

易方达量化策略精选灵活配置混合型 证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二〇年三月

重要提示

1、本基金根据 2015 年 11 月 26 日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2746 号）和 2017 年 5 月 2 日《关于易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2017]1098 号）进行募集。本基金基金合同于 2017 年 12 月 19 日正式生效。

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。

2、基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

3、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。投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险；基金投资过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险；因依托于腾讯财经大数据，并采用量化策略进行投资管理所带来的特有风险；基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险；本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，以及证券公司短期公司债券、中小企业私募债等品种，可能给本基金带来额外风险等。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

4、本基金为混合型基金，理论上其预期风险与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。

5、基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的

风险。

6、基金不同于银行储蓄，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

7、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

8、基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书基金经理变更相关信息更新截止日为 2020 年 3 月 12 日。除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2020 年 2 月 16 日，有关财务数据截止日为 2019 年 12 月 31 日，净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

法定代表人：刘晓艳

设立日期：2001年4月17日

组织形式：有限责任公司

注册资本：13,244.2万元人民币

存续期限：持续经营

联系人：李红枫

联系电话：4008818088

2、股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	22.6514%
广发证券股份有限公司	22.6514%
盈峰控股集团有限公司	22.6514%
广东省广晟资产经营有限公司	15.1010%
广州市广永国有资产经营有限公司	7.5505%
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5087%
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.6205%
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5309%
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.7558%
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.4396%
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	1.5388%
总计	100%

（二）主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主

持工作)；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

周泽群先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任珠海粤财实业有限公司董事长；粤财控股（北京）有限公司总经理、董事长；广东粤财投资控股有限公司总经理助理、办公室主任，广东粤财投资控股有限公司副总经理。现任易方达基金管理有限公司董事；广东粤财投资控股有限公司董事、总经理。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理；广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长；广发控股（香港）有限公司董事；广发证券资产管理（广东）有限公司董事长。现任易方达基金管理有限公司董事；广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理；广发控股（香港）有限公司董事长。

陈志辉先生，管理学硕士，董事。曾任美的集团税务总监；安永会计师事务所广州分所高级审计员；盈峰控股集团有限公司资财中心总经理。现任易方达基金管理有限公司董事；宁波盈峰股权投资基金管理有限公司合伙人、联席总裁；深圳市盈峰环保产业基金管理有限公司监事；广东顺德盈峰互联网产业投资管理有限公司监事；广东神华保险代理有限公司董事；厦门瑞为信息技术有限公司董事。

戚思胤先生，经济学硕士，董事。曾任广东省高速公路发展股份有限公司证券部投资者关系管理业务员、投资者关系管理主管、信息披露主管、证券事务代表；广东省广晟资产经营有限公司资本运营部高级主管、团委副书记、副部长、部长；（香港）广晟投资发展有限公司董事、常务副总经理等职务。现任易方达基金管理有限公司董事；广东省广晟资产经营有限公司董事会办公室（法务中心）主任；广东风华高新科技股份有限公司董事；佛山电器照明股份有限公司董事；深圳市中金岭南有色金属股份有限公司董事；佛山市国星光电股份有限公司董事；广东南粤银行股份有限公司董事。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡

胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任易方达基金管理有限公司独立董事；中欧国际工商学院教授；复星旅游文化集团（开曼）有限公司独立董事。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任易方达基金管理有限公司独立董事；中山大学管理学院教授；中远海运特种运输股份有限公司独立董事；上海莱士血液制品股份有限公司独立董事；珠海华发实业股份有限公司独立董事；广州恒运企业集团股份有限公司独立董事；中国南方航空股份有限公司独立董事；广州环保投资集团有限公司外部董事。

庄伟燕女士，法学博士，独立董事。曾任广东省妇女联合会干部；广东鸿鼎律师事务所主任；广东广悦鸿鼎律师事务所管委会主任。现任易方达基金管理有限公司独立董事；广东广信君达律师事务所高级合伙人。

刘发宏先生，工商管理硕士（MBA），监事会主席。曾任天津商学院团总支书记兼政治辅导员、人事处干部；海南省三亚国际奥林匹克射击娱乐中心会计主管；三英（珠海）纺织有限公司财务主管；珠海市饼业食品有限公司财务部长、审计部长；珠海市国弘财务顾问有限公司项目经理；珠海市迪威有限公司会计师；珠海市卡都九洲食品有限公司财务总监；珠海格力集团（派驻下属企业）财务总监；珠海市国资委（派驻国有企业）财务总监；珠海港置业开发有限公司总经理；酒鬼酒股份有限公司副总经理；广东粤财投资控股有限公司审计部总经理；广东粤财信托有限公司党委委员、副书记。现任易方达基金管理有限公司监事会主席；广东粤财投资控股有限公司纪委委员、党委办主任、人力资源部总经理。

董志钢先生，法学学士，监事。曾任中国建设银行广东省分行法律事务部科员、脱钩办法律事务室副经理、中农信托管办任经理；中国信达资产管理公司广州办事处处置办处置业务部经理；广东卓信律师事务所律师；广东合邦律师事务所律师；广东省粤科资产管理股份有限公司总经理。现任易方达基金管理有限公司监事；广州市广永国有资产经营有限公司党总支部委员会委员、董事长；广州广永股权投资基金管理有限公司董事长；广州广永投资管理有限公司支部书记、董事长、总经理。

陈国祥先生，经济学硕士，监事。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管

理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司监事、总裁助理、综合管理部总经理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

邓志盛先生，经济学研究生，监事。曾任广东证监会信息部部长、中国证监会广州证管办机构二处处长；金鹰基金管理有限公司副总经理；易方达基金管理有限公司综合管理部总经理、董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司监事、行政总监。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理；深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士(EMBA)，副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达资产管理(香港)有限公司董事、人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人、证券交易负责人员(RO)、就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)、固定收益投资决策委员会委员、产品审批委员会委员。

吴欣荣先生，工学硕士，副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方

达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官。

关秀霞女士，财务硕士、工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析员；Daniel Dennis 高级审计师；美国道富银行波士顿及亚洲总部大中华地区高级副总裁、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计部高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），首席养老金业务官。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任；浦东发展银行总行企业年金部总经理；长江养老保险公司首席市场总监；易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

陈荣女士，经济学博士，首席运营官。曾任中国人民银行广州分行统计研究处科员；易方达基金管理有限公司运作支持部经理、核算部总经理助理、核算部副总经理、核算部总经理、投资风险管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司首席运营官、公司财务中心主任；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理有限公司监事；易方达海外投资（深圳）有限公司监事。

汪兰英女士，工学学士、法学学士，首席大类资产配置官。曾任中信证券股份有限公司风险投资部投资经理助理；中国证监会基金监管部副主任科员、主任科员、副处长、处长；中国人寿资产管理有限公司风险管理部副总经理（主持工作）、项目评审部副总经理（主持工作）、基金投资部副总经理（主持工作）。现任易方达基金管理有限公司首席大类资产配置官；易方达资产管理有限公司董事。

2、基金经理

官泽帆先生，金融数学硕士。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、投资经理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理（自 2016 年 9 月

24 日起任职)、易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 12 月 19 日起任职)、易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 1 月 24 日起任职)。

HUANG JIANSHENG (黄健生) 先生, 计算机硕士、应用力学硕士、工商管理硕士。曾任美国 Sun Microsystems 资深软件工程师, 美国 GMN Capital/伦敦 GSA Capital 量化投资研究员, 美国巴克莱全球投资者 (Barclays Global Investors) 量化研究员, 加拿大阿尔伯塔投资管理公司副基金经理, 华泰柏瑞基金管理有限公司量化投资部门总监、投资经理。现任易方达基金管理有限公司量化投资部总经理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 12 日起任职)、易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 12 日起任职)。

3、量化投资决策委员会成员

本公司量化投资决策委员会成员包括: 林飞先生、HUANG JIANSHENG (黄健生) 先生、王建军先生。

林飞先生, 经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理, 易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数与量化投资部总经理、量化基金组合部总经理、指数与量化投资管理总部总经理、指数及增强投资部总经理、量化策略部总经理、量化投资部代总经理、指数管理总部总经理、解决方案部总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数增强投资部总经理、投资经理, 易方达资产管理(香港)有限公司就证券提供意见负责人员 (RO)、提供资产管理负责人员 (RO)、证券交易负责人员 (RO)。

HUANG JIANSHENG (黄健生) 先生, 同上。

王建军先生, 经济学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师, 易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达创业板交易型开

放式指数证券投资基金基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司量化投资部副总经理、投资经理。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

法定代表人：刘晓艳

电话：020-85102506

传真：4008818099

联系人：王峰

网址: www.efunds.com.cn

直销机构网点信息:

(1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40F

电话: 020-85102506

传真: 4008818099

联系人: 王峰

(2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址: 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 18 层

电话: 010-63213377

传真: 4008818099

联系人: 刘蕾

(3) 易方达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 88 号金茂大厦 46 楼

电话: 021-50476668

传真: 4008818099

联系人: 于楠

(4) 易方达基金管理有限公司网上交易系统

网址: www.efunds.com.cn

2、非直销销售机构

(1) 中国建设银行

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 田国立

联系人: 王未雨

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

(2) 广发银行

注册地址: 广东省广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：王滨

客户服务电话：400-830-8003

网址：www.cgbchina.com.cn

(3) 平安银行

注册地址：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

联系人：赵杨

联系电话：0755-22166574

客户服务电话：95511-3

传真：021-50979507

网址：bank.pingan.com

(4) 浦发银行

注册地址：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：郑杨

联系人：赵守良

联系电话：021-61618888

客户服务电话：95528

传真：021-63604196

网址：www.spdb.com.cn

(5) 招商银行

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：季平伟

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(6) 中国工商银行

注册地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：杨菲

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(7) 中国银行

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：刘连舸

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(8) 中信银行

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

客户服务电话：95558

传真：010-85230049

网址：bank.ecitic.com

(9) 广东华兴银行

注册地址：广东省汕头市龙湖区黄山路 28 号四层

办公地址：广州市天河区天河路 533 号

法定代表人：周泽荣

联系人：许悦

联系电话：020-38173552

客户服务电话：4008308001

传真：020-38173857

网址: www.ghbank.com.cn

(10) 杭州银行

注册地址: 浙江省杭州市下城区庆春路 46 号

办公地址: 杭州市下城区庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人: 陈震山

联系人: 陈振峰

联系电话: 0571-85872972

客户服务电话: 95398

传真: 0571-85106576

网址: www.hzbank.com.cn

(11) 华融湘江银行

注册地址: 长沙市天心区芙蓉南路一段 828 号杰座大厦

办公地址: 湖南省长沙市湘府东路二段 208 号万境财智中心南栋

法定代表人: 张永宏

联系人: 闫娇蓉

联系电话: 0731-89828182

客户服务电话: 0731-96599

传真: 0731-89828806

网址: www.hrxjbank.com.cn

(12) 安信证券

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 王连志

联系人: 陈剑虹

联系电话: 0755-82825551

客户服务电话: 95517

传真: 0755-82558355

网址: www.essence.com.cn

(13) 渤海证券

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：安志勇

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户服务电话：400-651-5988

传真：022-28451892

网址：www.ewww.com.cn

(14) 长城国瑞证券

注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

法定代表人：王勇

联系人：邱震

联系电话：0592-2079259

客户服务电话：400-0099-886

传真：0592-2079602

网址：www.gwgsc.com

(15) 长城证券

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层长城证券

法定代表人：曹宏

联系人：梁浩

联系电话：0755-83530715

客户服务电话：400-6666-888

传真：0755-83516199

网址：www.cgws.com

(16) 长江证券

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

联系电话：027-65799999

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(17) 川财证券

注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座
17 楼

办公地址：四川省成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼

法定代表人：孟建军

联系人：匡婷

联系电话：028-86583053

客户服务电话：028-962708

网址：www.cczq.com

(18) 大同证券

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 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 F12、F13

法定代表人：董祥

联系人：薛津

联系电话：0351-4130322

客户服务电话：4007121212

传真：0351-7219891

网址：www.dtsbc.com.cn

(19) 德邦证券

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘熠

联系电话：021-68761616

客户服务电话：400-8888-128

传真：021-68767880

网址：<http://www.tebon.com.cn>

(20) 第一创业证券

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

联系电话：0755-23838750

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

(21) 东北证券

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

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

客户服务电话：95360

传真：0431-85096795

网址：www.nesc.cn

(22) 东吴证券

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

客户服务电话：95330

传真：0512-65588021

网址：www.dwzq.com.cn

(23) 光大证券

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：龚俊涛

联系电话：021-22169999

客户服务电话：95525

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(24) 广发证券

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或 02095575

网址：www.gf.com.cn

(25) 国都证券

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：王少华

联系人：黄静

联系电话：010-84183389

客户服务电话：400-818-8118

传真：010-84183311-3122

网址：www.guodu.com

(26) 国金证券

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、黎建平

联系电话：028-86690057

客户服务电话：95310

传真：028-86690126

网址：www.gjzq.com.cn

(27) 国联证券

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

联系电话：0510-82831662

客户服务电话：95570

传真：0510-82830162

网址：www.glsc.com.cn

(28) 国泰君安证券

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

客户服务电话：95521

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

(29) 国信证券

注册地址：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：李颖

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

(30) 海通证券

注册地址：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：周杰

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553

传真：021-23219100

网址：www.htsec.com

(31) 华安证券

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

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318

传真：0551-65161825

网址：www.hazq.com

(32) 华福证券

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18-19 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：021-20655183

客户服务电话：95547

传真：021-20655196

网址：www.hfzq.com.cn

(33) 华龙证券

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：陈牧原

联系人：范坤

联系电话：0931-4890208

客户服务电话：95368、400-689-8888

传真：0931-4890628

网址：www.hlzq.com

(34) 华泰证券

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

法定代表人：张伟

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户服务电话：95597

传真：025-83387523

网址：www.htsc.com.cn

(35) 华西证券

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

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：张彬

联系电话：010-58124967

客户服务电话：95584

传真：028-86150040

网址：www.hx168.com.cn

(36) 江海证券

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：姜志伟

联系电话：0451-87765732

客户服务电话：956007

传真：0451-82337279

网址：www.jhzq.com.cn

(37) 联储证券

注册地址：广东省深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 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：吕春卫

联系人：张婉婷

联系电话：010-86499765

客户服务电话：400-620-6868

网址：www.lczq.com

(38) 南京证券

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

联系电话：025-58519523

客户服务电话：95386

传真：025-83369725

网址：www.njzq.com.cn

(39) 平安证券

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周驰

联系电话：021-38643230

客户服务电话：95511-8

传真：021-58991896

网址：stock.pingan.com

(40) 申万宏源西部证券

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

法定代表人：李琦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(41) 申万宏源证券

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 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：杨玉成

联系人：余敏

联系电话：021-33388252

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-33388224

网址：www.swhysc.com

(42) 世纪证券

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：李强

联系人：王雯

联系电话：0755-83199511

客户服务电话：4008323000

网址：www.cscoc.com.cn

(43) 首创证券

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

联系人：刘宇

联系电话：010-59366070

客户服务电话：400-620-0620

传真：010-59366055

网址：<http://www.sczq.com.cn/>

(44) 天风证券

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

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

法定代表人：余磊

联系人：程晓英

联系电话：027-87617017

客户服务电话：4008005000、95391

传真：027-87618863

网址：<http://www.tfzq.com/>

(45) 万联证券

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层

法定代表人：罗钦城

联系人：甘蕾

联系电话：020-38286026

客户服务电话：95322

传真：020-38286588

网址：www.wlzq.cn

(46) 西部证券

注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

联系人：梁承华

联系电话：029-87211526

客户服务电话：95582

传真：029-87211478

网址：www.westsecu.com

(47) 西南证券

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：廖庆轩

联系人：周青

联系电话：023-63786633

客户服务电话：4008096096 或 95355

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

(48) 新时代证券

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：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

联系电话：010-83561146

客户服务电话：95399

网址: www.xsdzq.cn

(49) 信达证券

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: 肖林

联系人: 尹旭航

联系电话: 010-63081000

客户服务电话: 95321

传真: 010-63080978

网址: www.cindasc.com

(50) 银河证券

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

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: 陈共炎

联系人: 辛国政

联系电话: 010-83574507

客户服务电话: 4008-888-888 或 95551

网址: www.chinastock.com.cn

(51) 粤开证券

注册地址: 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: 深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人: 严亦斌

联系人: 彭莲

联系电话: 0755-83331195

客户服务电话: 95564

公司网址: <http://www.ykzq.com>

(52) 浙商证券

注册地址: 浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址: 浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：高扬

联系电话：0571-87902974

客户服务电话：95345

传真：0571-87901913

网址：www.stocke.com.cn

(53) 中金公司

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：沈如军

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166

客户服务电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

(54) 中山证券

注册地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

(55) 中泰证券

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户服务电话：95538

传真：0531-68889095

网址：www.zts.com.cn

(56) 中天证券

注册地址：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

联系人：李泓灏

联系电话：024-23255256

客户服务电话：024-95346

传真：024-23255606

网址：www.iztzq.com

(57) 中信建投证券

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

联系电话：010-85130554

客户服务电话：95587 或 4008-888-108

网址：http://www.csc108.com/

(58) 中信证券

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：王一通

联系电话：010-60838888

客户服务电话：95548

传真：010-60836029

网址：www.cs.ecitic.com

(59) 中信证券（华南）

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

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

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95396

传真：020-88836984

网址：www.gzs.com.cn

(60) 中信证券（山东）

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：焦刚

联系电话：0531-89606166

客户服务电话：95548

传真：0532-85022605

网址：<http://sd.citics.com/>

(61) 中银国际证券

注册地址：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 39-40 层

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

客户服务电话：400-620-8888

传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com

(62) 中邮证券

注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号（陕西邮政信息大厦 9-11 层）

办公地址：北京市东城区珠市口东大街 17 号

法定代表人：丁奇文

联系人：岳帅

联系电话：010-67017788-6068

客户服务电话：4008-888-005

传真：010-67017788-9696

网址：www.cnpsec.com

(63) 中原证券

注册地址：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 号中原广发金融大厦 19 楼

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳 李盼盼 党静

联系电话：0371-69099882

客户服务电话：95377

传真：0371-65585899

网址：www.ccnew.com

(64) 百度百盈

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：葛新

联系人：孙博超

联系电话：010-59403028

客户服务电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

(65) 长量基金

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 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

联系电话：021-20691935

客户服务电话：400-820-2899

传真：021-20691861

网址：www.erichfund.com

(66) 朝阳永续

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

法人代表：廖冰

联系人：陆纪青

联系电话：021-80234888-6813

客户服务电话：400-699-1888

网址：www.998fund.com

(67) 创金启富

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：李慧慧

联系电话：010-66154828-8047

客户服务电话：400-6262-818

传真：010-63583991

网址：www.5irich.com

(68) 大泰金石

注册地址：南京市建邺区江东中路 102 号 708 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：陈达伟

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

客户服务电话：400-995-9220

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

(69) 大智慧基金

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

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

法定代表人：申健

联系人：张蜓

联系电话：021-20219988-35374

客户服务电话：021-20292031

传真：021-20219923

网址：<https://www.wg.com.cn/>

(70) 蛋卷基金

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

联系电话：010-61840688

客户服务电话：4001599288

网址：<https://danjuanapp.com>

(71) 鼎信汇金

注册地址：北京市海淀区太月园 3 号楼 5 层 521 室

办公地址：北京市海淀区太月园 3 号楼 5 层 521 室

法定代表人：齐凌峰

联系人：阮志凌

联系电话：010-82050520

客户服务电话：400-886-3311

传真：010-82086110

网址：www.9ifund.com

(72) 东证期货

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 500 号上海期货大厦 14 层

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：张敏圆

联系电话：021-63325888-4259

客户服务电话：4008859999

传真：021-63326752

网址：www.dzqh.com.cn

(73) 富济基金

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：祝中村

联系人：曾瑶敏

联系电话：0755-83999907

客户服务电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

网址：www.fujifund.cn

(74) 海银基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号海银金融中心 4 楼

法定代表人：巩巧丽

联系人：毛林

联系电话：021-80133597

客户服务电话：400-808-1016

传真：021-80133413

网址：www.fundhaiyin.com

(75) 好买基金

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：高源

联系电话：021-36696312

客户服务电话：400-700-9665

传真：021-68596919

网址：www.ehowbuy.com

(76) 和讯信息

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

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：陈慧慧

联系电话：010-85657353

客户服务电话：400-920-0022

传真：010-65884788

网址：<http://licaike.hexun.com/>

(77) 虹点基金

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区工体北路甲 2 号盈科中心东门 2 层 216

法定代表人：何静

联系人：牛亚楠

联系电话：010-65951887

客户服务电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

(78) 华夏财富

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：毛淮平

联系人：张静怡

联系电话：010-88066632

客户服务电话：400-817-5666

传真：010-63136184

网址: www.amcfortune.com

(79) 汇成基金

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址: 北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 19 层 19C13

法定代表人: 王伟刚

联系人: 王骁骁

联系电话: 010-56251471

客户服务电话: 400-619-9059

网址: www.hcjijin.com

(80) 汇付基金

注册地址: 上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址: 上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 汇付天下总部大楼

法定代表人: 金佶

联系人: 甄宝林

联系电话: 021-34013996-3011

客户服务电话: 021-34013999

传真: 021-33323837

网址: www.hotjijin.com

(81) 济安财富

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 号楼冠捷大厦 3 层 307 单元

法定代表人: 杨健

联系人: 李海燕

联系电话: 010-65309516

客户服务电话: 400-673-7010 (济安财富官网) 400-071-6766 (腾讯财经)

传真: 010-65330699

网址: www.jianfortune.com

(82) 嘉实财富

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

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：李雯

联系电话：010-60842306

客户服务电话：400-021-8850

传真：010-85712195

网址：www.harvestwm.cn

(83) 金观诚

注册地址：杭州拱墅区登云路 45 号金诚集团（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州拱墅区登云路 55 号金诚集团（锦昌大厦）

法定代表人：蒋雪琦

联系人：来舒岚

联系电话：0571-88337888

客户服务电话：4000680058

传真：0571-88337666

网址：http://www.jincheng-fund.com/

(84) 凯石财富

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：冯强

联系电话：021-63333389

客户服务电话：4006-433-389

传真：021-63333390

网址：www.vstonewealth.com

(85) 肯特瑞基金

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座

法定代表人：王苏宁

联系人：娄云

联系电话：010-89189291

客户服务电话：95118

网址：<http://fund.jd.com/>

(86) 利得基金

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

联系电话：86-021-50583533

客户服务电话：95733

传真：86-21-61101630

网址：www.leadfund.com.cn

(87) 联泰基金

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：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客户服务电话：400-118-1188

传真：021-52975270

网址：www.66zichan.com

(88) 陆基金

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

办公地址：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：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

(89) 蚂蚁基金

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888

客户服务电话：4000-766-123

网址：http://www.fund123.cn/

(90) 民商基金

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

联系电话：021-50206003

客户服务电话：021-50206003

传真：021-50206001

网址：http://www.msftec.com/

(91) 诺亚正行

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

联系人：余翼飞

联系电话：021-80358749

客户服务电话：400-821-5399

传真：021-38509777

网址：www.noah-fund.com

(92) 浦领基金

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：聂婉君

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客户服务电话：400-012-5899

传真：010-64788016

网址：www.zscffund.com

(93) 钱景基金

注册地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址：北京市海淀区中关村东路 18 号财智国际大厦 B-1108

法定代表人：王利刚

联系人：姚付景

联系电话：010-62565181

客户服务电话：400-893-6885

传真：010-57569671

网址：www.qianjing.com

(94) 深圳新兰德

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：洪弘

联系人：张燕

联系电话：010-83363099

客户服务电话：400-166-1188

传真：010-83363010

网址：<http://8.jrj.com.cn>

(95) 苏宁基金

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：王锋

联系人：张云飞

联系电话：025-66996699-882796

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

(96) 天天基金

注册地址：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 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：屠彦洋

联系电话：021-54509977

客户服务电话：95021

传真：021-64385308

网址：www.1234567.com.cn

(97) 通华财富

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 楼

法定代表人：沈丹义

联系人：杨涛、庄洁茹

联系电话：021-60810586

客户服务电话：400-101-9301

传真：021-60810695

网址：www.tonghuafund.com

(98) 挖财基金

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 04 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 5 层 01、02、
03 层

法定代表人：吕柳霞

联系人：李娟

联系电话：021-50810687

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

(99) 万得基金

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：黄玮

联系人：徐亚丹

联系电话：021-50712782

客户服务电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

(100) 万家财富

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 A 座 5 层

法定代表人：张军

联系人：王芳芳

联系电话：010-59013828

客户服务电话：010-59013895

网址：http://www.wanjiawealth.com/

(101) 新浪仓石

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：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

联系人：赵芯蕊

联系电话：010-62625768

客户服务电话：010-62675369

传真：010-62676582

网址: www.xincai.com

(102) 鑫鼎盛

注册地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1502 室

办公地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1502 室

法定代表人: 陈洪生

联系人: 梁云波

联系电话: 0592-3122757

客户服务电话: 400-6533-789

网址: www.xds.com.cn

(103) 阳光人寿保险

注册地址: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室

法定代表人: 李科

联系人: 龙尧

联系电话: 010-59053779

客户服务电话: 95510

传真: 010-59053700

网址: <http://fund.sinosig.com>

(104) 一路财富

注册地址: 北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址: 北京市海淀区宝盛南路奥北科技园 20 号楼国泰大厦 9 层

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 刘栋栋

联系电话: 010-88312877

客户服务电话: 400-001-1566

传真: 010-88312099

网址: www.yilucaifu.com

(105) 宜信普泽

注册地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 9 层公寓 1008

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

联系电话：010-52413385

客户服务电话：400-6099-200

传真：010-85800047

网址：www.yixinfund.com

(106) 奕丰金融

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：0755-89460507

客户服务电话：400-684-0500

传真：0755-21674453

网址：www.ifastps.com.cn

(107) 盈米基金

注册地址：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路 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系电话：020-89629099

客户服务电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

(108) 云湾基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

办公地址：上海市浦东新区新金桥路 27 号 1 号楼

法定代表人：冯轶明

联系人：范泽杰

联系电话：021-20530186

客户服务电话：400-820-1515

传真：021-20539999

网址：<http://www.zhengtongfunds.com/>

(109) 增财基金

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

联系人：闫丽敏

联系电话：010-67000988

客户服务电话：400-001-8811

传真：010-67000988-6000

网址：www.zcvc.com.cn

(110) 展恒基金

注册地址：北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

联系电话：010-59601366-7167

客户服务电话：400-818-8000

传真：0351-4110714

网址：www.myfund.com

(111) 中国国际期货

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 6 层 609 号、610 号

办公地址：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

法定代表人：王兵

联系人：霍丽文

联系电话：010-65807827

客户服务电话：95162

传真：010-59539806

网址：<http://www.cifco.net/>

(112) 中信建投期货

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-

B、C

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：王广学

联系人：刘芸

联系电话：023-86769637

客户服务电话：400-8877-780

传真：023-86769629

网址：www.cfc108.com

(113) 中信期货

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 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：刘宏莹

联系电话：010-6083 3754

客户服务电话：400-990-8826

传真：021-60819988

网址：www.citicsf.com

(114) 中正达广

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

客户服务电话：400-6767-523

传真：021-33768132-802

网址：www.zhongzhengfund.com

(115) 中证金牛

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：沈晨

联系电话：010-59336544

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

(116) 众禄基金

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室

办公地址：深圳市罗湖区梨园路HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

联系电话：0755-33227950

客户服务电话：4006-788-887

传真：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(二) 基金登记机构

名称：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：刘晓艳

电话：4008818088

传真：020-38799249

联系人：余贤高

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：广东金桥百信律师事务所

地址：广州市珠江新城珠江东路 16 号高德置地冬广场 G 座 24 楼

负责人：聂卫国

电话：020-83338668

传真：020-83338088

经办律师：郑怡玲、曾金鑫

联系人：郑怡玲

（四）会计师事务所和经办注册会计师

本基金的法定验资机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：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

执行事务合伙人：TonyMao 毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：赵雅、李明明

联系人：赵雅

本基金的年度财务报表及其他规定事项的审计机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈熹、周祎

联系人：周祎

四、基金的名称

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采用量化策略进行投资组合管理，追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

量化策略是指根据金融市场历史数据，借助量化模型，进行金融市场的分析、判断和交易的策略。本基金基于不同市场情况，精选多种量化模型进行投资，运用的量化模型包括但不限于量化资产配置模型、多因子量化模型、行业轮动模型、事件超额收益模型。精选多种

量化模型进行投资的原因，一是建立多种量化策略可以弥补单一量化策略失效的可能，并形成互补，保证整体投资业绩的持续性；二是精选多种量化策略进行投资，量化策略之间相关性越低，组合的整体风险越分散，有利于追求基金资产的长期稳健增值。

1. 量化资产配置模型

“量化资产配置模型”运用现代行为金融学关于市场有限套利和投资者有限理性的理论，综合考虑宏观经济与相关政策预期、微观经济、市场情绪及投资者行为等因素，对金融市场的预期收益及风险进行预测，据此确定配置于权益类资产、固定收益资产、不同套利策略、现金类资产等不同资产上的投资比例，以达到获取市场收益、控制市场风险的目的。本基金量化资产配置模型主要考虑如下因素：

(1) 宏观经济因素。包括国内生产总值增长率及其构成、价格指数（CPI 和 PPI）的变动及其构成、货币供给与需求水平的变动、利率水平的变化及市场对此类因素的预期等；

(2) 政策预期因素。包括货币政策、财政政策以及与证券市场密切相关的其他各种政策出台对市场的影响及市场对此类因素的预期等；

(3) 微观经济因素。包括各行业盈利周期及其波动、各行业主要企业的盈利变化情况及各类投资机构的预期等；

(4) 市场情绪因素。包括市场供求资金供求关系及其变化、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、股票市场与债券市场的相对强弱、股票市场整体估值水平及其与历史水平的比较等；

(5) 投资者行为因素。包括各类投资者（各类机构投资者及个人投资者）在不同市场周期内对市场收益及风险的预期、资产配置比例及风险偏好等投资行为及其变化等。

2. 权益类品种投资策略

本基金权益类品种的投资策略主要基于基金管理人自主开发的多因子量化模型、行业轮动模型、事件超额收益模型。本基金在实际操作中，将根据各量化模型的预期收益、风险及其所使用的市场环境，不定期对模型进行优化和调整，以发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

1) 多因子量化模型

多因子量化模型利用定量方法，综合考虑宏观经济、上市公司基本面、市场情绪与投资者预期等多种因素，对股票的投资价值进行统计评估，利用市场中价格与价值的偏差获取长期持续的超额收益。

该模型在投资程序上分成两步：

一是根据现代投资组合理论，将股票收益按市场收益和超额收益两个维度进行分解，引进国际先进的量化对冲基金经验与模式，建立多因子模型对个股的超额收益进行预测。本基金在多因子模型中所使用的因子从信息来源上可分为：

①基本面因子：如估值水平、盈利能力和成长性指标等；

②技术因子：如价格动量、成交金额和换手率等；

③分析师因子：如分析师关注度、一致性和预期变化等；

④风险因子：如波动率和 Beta 等。

本基金管理人将根据市场环境的变化和因子的实际表现，适时调整各因子类别的具体组合及权重。

二是在超额收益预测的基础上，本基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化器，构建风险调整后的最优投资组合。

2) 行业轮动模型

行业轮动模型基于历史数据检验，并结合基金管理人对各个行业股价收益率关键指标的识别，提取有效的行业筛选因子；分析行业内的各个因子表现情况，滚动优化股票的行业内得分；有效捕获市场关注的热点主题与行业，行业内的有效因子以获取行业内股票的超额收益为目标；根据全行业全股票的汇总得分中，可以自动形成行业的超配、低配情形，获取行业轮动的收益。

3) 事件超额收益模型

研究发现，上市公司有些事件存在着获取超额收益的机会，包括定向增发策略、大宗交易策略等。本基金将利用市场中价格与价值的偏差，使用股指期货等衍生品进行套期保值，获取超额收益。

①定向增发是指向特定投资者非公开发行股票的融资方式。定向增发的股票份额在锁定期内不得转让，作为对其流通限制的补偿，定向增发的股票通常会折价发行。持有定向增发股票的投资者将会面临市场系统性风险和个股非系统性风险。

②大宗交易通过沪深两市大宗交易平台进行。由于大宗交易涉及证券的交易数量或金额通常远超过该证券二级市场平均交易规模，若直接在二级市场进行交易可能受流动性限制，因此大宗交易的卖方通常会向买方提供一定的折价，作为对流动性限制的补偿。

除了上述策略，本基金管理人的数量化投资团队还将不断开发新的适合国内市场的量化投资策略，适时补充、更换本基金的股票投资模型。

3. 衍生产品投资策略

（1）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

（2）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。权证的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。

（3）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

4. 债券投资策略

（1）在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

（2）证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，确定投资决策。此外，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，并适当控制债券投资组合整体的久期，保证本基金的流动性。

（3）中小企业私募债投资策略

本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债进行投资，主要采取分散化投资策略，控制个债持有比例。同时，紧密跟踪研究发债企业的基本面情况变化，并据此调整投资组合，控制投资风险。

5. 现金管理策略

本基金主要通过投资于协议存款、剩余期限一年以内的债券（含公司债、企业债等信用债）、货币市场工具及债券回购等方式等进行现金管理，争取在保持流动性的前提下提高收益。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与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。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2019 年 10 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	99,971,684.38	92.10
	其中：股票	99,971,684.38	92.10

2	固定收益投资	25,500.00	0.02
	其中：债券	25,500.00	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,308,488.68	7.65
7	其他资产	239,006.40	0.22
8	合计	108,544,679.46	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	2,431,126.00	2.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	65,886,001.34	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,069,500.00	1.00
F	批发和零售业	4,132,223.00	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	856,747.00	0.80
H	住宿和餐饮业	1,263,501.00	1.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,211,691.40	6.74
J	金融业	9,821,515.60	9.18
K	房地产业	1,658,819.00	1.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,344,952.00	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	685,271.04	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	3,529,514.00	3.30
R	文化、体育和娱乐业	80,823.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	99,971,684.38	93.42

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	600276	恒瑞医药	49,360	4,319,987.20	4.04
2	601012	隆基股份	120,184	2,984,168.72	2.79
3	600030	中信证券	116,200	2,939,860.00	2.75
4	600519	贵州茅台	2,400	2,839,200.00	2.65
5	600036	招商银行	70,000	2,630,600.00	2.46
6	603986	兆易创新	12,300	2,520,147.00	2.35
7	300015	爱尔眼科	58,900	2,330,084.00	2.18
8	002475	立讯精密	57,300	2,091,450.00	1.95
9	300059	东方财富	131,600	2,075,332.00	1.94
10	600713	南京医药	381,300	1,784,484.00	1.67

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	25,500.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,500.00	0.02

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

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	128088	深南转债	255	25,500.00	0.02

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

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

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序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

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心2016年9月至2018年6月在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度的违法违规事实，责令改正，并处罚款20万元。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,257.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,917.12
5	应收申购款	212,831.36

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,006.40

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

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

本基金合同生效日为 2017 年 12 月 19 日，基金合同生效以来（截至 2019 年 12 月 31 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、易方达量化策略精选混合 A 类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)
自基金合同生效 日至 2017 年 12 月 31 日	0.10%	0.03%	0.66%	0.47%	-0.56%	-0.44%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-30.47%	1.30%	-13.74%	0.80%	-16.73%	0.50%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	53.45%	1.21%	22.93%	0.75%	30.52%	0.46%
自基金合同生效 日至 2019 年 12 月 31 日	6.80%	1.25%	6.73%	0.77%	0.07%	0.48%

2、易方达量化策略精选混合 C 类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)
自基金合同生效 日至 2017 年 12 月 31 日	0.10%	0.03%	0.66%	0.47%	-0.56%	-0.44%
2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	-30.87%	1.29%	-13.74%	0.80%	-17.13%	0.49%
2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日	52.75%	1.21%	22.93%	0.75%	29.82%	0.46%
自基金合同生效 日至 2019 年 12 月 31 日	5.70%	1.25%	6.73%	0.77%	-1.03%	0.48%

十三、费用概览

(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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、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。

(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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付。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。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）申购费率

对于 A 类基金份额，本基金对通过直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

特定投资群体可通过本公司直销中心申购本基金 A 类基金份额。基金管理人可根据情况变更或增减特定投资群体申购本基金 A 类基金份额的销售机构，并在基金管理人网站公示。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的特定投资群体申购费率见下表：

申购金额 M（元）（含申购费）	A 类基金份额申购费率
M<100 万	0.15%
100 万≤M<200 万	0.12%
200 万≤M<500 万	0.03%
M≥500 万	1,000 元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率见下表：

申购金额 M（元）（含申购费）	A 类基金份额申购费率
M<100 万	1.5%

100 万 $\leq$ M<200 万	1.2%
200 万 $\leq$ M<500 万	0.3%
M $\geq$ 500 万	1,000 元/笔

本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

（2）申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（3）申购份额的计算方式

1) 若投资人选择 A 类基金份额，则申购份额的计算公式如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

（注：对于 500 万（含）以上适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

2) 若投资人选择 C 类基金份额，则申购份额的计算公式如下：

申购份额=申购金额/T 日 C 类基金份额净值

申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

2、赎回费

（1）赎回费率

1) 本基金 A 类基金份额赎回费率见下表：

持有时间（天）	A 类基金份额赎回费率
0-6	1.5%
7-29	0.75%
30-364	0.5%
365-729	0.25%
730 及以上	0%

(2) 本基金 C 类基金份额赎回费率见下表:

持有时间(天)	C 类基金份额赎回费率
0-6	1.5%
7-29	0.5%
30 及以上	0%

(2) 赎回费的收取和用途

投资者可将其持有的全部或部分 A 类基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于 30 天(不含)的 A 类基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产;对持有期在 30 天以上(含)且少于 90 天(不含)的 A 类基金份额持有人所收取赎回费用总额的 75%计入基金财产;对持有期在 90 天以上(含)且少于 180 天(不含)的 A 类基金份额持有人所收取赎回费用总额的 50%计入基金财产;对持续持有期 180 天以上(含)的 A 类基金份额持有人所收取赎回费用总额的 25%计入基金财产;其余用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

投资者可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于 30 天(不含)的 C 类基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产。

(3) 基金赎回金额的计算方式

赎回金额的计算方法如下:

赎回费用=赎回份额×T 日该类基金份额净值×该类份额赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值-赎回费用

赎回费用、赎回金额的单位为人民币元,计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

3、基金转换费用

基金转换费由基金份额持有人承担,由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成,其中赎回费用按照各基金的基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费,具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位。

4、投资者通过本公司网上交易系统(www.efunds.com.cn)进行申购、赎回和转换的交易费率,请具体参照我公司网站上的相关说明。

5、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率或变更收费方式，调整后的费率或变更的收费方式在更新的《招募说明书》中列示。上述费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定针对全部或部分份额类别调整基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率等相关费率。

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信息披露管理办法》等有关法律法规，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2020 年 3 月 14 日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“三、基金管理人”部分，更新了部分内容。
2. 在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构信息。
3. 在“九、基金转换和定期定额投资计划”部分，更新了部分内容。
4. 在“十一、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告的内容。
5. 在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金的投资业绩数据。
6. 在“二十四、其他应披露事项”部分，更新了部分内容。

易方达基金管理有限公司

2020 年 3 月 28 日