



# 嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF)

## 更新招募说明书

(2011年第1号)

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

### 重要提示

(一) 嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 根据2009年12月3日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2009]1294号)和2009年12月4日《关于嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)募集时间安排的确认函》(基金部函[2009]743号)的核准公开发售, 本基金基金合同于2009年12月30日正式生效, 自该日起本基金管理人开始管理本基金。

(二) 本招募说明书是对原《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的定期更新, 原招募说明书与本招募说明书不一致的, 以本招募说明书为准。基金管理人保证本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。

(三) 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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、流动性风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、本基金指数投资有关风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险等等。嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)为股票型证券投资基金, 预期风险与收益水平高于混合基金、债



券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

投资有风险，投资者在投资本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(五) 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

(六) 本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2011年6月30日(特别事项注明除外)，有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日(未经审计)。



## 目 录

一、绪言	3
二、释义	3
三、基金管理人	8
四、基金托管人	17
五、相关服务机构	21
六、基金的募集安排	37
七、基金合同的生效	40
八、基金份额的上市交易	40
九、基金份额的申购、赎回	41
十、基金的基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记	54
十一、基金的非交易过户、冻结与解冻	55
十二、基金的投资	55
十三、基金的业绩	63
十四、基金的融资融券	65
十五、基金的财产	65
十六、基金资产估值	66
十七、基金收益与分配	70
十八、基金的费用与税收	72
十九、基金的会计与审计	75
二十、基金的信息披露	75
二十一、风险揭示	80
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	83
二十三、基金合同内容摘要	85
二十四、基金托管协议的内容摘要	100
二十五、对基金份额持有人的服务	113
二十六、其他应披露事项	115
二十七、招募说明书存放及查阅方式	116
二十八、备查文件	116



## 一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。基金投资者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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

## 二、释义

本《招募说明书》中,除非文义另有所指,下列词语具有以下含义:

本合同或《基金合同》	《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》



元	人民币元
基金或本基金	嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF)
招募说明书	《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》，即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额发售公告》
《业务规则》	《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回及转托管等其他基金业务的代理机构
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
销售场所	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内。
场外	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所。



场内	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所。
会员单位	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。
注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务, 具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统。
证券登记结算系统	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统。
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束, 根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件, 基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续, 获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日



T 日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为, 包括场内认购与场外认购。
发售	在本基金募集期内, 销售机构向投资者销售本基金份额的行为, 包括场内与场外。
场外认购	指基金募集期内投资者通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为。
场内认购	指基金募集期内投资者通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为。
申购	基金投资者根据基金销售网点规定的手续, 向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
赎回	基金投资者根据基金销售网点规定的手续, 向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日, 本基金的基金净赎回申请 (赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购份额申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过上一开放日本基金总份额的 10% 时的情形
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
上市交易	指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为。
转托管	投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一销售机构交易账户转入另一销售机构交易账户的业务; 本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转登记。
系统内转托管	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构 (网点) 之间或证券登记结算系统内不同会员单位 (席位) 之间进行转托管的行为。
跨系统转登记	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为。



开放式基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统
证券账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在基金注册登记机构的证券登记结算系统。
标的指数	中证锐联基本面 50 指数及其未来可能发生的变更。
指数使用许可协议	《中证锐联基本面 50 指数使用许可协议》及其未来可能发生的变更。
定期定额投资计划	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金利润	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。
期末可供分配利润	指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数
基金收益分配基准日	即可供分配利润计算截至日；以该日日终的会计核算结果为基准计算基金的可供分配利润，评估收益分配条件；
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额价格	基金场内基金份额交易价格按照交易所交易系统集中竞价产生；基金份额申购赎回价格按照基金份额净值加减一定的手续费产生
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站





不可抗力	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。
------	----------------------------

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人基本情况

##### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
法定代表人	王忠民
总经理	赵学军
成立日期	1999 年 3 月 25 日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司 40%，立信投资有限责任公司 30%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、福州、南京、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

##### 2.部门设置情况

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

公司目前下设股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部、机构投资部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务团队、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、信息技术部、基金运营部、登记结算部、财务部、人力资源部、战略发展部等部门。



股票投资部、定量投资部、固定收益部、结构产品投资部和机构投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程、绩效考核。监察稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。机构业务团队主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护,渠道发展部、营销策划部、电子商务部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。信息技术部、基金运营部、登记结算部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务管理工作。人力资源部负责公司企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等事务等综合事务管理。战略发展部负责公司经营战略规划、新业务发展等。

### 3. 管理基金情况

截止 2011 年 6 月 30 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、23 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

## (二) 主要人员情况

### 1. 董事、监事及高级管理人员

安奎先生,董事长,大学本科,中共党员,曾任吉林农业机械研究所主任;吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理;吉林省证券公司总经理;东北证券有限责任公司监事长;吉林天信投资公司总经理;中诚信托有限责任公司副总经理。2011 年 8 月 5 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生,董事、总经理,经济学博士,中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视



设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司总经理。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年至今，担任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，担任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今，担任立信投资有限责任公司董事长。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996 年 9 月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Wolfgang Matis 先生，董事，德国籍，法兰克福商学校经济专业 (Frankfurt Business School of Economics)。曾任德意志银行全球固定收益负责人、全球市场负责人，董事总经理 (MD)。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员、CEO 兼发言人。

Mark Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。1998年9月至2000年6月在北京大学法学学科从事博士后研究工作，2000年7月至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学法学院副教授。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997 年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007 年 10 月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部



总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信投资有限公司财务总监。

王利刚先生，监事，经济学学士。2001 年 2 月至今，就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部，历任人力资源部副总监、总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981 年 6 月至 1996 年 10 月任职于中办警卫局。1996 年 11 月至 1998 年 7 月于中国银行海外行管理部任副处长。1998 年 7 月至 1999 年 3 月任博时基金管理公司总经理助理。1999 年 3 月至今任职于嘉实基金管理公司，历任督察员和公司副总经理。

李道滨先生，副总经理，中共党员，法学博士，经济师。1988 年 7 月至 1990 年 9 月任职于厦门华侨博物馆。1993 年 7 月至 1998 年 9 月任职于中国厦门国际经济技术合作公司。2000 年 10 月至今任职于嘉实基金管理公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员、硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学 MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004 年 3 月加盟嘉实基金管理有限公司任总经理助理，2008 年 7 月起任公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

杨阳先生，中国科学技术大学学士，宾夕法尼亚州立大学硕士，11 年证券从业经验，具有基金从业资格。2000 年至 2003 年任贝尔斯登高级工程师，2003 至 2005 年任 HBK 投资公司高级工程师/交易操盘手，2005 至 2006 年任 Citadel 投资集团高级数量分析师，2006 年至 2008 年任高盛集团高级数量分析师，2008 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司担任高级数量分析

师。2009年12月30日至今任本基金基金经理。

(2) 历任基金经理

本基金无历任基金经理

3、投资决策委员会

投资决策委员会的成员包括：公司总经理赵学军先生、副总经理戴京焦女士、总经理助理邵健先生、总经理助理詹凌蔚先生、总经理助理陶荣辉先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(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、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、编制半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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、报表和其他相关资料；

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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(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牟取利益;
- (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规定禁止的其他行为。

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, 不得将基金财产用于以下投资或活动:

- (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, 但是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其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (6) 买卖与其基金管理人、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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### 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) 基金管理人内部控制制度

#### 1. 内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

## 2. 内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(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：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：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。

## 3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、总经理助理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflow、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权



标准和程序, 确保授权制度的贯彻执行;

- ②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责;
- ③重大业务授权采取书面形式, 授权书应当明确授权内容和时效。
- ④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制, 对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度, 基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作, 分别核算, 及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度, 明确划分各岗位职责, 投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统, 严格信息管理, 保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通, 建立清晰的报告系统, 各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准, 加强基金销售管理, 规范基金宣传推介, 不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施, 建立危机处理机制和程序, 对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件, 按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度, 督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督, 保证内部控制制度落实; 定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细, 按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查, 确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点, 界定风险责任人, 设计内部风险点自我评估表, 对风险点进行评估和分析, 并由监察稽核部监督风险控制措施的执行, 及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为, 在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时, 向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

## 5、基金管理人关于内部控制的声明



- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、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：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：(010) 66105799

联系人：赵会军

### (二) 主要人员情况

截至 2011 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 145 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### (三) 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持

续认可和广泛好评。

#### (四) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2010年,中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证SAS70(审计标准第70号)。通过SAS70国际专项认证,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,已经实施SAS70审计年度化、常规化的项目。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督

制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理, 定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控, 指导业务部门进行风险识别、评估, 制定并实施风险控制措施, 排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案, 并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外, 资产托管部还建立了操作端的异地备份中心, 能够确保交易的及时清算和交割, 保证业务不中断。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门, 配备专职稽核监察人员, 在总经理的直接领导下, 依照有关法律规章, 全面贯彻落实全程监控思想, 确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构, 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与, 只有这样, 风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理, 将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位, 每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责, 通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构, 形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设, 一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力, 资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度, 包括: 岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等, 覆盖所有部门和岗位, 渗透各项业务过程, 形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一, 保持与业务发展同等地位。

资产托管业务是商业银行新兴的中间业务, 资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作, 一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展, 新问题、新情况不断出现, 资产托管部始终将风



险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方案和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资是否符合有关法律法规的规定及基金合同的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

## 五、相关服务机构

### （一）柜台（场外）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵虹		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	吴冬梅		

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段 86 号城市之心 30H 嘉实基金		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	胡清泉		

##### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦附楼二楼		
------	--------------------------	--	--



电话	(07 55) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	周炜		

## (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(05 32) 66777766	传真	(0532) 6 6777676
联系人	曹涌		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 31 3 室		
电话	(05 71) 87759328	传真	(0571) 8 7759331
联系人	徐莉莉		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(05 91) 88013673	传真	(0591) 8 8013670
联系人	吴冬梅		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(02 5) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	施镜葵		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120
联系人	陈涤		

## 2、代销机构

## (1) 中国工商银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街 55 号		
法定代表人	姜建清	联系人	刘业伟
电话	95588	传真	(010) 66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

## (2) 中国银行

住所	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 号中国银行总行办公大楼		
法定代表人	肖钢		
电话	(010) 66596688	传真	(010) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

## (3) 中国农业银行

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 69 号		
法定代表人	项俊波	联系人	滕涛



电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

**(4) 招商银行**

住所、办公地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦		
法定代表人	傅育宁	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

**(5) 中国邮政储蓄银行**

办公地址	北京市西城区金融大街 3 号		
注册地址	北京市西城区宣武门西大街 131 号		
法定代表人	刘安东	联系人	陈春林
传真	010-68858117	网址	www.psbc.com
客服电话	95580		

**(6) 交通银行**

住所、办公地址	上海市银城中路 188 号		
法定代表人	胡怀邦	联系人	曹榕
电话	(021) 58781234	传真	(021) 58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

**(7) 中国民生银行**

住所、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
电话	(010) 57092615	传真	(010) 57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

**(8) 中国光大银行**

住所、办公地址	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦		
法定代表人	唐双宁	联系人	朱红
电话	(010) 63636153	传真	(010) 63636157
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595

**(9) 中信银行**

住所、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	孔丹	联系人	丰靖
电话	(010) 65550827	传真	(010) 65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

**(10) 深圳发展银行**

住所、办公地址	深圳深南东路 5047 号深圳发展银行大厦		
---------	-----------------------	--	--





法定代表人	肖遂宁		
联系人	张青		
电话	(0755) 82088888	传真	(0755) 82080406
网址	www.sdb.com.cn	客服电话	95501

**(11) 上海浦东发展银行**

住所	上海市浦东新区浦东南路 500 号		
办公地址	上海市北京东路 689 号东银大厦 17F (200001)		
法定代表人	吉晓辉	联系人	虞谷云
电话	(021) 61616206	传真	(021) 63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

**(12) 北京银行**

住所	北京市西城区金融大街甲 17 号首层		
办公地址	北京市西城区金融大街丙 17 号		
法定代表人	闫冰竹	联系人	王曦
电话	(010) 66223584	传真	(010) 66226045
网址	www.bankofbeijing.com.cn	客服电话	95526

**(13) 平安银行**

住所、办公地址	深圳市深南中路1099		
法定代表人	孙建一	联系人	蔡宇洲
电话	(0755) 22197874	传真	(0755) 25879453
网址	http://bank.pingan.com	客服电话	4006699999

**(14) 宁波银行**

住所	宁波市江东区中山东路 294 号		
办公地址	宁波市鄞州区宁南南路 700 号		
法定代表人	陆华裕	联系人	胡技勋
电话	0574-89068340	传真	(0574) 87050024
网址	www.nbcb.com.cn	客服电话	96528, 962528 上海、北京地区

**(15) 东莞银行**

住所、办公地址	东莞市城区运河东一路 193 号		
法定代表人	廖玉林	联系人	巫渝峰
电话	(0769) 22100193	传真	(0769) 22117730
客服电话	(0769) 96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

**(16) 广东发展银行**

住所、办公地址	广东省广州市农林下路 83 号		
---------	-----------------	--	--



法定代表人	董建岳	联系人	詹全鑫、张扬眉
电话	(020) 38322256	传真	(020) 87310955
客服电话	800-830-8003、400-830-8003		
网址	www.gdb.com.cn		

**(17) 杭州银行**

住所、办公地址	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦		
法定代表人	吴太普	联系人	严峻
电话	(0571) 85108309	传真	(0571) 85108309
客服电话	400-888-8508	网址	www.hzbank.com.cn

**(18) 浙商银行**

住所、办公地址	浙江省杭州市庆春路 288 号		
法定代表人	张达洋	联系人	毛真海
电话	(0571) 87659546	传真	(0571) 87659188
网址	www.czbank.com	客服电话	95527

**(19) 江苏银行**

住所、办公地址	南京市洪武北路 55 号		
法定代表人	黄志伟	联系人	田春慧
电话	(025) 58587018	传真	(025) 58587038
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025) 96098、4008696098

**(20) 乌鲁木齐市商业银行**

住所	乌鲁木齐市新华北路 8 号		
办公地址	乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦		
法定代表人	农惠臣	联系人	何佳
电话	(0991) 8824667	传真	(0991) 8824667
网址	www.uccb.com.cn	客服电话	(0991) 96518

**(21) 中信证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010) 60833722	传真	(010) 60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

**(22) 广发证券股份有限公司**

住所	广州天河区天河北路 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 18、19、36、38、41 和 42 楼		
法定代表人	林治海	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305



网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点
----	---------------	------	-----------------

**(23) 中信建投证券有限责任公司**

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	张佑君	联系人	权唐
清算传真	(010) 65183880	业务传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

**(24) 海通证券股份有限公司**

住所	上海淮海中路 98 号		
办公地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点 咨询电话

**(25) 申银万国证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市常熟路 171 号		
法定代表人	丁国荣	联系人	李清怡
电话	(021) 54033888	传真	(021) 54030294
网址	www.sw2000.com.cn	客服电话	(021) 962505

**(26) 国泰君安证券股份有限公司**

住所	上海市浦东新区商城路 618 号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼		
法定代表人	万建华	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

**(27) 中国银河证券股份有限公司**

住所、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	顾伟国	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	(010) 66568536
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-888-8888

**(28) 兴业证券股份有限公司**

住所	福州市湖东路 268 号		
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层		
法定代表人	兰荣	联系人	谢高得
电话	(021) 38565785	传真	(021) 38565955
网址	www.xyzq.com.cn	客服电话	4008888123

**(29) 招商证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

**(30) 华泰证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦		
法定代表人	吴万善	联系人	程高峰
电话	(025)84457777	传真	(025)84579763
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

**(31) 华泰联合证券有限责任公司**

住所	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A		
办公地址	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层		
法定代表人	马昭明	联系人	盛宗凌、庞晓芸
电话	(0755) 82492000	传真	(0755) 82492962
网址	www.lhzq.com	客服电话	95513

**(32) 长城证券有限责任公司**

住所、办公地址	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	匡婷
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755)33680000

**(33) 国都证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

**(34) 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
电话	(0591) 87383623	传真	(0591) 87383610
客服电话	(0591) 96326	网址	www.hfzq.com.cn

**(35) 光大证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
---------	------------------	--	--



法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788, 10108998

**(36) 渤海证券股份有限公司**

住所	天津市南开区滨水西道 8 号		
办公地址	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

**(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	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	(0755)82130833	传真	(0755)82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

**(38) 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 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凤凰大厦 1 栋 9 层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558305
网址	www.essences.com.cn	客服电话	4008001001

**(39) 东北证券股份有限公司**

住所、办公地址	长春市自由大路 1138 号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
电话	(0431) 85096709	传真	(0431) 85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431)85096733

**(40) 平安证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	4008866338	传真	(0755) 82400862
网址	www.PINGAN.com	客服电话	4008816168

**(41) 国元证券股份有限公司**

住所、办公地址	安徽省合肥市寿春路 179 号		
法定代表人	凤良志	联系人	陈玲玲
电话	(0551) 2246273	传真	(0551) 2272100



网址	www.gyzq.com.cn
客服电话	95578

**(42) 中国建银投资证券有限责任公司**

住所办公地址	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 层至 21 层		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层		
法定代表人	杨明辉	联系人	刘毅
电话	(0755) 82023442	传真	(0755) 82026539
网址	www.cjis.cn	客服电话	400-600-8008

**(43) 湘财证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼		
法定代表人	林俊波	联系人	钟康莺
电话	(021) 68634518	传真	(021) 68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

**(44) 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	联系人	张静
传真	(021) 50372474	客服电话	4006208888
网址	www.bocichina.com.cn		

**(45) 德邦证券有限责任公司**

住所	上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼		
法定代表人	姚文平	联系人	罗芳
电话	(021) 68761616	传真	(021) 68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

**(46) 财富证券有限责任公司**

住所、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 楼		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731) 84403319	传真	(0731) 84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731) 84403360

**(47) 中信万通证券有限责任公司**

住所	青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)		
办公地址	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层		
法定代表人	张智河	联系人	吴忠超



电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	www.zxwt.com.cn	客服电话	(0532) 96577

**(48) 中航证券有限公司**

住所、办公地址	江西省南昌市抚河北路 291 号		
法定代表人	杜航	联系人	余雅娜
电话	(0791) 6768763	传真	(0791) 6789414
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

**(49) 中信金通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层		
法定代表人	刘军	联系人	王焄艺
电话	(0571) 85783750	传真	(0571) 85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571) 96598

**(50) 长江证券股份有限公司**

住所、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	胡运钊	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
客服电话	95579 或 4008-888-999		
网址	www.95579.com		

**(51) 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	联系人	马贤清
电话	(0755) 83025022	传真	(0755) 83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

**(52) 国盛证券有限责任公司**

住所	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼		
法定代表人	裘强	联系人	徐美云
电话	(0791) 6273972	传真	(0791) 6288690
网址	www.gsstock.com	客服电话	(0791) 6285337、6283827

**(53) 山西证券股份有限公司**

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

**(54) 西部证券股份有限公司**

住所、办公地址	陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼		
法定代表人	刘建武	联系人	冯萍
电话	(029) 87406488	传真	(029) 87406387
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

**(55) 广州证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼		
法定代表人	吴志明	联系人	林洁茹
电话	(020) 87322668	传真	(020) 87325036
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

**(56) 国联证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省无锡市县前东街 168 号		
法定代表人	雷建辉	联系人	徐欣
电话	(0510) 82831662	传真	(0510) 82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	4008885288

**(57) 东吴证券股份有限公司**

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512) 65581136	传真	(0512) 65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	(0512) 33396288

**(58) 南京证券有限责任公司**

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭 8 号		
法定代表人	张华东	联系人	水晨
电话	(025) 83367888	传真	(025) 83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

**(59) 浙商证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼		
法定代表人	吴承根	联系人	谢项辉
电话	(0571) 87901053	传真	(0571) 87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	(0571) 967777

**(60) 恒泰证券股份有限公司**

住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号		
法定代表人	鞠瑾	联系人	常向东
电话	(0471) 4913998	传真	(0471) 4930707
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471) 4961259



**(61) 第一创业证券有限责任公司**

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

**(62) 民生证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层		
法定代表人	岳献春	联系人	赵明
电话	(010) 85127622	传真	(010) 85127917
网址	www.msza.com	客服电话	400-619-8888

**(63) 新时代证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层		
法定代表人	马金声	联系人	孙恺
电话	(010) 83561146	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

**(64) 上海证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市西藏中路 336 号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张瑾
电话	(021) 53519888	传真	(021) 53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518、 4008918918

**(65) 世纪证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层		
法定代表人	卢长才	联系人	王佳佳
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
网址	www.csc.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

**(66) 中原证券股份有限公司**

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
法定代表人	石保上	联系人	程月艳 耿铭
电话	(0371) 65585670	传真	(0371) 65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	967218、4008139666

**(67) 东莞证券有限责任公司**

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼		
法定代表人	张运勇	联系人	罗绍辉



电话	(0769) 22119351	传真	(0769) 22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769) 961130

**(68) 华龙证券有限责任公司**

住所、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	李昕田
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
客服电话	(0931) 4890208、 (0931) 4890619	网址	www.hlzqgs.com

**(69) 万联证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020) 37865070	传真	(020) 22373718-1013
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

**(70) 国金证券股份有限公司**

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028) 86690126	传真	(028) 86690126
网址	www.gjq.com.cn	客服电话	4006600109

**(71) 财通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江杭州市解放路 111 号金钱大厦		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571) 87925129	传真	(0571) 87828042
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571) 96336、962336 (上海地区)

**(72) 齐鲁证券有限公司**

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

**(73) 大同证券经纪有限责任公司**

住所	山西省大同市大北街 13 号		
办公地址	山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 4192803
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

**(74) 瑞银证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
法定代表人	刘弘	联系人	邱培玲
电话	010-5832 8366	传真	010-5922 8748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

**(75) 华鑫证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元		
法定代表人	王文学	联系人	杨小江
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
客服电话	(021) 32109999, (029) 68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

**(76) 中山证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	(0755) 82570586	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com.cn	客服电话	4001022011

**(77) 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	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层		
法定代表人	林义相	联系人	林爽
电话	(010) 66045608	传真	(010) 66045500
客服电话	(010) 66045678		
网址	http://www.txsec.com		

**(78) 江海证券有限公司**

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	张宇宏
电话	(0451) 82336863	传真	(0451) 82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

**(79) 中国民族证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	(010) 59355941	传真	(010) 66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

**(80) 厦门证券有限公司**

住所、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	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	(0592) 5161642	传真	(0592) 5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592) 5163588

**(81) 爱建证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市南京西路 758 号博爱大厦 20-25 楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888-3121	传真	(021) 62878783
客服电话	(021) 63340678	网址	www.ajzq.com

**(82) 华宝证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层		
法定代表人	陈林	联系人	陈康菲
电话	(021) 50122222	传真	(021) 50122200
客服电话	4008209898	网址	<a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>

**(83) 方正证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	雷杰	联系人	彭博
电话	(0731) 85832343	传真	(0731) 85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

**(84) 英大证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	赵文安	联系人	王睿
电话	(0755) 83007069	传真	(0755) 83007167
客服电话	4008-698-698	网址	www.ydsc.com.cn

**(85) 日信证券有限责任公司**

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	陈韦杉
电话	(010)88086830-730	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	(010) 88086830		

**(86) 信达证券股份有限公司**

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

**(87) 东兴证券股份有限公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层		
---------	--------------------------------	--	--



法定代表人	徐勇力	联系人	汤漫川
电话	(010) 66555316	传真	(010) 66555246
客服电话	400-8888-993	网址	www.dxzq.net.cn

**(88) 华融证券股份有限公司**

住所	北京市西城区月坛北街 26 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座 3 层		
法定代表人	丁之锁	联系人	梁宇
电话	(010) 58568007	传真	(010) 58568062
客服电话	(010) 58568118	网址	www.hrsec.com.cn

**(89) 国海证券有限责任公司**

住所、办公地址	广西南宁市滨湖路 46 号		
法定代表人	张雅锋	联系人	覃清芳
电话	(0771) 5539262	传真	(0771) 5539033
客服电话	4008888100 (全国)、 96100 (广西)	网址	www.ghzq.com.cn

**(二) 场内基金份额发售机构**

场内基金份额发售机构为深圳证券交易所会员单位，即具有基金代销业务资格的证券公司：包括国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国证券、中信万通证券、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、华泰联合证券、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、远东证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券等（排名不分先后）。

**(二) 基金注册登记机构**

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号		
法定代表人	金颖	联系人	程爽
电话	(010) 59378982	传真	(010) 58598907

### (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、办公地址	北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层		
负责人	王玲	联系人	彭晋
电话	(010) 5878 5588	传真	(010) 58785566
经办律师	彭晋、唐丽子		

### (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有限公司		
住所	上海市浦东新区东昌路568号		
办公地址	上海卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	陈宇
电话	(021) 61238888	传真	(021) 61238800
经办注册会计师	汪棣、陈宇		

## 六、基金的募集安排

### (一) 基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会2009年12月3日《关于核准嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2009]1294号)核准募集。

(二) **基金运作方式和类型:** 上市契约型开放式、股票型证券投资基金。

(三) **基金存续期:** 不定期。

### (四) 基金份额的募集方式

投资者可通过场外认购和场内认购两种方式认购本基金。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下;通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回;登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回。投资者也可通过办理跨系统转登记业务实现基金份额在两个登记系统之间的转登记。

(五) **基金份额的募集期限:** 2009年12月10日至2009年12月24日。

(六) **募集对象:** 符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者, 以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(七) **募集目标:** 本基金不设定发售规模上限。

#### (八) 基金份额的场外认购

1、募集场所: 本基金的场外认购场所为基金管理人的直销中心、基金管理人网上直销以及基金代销机构。

2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 基金份额面值: 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。

(2) 认购费率

本基金场外认购费率如下表:

认购金额 (含认购费)	认购费率
M < 100万元	1.0%
100万元 ≤ M < 200万元	0.6%
200万元 ≤ M < 500万元	0.3%
M ≥ 500万元	按笔收取, 1000元/笔

本基金的认购费用由投资者承担, 不列入基金资产, 认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(3) 场外认购份额的计算

基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为:

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率);

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额;

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值。

场外认购份额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。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额, 归基金份额持有人所有, 其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位, 小数点后两位以后部分截去, 由此产生的误差计入基金财产。

## (九) 基金份额的场内认购

### 1、募集场所

本基金的场内认购场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

### 2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 本基金份额初始面值为人民币1.00元,挂牌价格为初始面值。

(2) 本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取。基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(3) 场内会员单位应按照场外认购费率设定投资者场内认购的认购费用。

(4) 场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为:

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=利息/挂牌价格

场内认购金额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。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位(最小单位为1份),余额计入基金财产。

### 3、投资人对基金份额的场内认购

(1) 认购时间安排:2009年12月10日至2009年12月24日。

(2) 认购的限额

场内认购单笔最低认购份额为1000份,超过1000份的须为1000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

## (十) 募集资金的存放





《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不得动用。

## 七、基金合同的生效

### (一) 基金合同生效

本基金基金合同自 2009 年 12 月 30 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### (二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

## 八、基金份额的上市交易

(一) 上市交易的地点：深圳证券交易所

(二) 上市交易的时间：2010 年 2 月 10 日

(三) 上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

(四) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

(五) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

## （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

发生下列情形之一时, 本基金应暂停上市:

- (1) 基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人;
- (2) 基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份;
- (3) 违反国家法律、行政法规, 中国证监会决定暂停本基金上市;
- (4) 深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时, 基金管理人在接到深圳证券交易所通知后, 应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

暂停上市情形消除后, 基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请; 经深圳证券交易所核准后, 可恢复本基金上市。

## （七）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时, 本基金应终止上市交易:

- (1) 自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;
- (2) 基金合同终止;
- (3) 基金份额持有人大会决定终止上市;
- (4) 深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时, 由证券交易所终止其上市交易, 基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市, 并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

## 九、基金份额的申购、赎回

本基金份额的申购与赎回包括场内申购赎回、场外申购赎回两种方式。

### （一）申购、赎回的场所

#### 1. 基金份额的场外申购与赎回场所

- (1) 本基金管理人的直销中心柜台;
- (2) 中国工商银行的指定网点以及基金管理人指定的其他代销机构营业网点;
- (3) 本基金管理人的基金网上交易系统。

基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告。

## 2. 基金份额的场内申购与赎回场所

深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。

## (二) 申购、赎回的开放日及时间

本基金自 2010 年 2 月 10 日起办理申购与赎回业务。

申购和赎回的开放日为本基金公告开始办理申购、赎回业务后，上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日 2 日前在指定媒体公告。

## (三) 申购与赎回的帐户

### 1. 场外申购与赎回的帐户

投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳开放式基金账户。

### 2. 场内申购与赎回的帐户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

## (四) 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。同时，场内申购和赎回申报单位还应以深圳证券交易所的规定为准；

3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4. 当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；当日的场内申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## (五) 申购与赎回的程序

### 1. 场外申购与赎回的程序

#### (1) 场外申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序,在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### (2) 场外申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请,正常情况下,基金管理人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在 T+2 日后(包括该日)投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

#### (3) 场外申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功,若申购不成功或无效,申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

### 2. 场内申购与赎回的程序

办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行。

#### (1) 场内申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时,其账户内必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

## (2) 场内申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请, 正常情况下, 基金管理人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认, 在 T+2 日后 (包括该日) 投资者应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况, 否则, 由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

业务办理单位对申购申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表业务办理单位确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## (3) 场内申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式, 若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功, 若申购不成功或无效, 申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后, 基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日 (包括该日) 内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时, 款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

## (六) 申购与赎回的数额限制

### 1. 申请申购基金的金额限制

投资者通过代销机构、嘉实基金管理有限公司网上直销或场内业务办理单位首次申购单笔最低限额为人民币 5,000 元; 投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币 20,000 元; 但已认购本基金的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币 1,000 元, 追加申购单笔最低限额为人民币 1,000 元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时, 不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购, 对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

### 2. 申请赎回基金的份额限制

单笔赎回不得少于 1,000 份, 如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 1000 份, 则必须一次性赎回基金全部份额; 若某笔赎回或转换转出业务导致投资者在销售机构托管的基金余额不足 1000 份时, 该笔赎回或转换转出业务应包括账户内全部基金份额, 否则基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制, 基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至

少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### (七) 申购费用和赎回费用

#### 1. 申购费用

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

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%,具体如下:

申购金额 (含申购费)	申购费率
$M < 100$ 万元	1.2%
$100 \text{ 万元} \leq M < 200$ 万元	0.8%
$200 \text{ 万元} \leq M < 500$ 万元	0.4%
$M \geq 500$ 万元	单笔 1000 元

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%,但招商银行借记卡、中国建设银行龙卡、中国工商银行借记卡、中国农业银行金穗卡的持卡人,申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行。优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%执行。

机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%。

基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时,按实际费率收取申购费。

#### 2. 赎回费用

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。

本基金的场外赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。具体如下:

持有期限	赎回费率
$< 365$ 天	0.50%
$365 \text{ 天} \leq M < 730$ 天	0.25%
$\geq 730$ 天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担, 其中25%的部分归入基金财产, 其余部分用于支付市场推广、销售、注册登记费等相关费用。

3. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和降低赎回费率。费率如发生变更, 基金管理人应在调整实施2日前中国证监会指定的媒体上刊登公告。

4. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## (八) 申购份额与赎回金额的计算

### 1. 场外申购份额与赎回金额的计算

(1) 场外基金申购份额的计算:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额, 其中:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例如, 某投资者投资 5,000 元申购本基金, 对应费率为 1.2%, 假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,940.71 = 59.29 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,940.71 / 1.1280 = 4,380.06 \text{ 份}$$

即: 某投资者投资 5,000 元申购本基金, 假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元, 则可得到 4,380.06 份基金份额。

(2) 场外基金赎回金额的计算:

采用“份额赎回”方式, 赎回金额以 T 日的基金份额净值为基准进行计算, 计算公式:

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例如: 假定三笔赎回申请的赎回份额均为 10,000 份, 但持有时间长短不同, 其中基金份额净值为假设数, 那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下:



	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额 (份, A)	10,000	10,000	10,000
基金份额净值 (元, B)	1.1000	1.3000	1.4000
持有时间	100天	366天	731天
适用赎回费率 (C)	0.5%	0.25%	0%
赎回总额 (元, D=A×B)	11,000	13,000	14,000
赎回费 (E=C×D)	55	32.5	0
赎回金额 (F=D-E)	10,945	12,967.5	14,000

(3) 场外申购份额、余额的处理方式:

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,申购份额计算结果保留到小数点后 2 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。

(4) 场外赎回金额的处理方式:

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用来计算,赎回金额计算结果保留到小数点后 2 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. 场内申购份额与赎回金额的计算

(1) 场内基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

申购份额计算结果保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例如:某投资者通过场内投资 10,000 元申购本基金,对应的申购费率为 1.2%,假设申购当日基金份额净值为 1.0250 元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额 =  $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$  元

申购手续费 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  元



申购份额=9,881.42/1.0250=9,640.41 份

因场内申购份额保留至整数份,故投资者申购所得份额为 9,640 份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为:

实际净申购金额=9,640×1.0250=9,881.00 元

退款金额=10,000-9,881.00-118.58=0.42 元

即:投资者投资 10,000 元从场内申购本基金,假设申购当日基金份额净值为 1.0250 元,则其可得到基金份额 9,640 份,退款 0.42 元。

### (2) 场内基金赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式,赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算,计算公式:

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额 - 赎回费用

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 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。

场内赎回适用固定赎回费率,与份额持有期限无关。

例如:某投资者从场内赎回本基金 10,000 份基金份额,赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值为 1.1480 元,则其可得净赎回金额为:

赎回总金额=10,000×1.1480=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即:投资者从深圳证券交易所场内赎回本基金 10,000 份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为 1.1480 元,则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

### 3. 基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数,基金份额净值单位为元,计算结果保留在小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。(参见 2010 年 7 月 23 日本基金管理人发布《关于嘉实基本面 50 指数 (LOF) 基金份额净值计算位数变更的公告》,此变更自 2010 年 7 月 26 日起生效。)

基金管理人每个开放日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

### (九) 申购和赎回的注册登记

#### 1. 场外申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续,投资者自 T+2 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资者的合法权益,并最迟于开始实施前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### 2. 场内申购和赎回的注册登记

本基金场内申购和赎回的注册登记业务,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### (十) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形,基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请:

1. 不可抗力的原因导致基金无法正常工作;
2. 证券交易所在交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算;
3. 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益;
4. 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形;
5. 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的,被拒绝的申购款项将全额退还相应投资者。发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理,并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

### (十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项:

1. 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项;
2. 证券交易场所依法决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
3. 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;
4. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请,基金管理人将足额支付;如暂时不能足额支付的,可延期支付部分赎回款项,按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时,在出现上述第(3)款的情形时,对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项,最长不超过 20 个工作日,并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回,基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理,并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

### (十二) 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1. 巨额赎回的认定

本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 10%时,即认为发生了巨额赎回。

#### 2. 巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

- (1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时,按正常赎回

程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不高于上一日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### **(十三) 重新开放申购或赎回的公告**

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

### **(十四) 基金转换**

自 2010 年 3 月 19 日起，本基金管理人开始办理嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金



(LOF)、嘉实沪深300指数证券投资基金 (LOF) 场外份额之间的日常转换业务。

### 1. 基金简称和代码

基金名称	场外基金简称	基金代码
嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF)	嘉实基本面50指数(LOF)	160716
嘉实沪深300指数证券投资基金 (LOF)	嘉实沪深300指数(LOF)	160706

### 2. 基金转换费用

嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 与嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 场外基金份额之间互相转换时, 基金转换费率采用“赎回费 + 申购费率补差”算法, 计算公式如下:

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

G 为对应的申购补差费率, 当转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率时, 则申购补差费率 G 为零;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费的 25% 归入转出基金资产。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率, 调整后的基金转换费率应及时公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对以特定交易方式 (如网上交易等) 或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

### 3. 基金转换的其他业务规则

#### (1) 基金转换的时间

投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日, 方可办理基金转换业务。

#### (2) 基金转换的原则

① 采用份额转换原则, 即基金转换以份额申请;

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

### (3) 基金转换的程序

#### ①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时，帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### ②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日 (T日)，并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

#### (4) 基金转换的数额限制

基金转换时，最低转出份额为1000份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的程序及有关限制并及时公告。

#### (5) 基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续，一般情况下，投资者自T+2日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

#### (6) 基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例

确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

#### (7) 拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的转入申请：

- 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的转入申请；
- 证券交易所交易时间临时停市；
- 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- 其他可能对基金业绩或流动性产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转入；
- 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的转出申请：

- 因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；
- 证券交易所交易时间临时停市；
- 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- 当基金管理人认为某笔转出会有损于现有基金份额持有人利益；
- 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

③如发生基金合同、《招募说明书》或本公告中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准后在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

## 十、基金的基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转登记。

### (一) 系统内转托管

1. 系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2. 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3. 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

## （二）跨系统转登记

1. 跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2. 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

## 十一、基金的非交易过户、冻结与解冻

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户业务，并收取一定的手续费用。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

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

### （二）标的指数

本基金标的指数为中证锐联基本面 50 指数。

如果中证锐联基本面 50 指数被停止编制及发布，或中证锐联基本面 50 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证锐联基本面 50 指数不宜继



续作为标的指数,或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数和投资对象;并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

### (三) 投资范围

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

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

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在 10 个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

### (四) 投资理念

从长期来看,中国经济将保持持续增长态势,为资本市场的良好发展奠定了坚实的基础。指数化投资可以为投资者提供分享中国经济增长和资本市场发展成果的好工具。

标的指数为基本面加权指数,具备基本面优良、流动性高、大盘蓝筹等特性。本基金通过指数复制法,有效跟踪标的指数,力争为投资者带来较好的长期投资回报。

### (五) 投资策略

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

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不得超过 4%。在跟踪误差允许的情况下,本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的固定收益类证券投资范围包括国债、金融债、

企业 (公司) 债、次级债、可转换债券 (含分离交易可转债)、中央银行票据、短期融资券、回购 (包括正回购和逆回购)、资产支持证券等。

如果未来法律法规或监管机构允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金投资将遵照:

#### 1. 决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定。

#### 2. 投资管理体制

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

#### 3. 投资程序

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

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

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

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

(4) 交易执行: 集中交易室负责具体的交易执行, 同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估: 投资流程与风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估, 并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否, 基金经理可以据此检讨投资策略, 进而调整投资组合。

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

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

#### (六) 股票组合的构建与调整方法

本基金采用完全指数复制法，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在发生以下情况时，基金管理人将对资产组合进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围内：

- 1、因受成份股股票停牌限制、股票流动性等其他市场因素的影响或因受法律法规、基金合同等合规因素限制，使基金管理人无法依据指数购买某成份股；
- 2、预期标的指数的成份股发生新增、剔除或成份股发生配股、增发、分红等行为，或因公司行为导致指数权重发生变化；
- 3、其他可能影响指数复制的因素，如基金分红、大额申购或赎回等。

#### (七) 投资限制

##### 1、禁止行为

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其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

##### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过基金总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(2) 本基金投资权证, 在任何交易日买入的总金额, 不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%, 本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例, 遵从法规或监管部门的相关规定;

(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%; 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%; 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%;

(5) 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%;

(6) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、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) 本基金持有的债券其信用级别不低于 BBB 级;

(8) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

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约定。因证券市场波动、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规定的, 基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

## (八) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

$95\% \times \text{中证锐联基本面 50 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$

中证锐联基本面 50 指数以基本面指标来衡量上市公司的经济规模, 选取其中最大的 50 家 A 股上市公司作为样本, 且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数综合反映了



中国证券市场基本面良好企业的整体状况，适合作为本基金的标的指数。

如果相关法律法规发生变化，或中证锐联基本面 50 指数被停止编制及发布，或中证锐联基本面 50 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证锐联基本面 50 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与托管人协商一致并履行相关程序后，变更本基金的标的指数，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

### （九）风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### （十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2. 有利于基金资产的安全与增值；
3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### （十一）基金投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,422,613,206.58	93.11



	其中：股票	2,422,613,206.58	93.11
2	固定收益投资	49,625,000.00	1.91
	其中：债券	49,625,000.00	1.91
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	123,677,690.57	4.75
6	其他资产	6,022,670.74	0.23
7	合计	2,601,938,567.89	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末指数投资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	采掘业	236,206,744.09	9.18
C	制造业	416,969,782.57	16.21
C0	食品、饮料	19,606,399.67	0.76
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	351,760,913.62	13.67
C7	机械、设备、仪表	36,119,363.56	1.40
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	9,483,105.72	0.37
D	电力、煤气及水的生产和供应业	91,358,411.67	3.55
E	建筑业	198,404,663.52	7.71
F	交通运输、仓储业	103,602,194.28	4.03
G	信息技术业	113,424,575.25	4.41
H	批发和零售贸易	53,088,537.30	2.06
I	金融、保险业	1,127,334,153.30	43.82
J	房地产业	82,224,144.60	3.20
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,422,613,206.58	94.17

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末, 本基金未持有积极投资股票。

## 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

### (1) 报告期末指数投资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	600036	招商银行	10,445,277	135,997,506.54	5.29
2	601328	交通银行	24,052,104	133,248,656.16	5.18
3	600050	中国联通	21,604,681	113,424,575.25	4.41
4	600016	民生银行	19,790,380	113,398,877.40	4.41
5	601288	农业银行	38,628,736	108,160,460.80	4.20
6	600019	宝钢股份	17,490,559	105,468,070.77	4.10
7	601318	中国平安	1,910,925	92,240,349.75	3.59
8	601668	中国建筑	22,839,026	92,041,274.78	3.58
9	600000	浦发银行	8,459,245	83,238,970.80	3.24
10	000002	万科A	9,730,668	82,224,144.60	3.20

注: 本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等, 成份股及备选股投资比例不低于基金资产的 90%。

### (2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末, 本基金未持有积极投资股票。

## 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	49,625,000.00	1.93
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	49,625,000.00	1.93

## 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	1101023	11 央行票据 23	500,000	49,625,000.00	1.93

注: 报告期末, 本基金仅持有上述 1 只债券。

**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**

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

**7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

报告期末，本基金未持有权证。

**8. 投资组合报告附注**

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	131,016.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,580,510.75
4	应收利息	324,274.83
5	应收申购款	986,868.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,022,670.74

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

**②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

**十三、基金的业绩**

基金业绩截止日为2011年6月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证



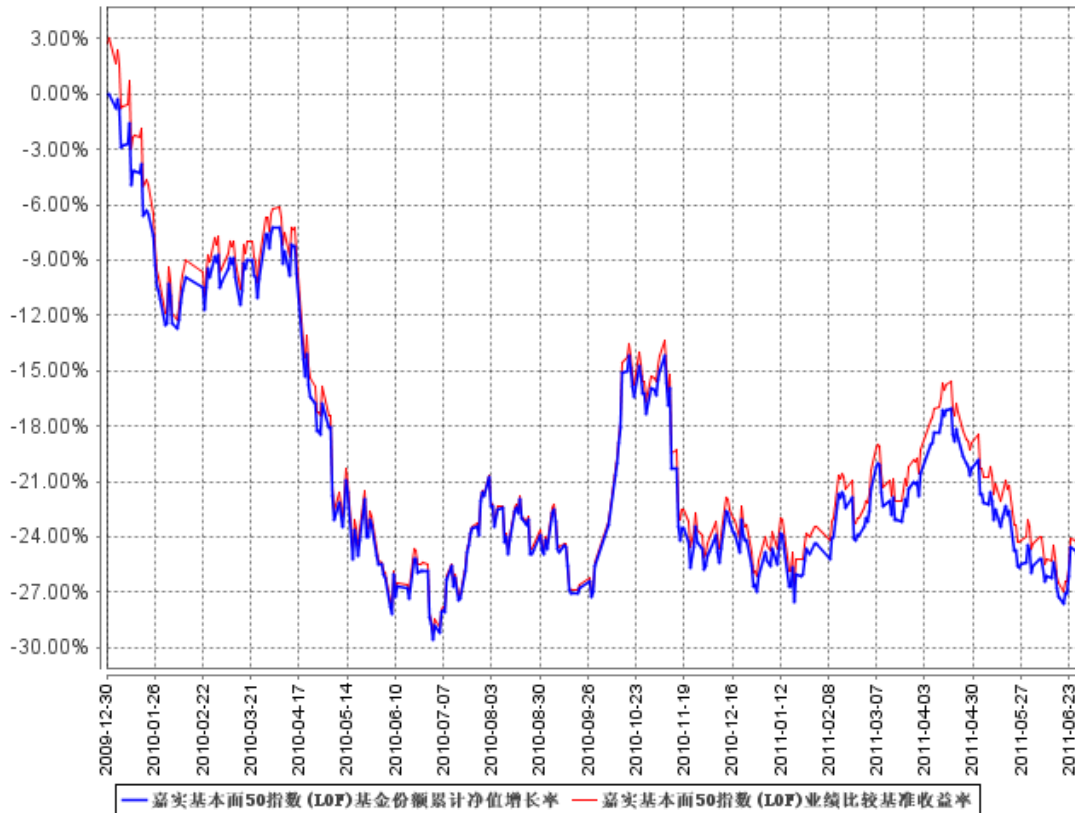
基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效日 (2009年12月30日) -2009年12月31日	0.00%	0.00%	3.04%	1.79%	-3.04%	-1.79%
2010年	-26.11%	1.42%	-27.49%	1.45%	1.38%	-0.03%
2011年上半年	1.56%	1.04%	1.09%	1.06%	0.47%	-0.02%

### 2.自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 嘉实基本面50指数 (LOF) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实基本面50指数 (LOF) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2009年12月30日至2011年6月30日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十一（三）投资范围和（七）2、基金投资组合限制）的有关约定。

## 十四、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## 十五、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

1. 银行存款及其应计利息；
2. 清算备付金及其应计利息；
3. 根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
4. 应收证券交易清算款；
5. 应收申购款；
6. 股票投资及其估值调整；
7. 债券投资及其估值调整和应计利息；
8. 权证投资及其估值调整；
9. 其他投资及其估值调整；
10. 其他资产等。

### (二) 基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机

构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### （四）基金财产的保管及处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

## 十六、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给

基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## （五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

### 3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配

股价, 按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价, 则估值为零。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

根据《基金法》, 基金管理人计算并公告基金资产净值, 基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### (六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入 (参见 2010 年 7 月 23 日本基金管理人发布《关于嘉实基本面 50 指数 (LOF) 基金份额净值计算位数变更的公告》, 此变更自 2010 年 7 月 26 日起生效)。当估值或份额净值计价错误实际发生时, 基金管理人应当立即纠正, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时, 基金管理人应报中国证监会备案; 当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告, 并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的, 应先由基金管理人承担, 基金管理人对其不应由其承担的责任, 有权向过错人追偿。

关于差错处理, 本合同的当事人按照以下约定处理:

##### 1、差错类型

本基金运作过程中, 如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错, 导致其他当事人遭受损失的, 过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人 (“受损方”) 按下述 “差错处理原则” 给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于: 资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等; 对于因技术原因引起的差错, 若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒, 则属不可抗力, 按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错, 因不可抗

力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的由差错责任方承担;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责,如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责

任方;

- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;
- (4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金注册登记机构的交易数据的, 由基金注册登记机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认;
- (5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当报告中国证监会; 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### (七) 暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;
- 3、中国证监会认定的其他情形

### (八) 特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
- 2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 由此造成的基金资产估值错误, 基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金收益与分配

### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额, 基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

## （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。



## (六) 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

## 十八、基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金合同生效后的指数许可使用费;
- (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、律师费和诉讼费;
- (6) 基金份额持有人大会费用;
- (7) 因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
- (8) 基金的银行汇划费用;
- (9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 0.18% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 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。

### (3) 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。其中, 基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用, 不列入基金费用; 基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支, 按前一日基金资产净值及指数许可使用费率每日计提, 逐日累计。计算方法如下:

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

I 为基金管理人与本基金的标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费率。

根据指数使用许可协议, 标的指数许可方收取的指数许可使用费率设定如下:

收费条件	指数许可使用费率
本基金合同生效后的前两个公历年度	0.09%
成立的第三个年度起, 当: 前一季度日均资产净值 $\geq$ 40 亿元	0.09%
成立的第三个年度起, 当: 前一季度日均资产净值 $<$ 40 亿元	0.12%

基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币拾伍万元 (15 万元) 的收取下限, 则该下限超出当季累计指数使用费的部分 (即: 每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费) 由基金管理人自行承担, 不作为基金费用从基金财产中列支。

基金合同生效后的指数许可使用费按季支付,由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述 1、基金费用的种类中第(4) - (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。

### 3、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。

### 4、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### (二) 与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第六部分第(七)、(八)条的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第九部分第(五)条、第(七)条、第(八)条的相关规定。

#### (三) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十九、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (二) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 二十、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金

份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

**(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:**

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2、对证券投资业绩进行预测;
- 3、违规承诺收益或者承担损失;
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

**(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。**

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

**(五) 公开披露的基金信息**

公开披露的基金信息包括:

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(1) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上;基金管理人在公告的

15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书, 并就有关更新内容提供书面说明。

(2) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系, 明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序, 说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告, 并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体和基金管理人网站上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在每个开放日的次日, 通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介, 披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日, 将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

## 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率, 并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

## 6、基金定期报告, 包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

《基金合同》生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件, 有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书, 予以公告, 并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件, 是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- (1) 基金份额持有人大会的召开;
- (2) 终止《基金合同》;
- (3) 转换基金运作方式;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金募集期延长;
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,

基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金注册登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

#### 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 10、中国证监会规定的其他信息。

### (六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与



格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### **(七) 信息披露文件的存放与查阅**

基金合同、招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

上市交易公告书、基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## **二十一、风险揭示**

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。面临的主要风险有市场风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、管理风险、流动性风险、本基金指数投资有关风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险等。

#### **(一) 市场风险**

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

## （二）标的指数的风险

### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

### 2、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

### 3、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

## （三）基金净值增长率与业绩比较基准偏离的风险

跟踪误差反映的是投资组合与业绩比较基准之间的偏离程度，是控制投资组合与基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。本基金的目标是将日平均跟踪误差控制在0.35%以内，年化跟踪误差不超过4%。以下原因可能会影响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

1、由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2、由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3、成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

4、由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5、由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6、在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

7、其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### **(四) 基金交易价格与份额净值发生偏离的风险**

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然基金的份额净值反映基金投资组合的资产状况，但是交易价格受到很多因素的影响，比如中国的经济情况、投资人对于中国股市的信心以及本基金的供需情况等。

#### **(五) 管理风险**

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

#### **(六) 流动性风险**

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括：由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

### （七）上市交易的风险

本基金在基金合同生效且符合上市交易条件后，在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

### （八）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### （九）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

2、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

4、因业务竞争压力可能产生的风险；

5、因战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平；或导致基金管理人、基金销售代理人等机构无法正常工作，从而影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险；

6、其他意外导致的风险。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，按照基金合同的规定可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

4、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算小组

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 2、基金财产清算程序

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法

律意见书;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配;

基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金合同内容摘要

### (一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的权利包括但不限于:

(1) 依法募集基金;

(2) 自《基金合同》生效之日起, 根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4) 销售基金份额;

(5) 召集基金份额持有人大会;

(6) 依据《基金合同》及有关法律规定的监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定, 应呈报中国证监会和其他监管部门, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

(8) 选择、委托、更换基金代销机构, 对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10) 依据《基金合同》及有关法律规定的基金收益的分配方案;

(11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下, 制订和调整《业务规则》, 决定和调整除调高管理费率, 托管费率和赎回费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

(13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(14) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资;

(15) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

(1) 依法募集基金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜; 如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定, 应呈报中国证监会和其他监管部门, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5) 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分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制半年度和年度基金报告;

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13) 按《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基金收益;

(14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15) 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;

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

(18) 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;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;



(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时, 应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任; 但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失, 而基金管理人首先承担了责任的情况下, 基金管理人有权向第三方追偿;

(23) 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实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册, 定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:

(1) 自《基金合同》生效之日起, 依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户, 用于证券交易资金清算;

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户, 负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(8) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于:

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 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；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时, 应为基金利益向基金管理人追偿;

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受, 基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额, 即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1) 分享基金财产收益;

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产;

(3) 依法转换及依法申请赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7) 监督基金管理人的投资运作;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1) 遵守《基金合同》;

(2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(3) 在其持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

- (4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

##### 1、 召开事由

- (1) 当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开基金份额持有人大会:
  - 1) 终止《基金合同》;
  - 2) 更换基金管理人;
  - 3) 更换基金托管人;
  - 4) 转换基金运作方式;
  - 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和赎回费率, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的情况除外;
  - 6) 变更基金类别;
  - 7) 本基金与其他基金的合并;
  - 8) 变更基金投资目标、范围或策略 (法律法规和中国证监会另有规定的除外);
  - 9) 变更基金份额持有人大会程序;
  - 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - 11) 单独或合并持有本基金总份额 10% 以上 (含 10%) 基金份额的基金份额持有人 (以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同) 就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
  - 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- (2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、降低赎回费率或变更收费方式;
- 4) 经中国证监会允许, 基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则;
- 5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
- 7) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

- (1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;
- (2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;
- (3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当由基金托管人自行召集。
- (4) 单独或合并代表基金份额 10%以上 (含 10%) 的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 单独或合并代表基金份额 10%以上 (含 10%) 的基金份额持有人仍认为有必要召开的, 应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人; 基金托管人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。
- (5) 单独或合并代表基金份额 10%以上 (含 10%) 的基金份额持有人就同一事项要求召

开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合并代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- ①会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- ②会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- ③有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- ④授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- ⑤会务常设联系人姓名及联系电话；
- ⑥出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- ⑦召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

#### (1) 现场开会

由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

①亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

②经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。

## **(2) 通讯开会**

通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

①会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后,在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为监督人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);

④上述第③项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定;

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

## **5、议事内容与程序**

### **(1) 议事内容及提案权**

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少 30 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的提案进行审核,符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

①关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### ①现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权



其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## ②通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在监督人及公证机关监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### （1）现场开会

①如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

②监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

③如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

④计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## (五) 基金合同的变更和终止

### 1、《基金合同》的变更

(1) 以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- 1) 更换基金管理人；
- 2) 更换基金托管人；
- 3) 转换基金运作方式；
- 4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和赎回费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的情况除外；
- 5) 变更基金类别；
- 6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- 9) 终止《基金合同》；
- 10) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、降低赎回费率或变更收费方式；
- 4) 经中国证监会允许，基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- 7) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可

执行,自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## 2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的;
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止,在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- (3) 《基金合同》约定的其他情形;
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### (4) 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止后,由基金财产清算小组统一接管基金;
  - 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
  - 3) 对基金财产进行估值和变现;
  - 4) 制作清算报告;
  - 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
  - 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
  - 7) 对基金财产进行分配;
- (5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

## 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## (六) 争议的处理

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

## (七) 基金合同的存放及查阅方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅,并同时刊登在基金管理人的网站;投资者也可按工本费购买《基金合同》复印件或复印件,但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十四、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称:嘉实基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室



法定代表人：王忠民

成立时间：1999 年 3 月 25 日

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字[1999]5 号

注册资本：人民币 1.5 亿元

组织形式：中外合资

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理以及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：010-65215588

传真：010-65185678

联系人：胡勇钦

## 2、基金托管人

基金托管人名称：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

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

经营范围：

办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；

外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人的投资行为行使监督权, 主要包括以下方面：

- （1）对基金投资范围、投资对象进行监督。
- （2）对投融资比例进行监督；
- （3）对基金投资禁止行为进行监督；
- （4）对于基金关联投资限制进行监督；

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人负责保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

- （5）对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

- （A）对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托

管人提出书面申请,基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会。

(B) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任。

(C) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人与基金托管人协商一致后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程,则对于由于交易对手资信风险引起的损失,不承担赔偿责任。

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程,则对于由于存款银行信用风险引起的损失,不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(A) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(B) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、



公开发行的股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(C) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前, 向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票, 基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内, 以书面或其他双方认可的方式进行确认。

(D) 基金投资流通受限证券前, 基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息, 包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期, 基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整, 并于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。即增加已持有流通受限证券市值占资产净值的比例的提供, 从而使审核指标更为完整。

(E) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督, 并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的, 有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明, 并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则, 基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的, 基金托管人不承担任何责任, 并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致, 应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责, 则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责, 导致基金出现风险, 基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信

息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

基金托管人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,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### **(三) 基金管理人对基金托管人的业务核查**

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金

管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

#### (四) 基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- (1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- (2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- (4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的完整与独立。
- (5) 对于因基金认(申)购、基金投资过程中产生的应收财产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担责任。

##### 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定,将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的嘉实基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上(含 2 名)中国注册会计师签字有效。验资完成,基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托

管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

### 5、债券托管账户的开立和管理

(1) 《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2) 基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

## 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

## 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库;其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

## 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

## (五) 基金资产净值计算和会计核算

### 1、基金资产净值的计算

#### (1) 基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以加密传真方式或双方认可的其他方式发送给基金托管人。基金托

管人对净值计算结果复核后, 签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人, 由基金管理人  
人对基金净值予以公布。

根据《基金法》, 基金管理人计算并公告基金资产净值, 基金托管人复核、审查基金管  
理人计算的基金资产净值。因此, 本基金的会计责任方是基金管理人, 就与本基金有关的会  
计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人  
对基金资产净值的计算结果对外予以公布法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。  
如有新增事项, 按国家最新规定估值。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此, 就与本基金有关的  
会计问题, 本基金的会计责任方是基金管理人, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍  
无法达成一致的意见, 按照基金管理人对外予以公布。

## 2、基金资产估值方法

### (1) 估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

### (2) 估值方法

本基金的估值方法为:

#### (A) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券 (包括股票、权证等), 以其估值日在证券交易所挂牌的市价  
(收盘价) 估值; 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 以最近交易  
日的市价 (收盘价) 估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品  
种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格。

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日没有交易的, 且最近交  
易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发  
生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确  
定公允价格;

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应  
收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化,  
按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最  
近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,  
调整最近交易市价, 确定公允价格;

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所上市的  
资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,

按成本估值。

(B) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

①送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

②首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(C) 因持有股票而享有的配股权,从配股除权日起到配股确认日止,如果收盘价高于配股价,按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

(D) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

(E) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

(F) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(G) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

### 3、估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担,基金管理人对不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的,由此造成的投资者或基金的损失,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失,以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,

由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时,相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对,如果最后仍无法达成一致,应以基金管理人的计算结果为准对外公布,由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任,基金托管人不负赔偿责任。

#### 4、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后,应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧,应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

#### 5、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内,基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上,并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告;在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告;在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日,对报表加盖公章后,以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核;基金托管人在 3 个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 30 日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后 45 日内复核,并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中,发现相关各方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意



见书,相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后,需盖章确认或出具相应的复核确认书,以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **(六) 基金份额持有人名册的登记与保管**

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册,包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### **(七) 争议解决方式**

相关各方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,除经友好协商可

以解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在北京,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## (八) 基金托管协议的变更、终止

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况,本托管协议终止:

- (1) 《基金合同》终止;
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产;
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权;
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十五、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 资料寄送

#### 1、场外投资者

每次交易结束后,可在T+2工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单;首次基金交易(除基金开户外其他交易类型)后15个工作日内,基金管理人向基金份额持有人寄送交易对账单;每季度结束后15个工作日内,基金管理人向本季度的场外部分定制纸质对账单的投资者寄送对账单;每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

#### 2、场内投资者



每次交易结束后,可在T+1工作日后到交易网点进行确认单的查询和打印,注册登记机构和基金管理人不会寄送场内投资者的对账单,投资者可随时到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务手段查询。

## (二) 红利再投资

若基金份额持有人选择将基金收益以基金份额形式进行分配,该持有人当期分配所得的红利将按照除息日的基金份额净值自动转为本基金份额,并免收费用。

## (三) 定期定额投资计划

基金管理人自 2010 年 2 月 10 日起先后开通中国工商银行、中国银行、中国农业银行、交通银行等代销机构办理本基金定期定额投资的服务,具体请参见相应的基金公告。

## (四) 手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值(场外基金净值)短信服务。基金份额持有人可以拨打客户服务电话400-600-8800(免长途电话费)或(010) 85712266,也可通过基金管理人网站定制短信服务。

## (五) 在线服务

通过本公司网站www.jsfund.cn,基金份额持有人还可获得如下服务:

### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

### 3、网上交易和电话交易服务

投资者可持中国银行长城借记卡、工商银行借记卡、建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、交通银行太平洋借记卡、招商银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、中国民生银行借记卡、广发理财通卡、北京银行卡、兴业银行卡、浦发银行东方卡或活期一本通账户、中信银行借记卡、光大银行借记卡、富滇商业银行借记卡、长沙银行借记卡、金华借记卡、杭州银行借记卡、



顺德农商银行借记卡、上海农商行借记卡、南京银行借记卡、温州银行借记卡、齐鲁银行借记卡、宁波银行借记卡、深圳发展银行借记卡、江苏银行借记卡、东莞银行借记卡登录本基金管理人网站办理相应网上交易和电话交易业务；持建行龙卡储蓄卡、工商银行借记卡、广发银行理财通卡、农行金穗卡、招商银行借记卡、浦发银行东方卡、中国民生银行借记卡、兴业银行银行卡的投资者还可登录本基金管理人网站办理相应基金网上交易定期定额申购业务，具体参见相应的基金公告。

网上交易投资者开通电话交易后可以通过电话交易赎回、转换所持基金份额，持建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、广发银行理财通卡、招行借记卡、浦发银行东方卡可以通过电话交易系统购买基金。

#### (六) 咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途电话费）或（010）85712266，传真（010）65182266。

#### 2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十六、其他应披露事项

自 2010 年 12 月 30 日至 2011 年 6 月 30 日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的临时报告：

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于对中国民生银行借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易和电话交易业务的公告	2010 年 12 月 31 日	含本基金
2	关于旗下基金在交通银行开办定投起点金额调整的公告	2011 年 1 月 5 日	含本基金
3	关于旗下开放式基金通过天相投顾开办定投业务的公告	2011 年 1 月 24 日	含本基金
4	关于交通银行开办嘉实旗下基金日常转换业务的公告	2011 年 2 月 22 日	含本基金
5	关于对中国工商银行借记卡持有人开通直销网上交易定期定额申购业务的公告	2011 年 3 月 25 日	含本基金



6	关于通过中国工商银行个人电子银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	2011 年 4 月 1 日	含本基金
7	关于旗下开放式基金通过中信证券开办定投业务的公告	2011 年 5 月 4 日	含本基金
8	嘉实基金管理有限公司董事长变更公告	2011 年 5 月 11 日	
9	关于对中国工商银行借记卡持卡人通过嘉实直销网上交易的在线支付方式申购费率优惠促销的公告	2011 年 6 月 9 日	含本基金

## 二十七、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十八、备查文件

1. 中国证监会核准嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF) 募集的文件；
2. 《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
3. 《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**嘉实基金管理有限公司**

**2011年8月31日**