A室
办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1168号B座1701A室
法定代表人：周泉恭
联系人：罗开林
电话：021-61600500-8013
公司网址：www.caicoffeefund.com
客服电话：021-61600500

106）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：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：郭爱丽
电话：010-66154828-8013
传真：010-63583991
公司网址：www.5irich.com
客服电话：400-6262-818

107）佳泓（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号
办公地址：北京市朝阳区光华路7号汉威大厦B1210
法定代表人：谢亚凡
联系人：陈冲
电话：010-65617753
公司网址：www.haofunds.com
客服电话：010-88580321

108）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
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：张晶
联系人：臧静
电话：021-54677088-6732
传真：021-33323830
公司网址：tty.chinapnr.com
客服电话：400-820-2819

109）上海利得基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢12层(陆家嘴软件园10号楼)
法定代表人：李兴春
联系人：陈孜明
公司网址：www.leadfund.com.cn
客服电话：400-921-7755

110）北京钱景基金销售有限公司
住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：车倩倩
电话：010-57418813
传真：010-57569671
公司网址：www.qianjing.com
客服电话：400-893-6885

111）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
联系人：钟苓玉
电话：010-67000988-6046
公司网址：www.zcvc.com.cn
客服电话：400-001-8811

112）诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：中国上海市杨浦区昆明路508号B座12F
法定代表人：汪静波
联系人：朱了
电话：021-80358749
公司网址：www.noah-fund.com
客服电话：400-821-5399

113）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：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14楼
法定代表人：郭坚
联系人：程晨
公司网址：www.lufunds.com
客服电话：4008219031

114）北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
法定代表人：胡伟
联系人：陈铭洲
公司网址：www.pintec.com
客服电话：400-068-1176

115）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海横琴新区宝华路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楼1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：邱湘湘
公司网址：www.yingmi.cn
客服电话：020-89629066

116）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：江苏省南京市秦淮区中山南路1号南京中心66楼
法定代表人：袁顾明
联系人：孟召社
联系电话：021-20324176
公司网址：www.dtfunds.com
客服电话：400-928-2266

117）上海联泰资产管理有限公司
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
办公地址：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：陈东
公司网址：www.66zichan.com
客服电话：4000-466-788

118）和耕传承基金销售有限公司
注册地址：河南省郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场2号楼701
办公地址：河南省郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场2号楼701
法定代表人：李淑慧
联系人：郭兆英
联系电话：0371-5521 3196
公司网址：www.hgccpb.com
客服电话：4000555671

119）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：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：张林
联系电话：010-65983311
公司网址：www.igesafe.com
客服电话：010-82350618

120）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
联系人：刘勇
联系电话：0755-83999907-8814
公司网址：www.jinqianwo.cn
客服电话：0755-83999907

121）海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号6楼
法定代表人：刘惠
联系人：毛林
联系电话：021-80133597
公司网址：www.fundhaiyin.com
客服电话：400-808-1016

122）北京电盈基金销售有限公司
注册地址：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
联系电话：010-56176104
公司网址：www.dianyingfund.com
客服电话：400-100-3391

123）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4F
法定代表人：陈继武
联系人：黄祎
公司网址：www.vstonewealth.com
客服电话：4000-178-000

124）北京广源达信投资管理有限公司
注册地址：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浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
联系人：王永霞
联系电话：010-82055860
公司网址：www.niuniufund.com
客服电话：400-623-6060

125）深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
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
联系人：张烨
公司网址：www.jfzinv.com
客服电话：4009500888

126）上海万得基金销售有限公司
注册地址：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
客服电话：021-51327185

127）北京蛋卷基金销售有限公司
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
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO 塔3 19层
法定代表人：钟斐斐
联系人：戚晓强
公司网址：https://danjuanapp.com/
客服电话：4000618518

128）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：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
联系人：戴珉微
联系电话：021-33768132-801
公司网址：www.zzwealth.cn
客服电话：400-6767-5263

129）浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址：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 43 号金诚大厦 3F
法定代表人：徐黎云
联系人：孙成岩
联系电话：0571-88337717
公司网址：www.jincheng-fund.com
客服电话：400-068-0058

130）中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址：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：孟汉霄
联系电话：010-59336498
公司网址：www.jnlc.com
客服电话：4008-909-998

131）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法定代表人：陈超
联系人：锦星
公司网址：http://fund.jd.com
客服电话：95518

132）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：上海市锦康路308号7楼
法定代表人：戴新装
联系人：范泽杰
联系电话：021-20530186
公司网址：www.zhengtongfunds.com
客服电话：400-820-1515

133）天津国美基金销售有限公司
注册地址：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202-124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
联系人：许艳
公司网址：www.gomefund.com
客服电话：400-111-0889

134）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人：郭林
联系人：李颖
联系电话：021-38784818-8508
公司网址：www.shhxzq.com
客服电话：400-820-5999

135）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址：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：021-80234888-6693
公司网址：www.998fund.com
客服电话：400-998-7172

136）新纪元期货股份有限公司
注册地址：江苏省徐州市淮海东路153号
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦8楼
法定代表人：刘莎
联系人：王诗航
公司网址：www.neweraqh.com.cn
客服电话：0516-83831115

137）上海有鱼基金销售有限公司
注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址：上海徐汇区桂平路391号B座19层
法定代表人：林琼
联系人：黄志鹏
客服电话：021-60907978
公司网址：www.youyufund.com

138）上海通华财富资产管理有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼
法定代表人：兰奇
联系人：庄洁茹
客服电话：95156转5
公司网址：www.tonghuafund.com

139）深圳盈信基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
法定代表人：苗宏升
联系人：胡碧宣
客服电话：4007-903-688
公司网址：http://www.fundying.com

3、H类份额的销售机构为具备基金销售资格的由香港代表选聘或基金管理人直接选聘的相关销售机构。

4、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他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：华泰柏瑞基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：贾波
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
电话：400-888-0001，（021）38601777
传真：（021）50103016
联系人：赵景云

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人：王玲
电话：（021）24126000
传真：（021）24126150
经办律师：靳庆军、傅轶
联系人：傅轶

（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：中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：单峰、曹阳

四、基金的名称

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的投资目标

在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在8%以内。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为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、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。

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（包括公告等）后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例不低于基金资产的60%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金利用定量投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。

1、比较基准的标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

沪深300指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深300的价格指数。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的标的指数。

2、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略

本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的85%。

（1）多因子alpha 模型——股票超额回报预测

多因子alpha 模型以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha 模型的因子可归为如下几类：价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。

多因子alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师预测等等多方面的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

（2）风险估测模型——有效控制预期风险

纯指数化投资力求跟踪误差最小，指数增强投资策略则需要力求将跟踪误差控制在一定范围之内。本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险（用跟踪误差衡量）控制在目标范围内。

（3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，进行投资收益的优化。

（4）投资组合的优化

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括指数成份股和非指数成份股中，流动性和基本面信息较好的股票。

（5）投资组合的调整

本基金将根据所考虑各种信息的变化情况，对投资组合进行重新优化，调整投资组合的构成，并根据市场情况适当控制和调整投资组合的换手率。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

4、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

5、融资融券和转融资转融券

从投资人的利益出发，本基金可在法律法规允许的范围内参与适当的融资融券和转融资转融券业务。

九、基金的业绩比较基准

95%×沪深300指数收益率＋2.5%（指年收益率，评价时按期间折算）

沪深300指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深300的价格指数。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。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，覆盖了沪深市场六成左右的市值，能够反映市场主流投资的收益情况。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金的风险控制将力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在目标范围以内。因本基金为指数增强投资基金，跟踪误差的计算将剔除主动回报的均值。另外，在特殊情况下，从保护投资人利益出发对基金股票仓位做出调整，以至于股票持仓比例较大低于正常水平时，基金由此获得的对投资人有利的正收益不计入跟踪误差的计算，但基金由此获得的负收益则要计入跟踪误差的计算。

十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为2018年6月30日。

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 | 4,933,203,198.39 | 89.32 |
|  | 其中：股票 | 4,933,203,198.39 | 89.32 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 120,030,000.00 | 2.17 |
|  | 其中：债券 | 120,030,000.00 | 2.17 |
|  | 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 | 309,086,797.46 | 5.60 |
| 8 | 其他资产 | 160,660,130.95 | 2.91 |
| 9 | 合计 | 5,522,980,126.80 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 15,979,189.69 | 0.29 |
| B | 采矿业 | 52,557,929.74 | 0.96 |
| C | 制造业 | 2,386,508,698.62 | 43.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 112,436,302.07 | 2.05 |
| E | 建筑业 | 244,391,672.70 | 4.45 |
| F | 批发和零售业 | 133,991,083.94 | 2.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 109,211,661.33 | 1.99 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 288,242,963.50 | 5.25 |
| J | 金融业 | 1,318,380,238.47 | 24.01 |
| K | 房地产业 | 169,852,771.80 | 3.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 30,312,110.24 | 0.55 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 56,161,054.34 | 1.02 |
| 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 | 15,177,521.95 | 0.28 |
| S | 综合 | – | – |
|  | 合计 | 4,933,203,198.39 | 89.83 |

2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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 | 601318 | 中国平安 | 5,013,058 | 293,664,937.64 | 5.35 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 39,884,600 | 137,203,024.00 | 2.50 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 13,302,273 | 109,211,661.33 | 1.99 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 2,127,087 | 100,292,152.05 | 1.83 |
| 5 | 000338 | 潍柴动力 | 10,559,532 | 92,395,905.00 | 1.68 |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 17,104,097 | 90,993,796.04 | 1.66 |
| 7 | 601186 | 中国铁建 | 10,400,722 | 89,654,223.64 | 1.63 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 673,551 | 88,639,311.60 | 1.61 |
| 9 | 601788 | 光大证券 | 7,024,263 | 77,126,407.74 | 1.40 |
| 10 | 601800 | 中国交建 | 6,460,119 | 73,580,755.41 | 1.34 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 120,030,000.00 | 2.19 |
|  | 其中：政策性金融债 | 120,030,000.00 | 2.19 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 120,030,000.00 | 2.19 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 170410 | 17农发10 | 1,000,000 | 100,030,000.00 | 1.82 |
| 2 | 170207 | 17国开07 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.36 |

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

注：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序的前五名贵金属投资明细

注：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

注：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

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF1809 | IF1809 | 51 | 52,674,840.00 | -3,895,860.00 | – |
| 公允价值变动总额合计（元） |  |  |  |  | -3,895,860.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） |  |  |  |  | 624,540.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |  |  |  |  | -3,895,860.00 |

2）本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间，股指期货仍然大幅贴水，我们选择保持一定比例的股指期货长仓，一方面获取比较确定的超额收益。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 8,918,390.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 146,370,227.67 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 4,129,388.43 |
| 5 | 应收申购款 | 1,242,124.82 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 160,660,130.95 |

4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末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

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

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。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。

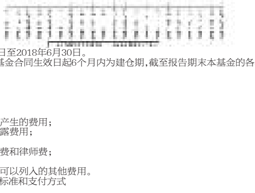
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2018年6月30日。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | 3.10% | 0.98% | 4.71% | 1.08% | -1.61% | -0.10% |
| 2014年 | 70.42% | 1.12% | 52.47% | 1.15% | 17.95% | -0.03% |
| 2015年 | 24.77% | 2.5% | 8.39% | 2.36% | 16.38% | 0.14% |
| 2016年 | -1.36% | 1.42% | -8.34% | 1.33% | 6.98% | 0.09% |
| 2017年 | 22.10% | 0.65% | 23.70% | 0.61% | -1.60% | 0.04% |
| 过去6个月 | -9.88% | 1.16% | -11.15% | 1.10% | 1.27% | 0.06% |
| 成立至今 | 137.96% | 1.49% | 74.33% | 1.43% | 63.63% | 0.06% |

2、图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、图示日期为2013年8月2日至2018年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

十三、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、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
4、基金合同生效以后的信息披露费用；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
7、基金资产的资金汇划费用；
8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.00%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。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

基金托管费每日计提，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。

3、本条第（一）款第3 至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（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协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照中国、中国香港及投资人所在国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、“三、基金管理人”部分，对董事会成员的相关信息作了更新。
2、“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
3、“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息。
4、“十、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
5、“十一、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
6、“一、绪言”、“二、释义”、“八、基金份额的申购赎回与转换”、“十、基金的投资”、“十三、基金资产估值”、“十七、基金的信息披露”、“二十一、基金托管协议的内容摘要”等部分，根据基金流动性风险管理规定的内容作了修订。
7、“二十三、其他应披露事项”部分，根据前次招募说明书（更新）公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一八年九月十四日

---

# 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞天添宝货币市场基金B类增加代销机构同时开通基金转换、参加转换费率优惠等业务的公告

为满足广大投资者的理财需求，根据华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与上海陆金所基金销售有限公司(以下简称“陆金所”)签订的《开放式证券投资基金销售代理主协议》、《华泰柏瑞基金旗下证券投资基金年度销售和服务代理补充协议》，陆金所自2018年9月17日起增加代销华泰柏瑞天添宝货币市场基金B类，同时开通基金转换、参加转换费率优惠等业务，具体事宜公告如下：

一、适用基金

| 序号 | 基金名称 | 基金代码 |
|---|---|---|
| 1 | 华泰柏瑞天添宝货币市场基金B类 | 003871 |

自2018年9月17日起，投资者可通过陆金所的任何渠道办理上述基金开户、申购、赎回等业务。

二、通过陆金所开通上述基金转换业务

本公司自2018年9月17日起在陆金所开通上述基金转换业务，基金转换费用的收取方法及业务规则请参见基金最新的招募说明书及本公司已刊登的基金间办理转换业务的相关公告，投资者申请基金转换时应遵循陆金所的规定提交业务申请。

三、参加陆金所转换费率优惠活动

自2018年9月17日起投资者通过陆金所转换上述基金，其转换补差费率可享费率优惠，具体业务办理规定以陆金所的相关规定和公告为准。

四、业务咨询

陆金所的开放式基金代销资格已获中国证监会批准。投资者若有疑问，可通过以下途径咨询有关情况：

1、上海陆金所基金销售有限公司
公司网址：www.lufunds.com
客服电话：4008219031

2、华泰柏瑞基金管理有限公司
公司网址：www.huatai-pb.com
客服电话：400-888-0001，（021）38784638

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2018年 9月 14 日