


# 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书

(2012 年第 1 号)

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

## 重要提示

(一) 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金或基金”) 经中国证券监督管理委员会于 2005 年 6 月 20 日《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字 [2005]103 号) 和《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函[2005]171 号) 的批准公开募集。本基金基金合同于 2005 年 8 月 29 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) 本招募说明书是对原《嘉实沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》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做出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。

(四) 投资有风险, 投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

(五) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(六) 本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 2 月 29 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 12 月 31 日 (未经审计)。

## 目 录

一、绪言.....	3
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	14
五、相关服务机构.....	18
六、基金份额的场内认购.....	34
八、基金合同的生效.....	38
九、基金份额的交易.....	38
十、基金份额的申购和赎回.....	39
十一、基金份额的非交易过户和基金间转换.....	46
十二、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记.....	49
十三、基金的投资.....	49
十四、基金的业绩.....	59
十五、基金的融资.....	60
十七、基金资产估值.....	62
十八、基金的收益与分配.....	65
十九、基金的费用与税收.....	66
二十、基金的会计与审计.....	69
二十一、基金的信息披露.....	69
二十二、风险揭示.....	73
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	75
二十四、基金合同的内容摘要.....	76
二十五、基金托管协议的内容摘要.....	88
二十六、对基金份额持有人的服务.....	94
二十七、其它应披露事项.....	96
二十八、招募说明书的存放及其查阅方式.....	96
二十九、备查文件目录.....	96

## 一、绪言

嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由嘉实基金管理有限公司依照《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》)、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》(以下简称《业务规则》)、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“本基金合同”)及其它有关规定募集。

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《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》)以及本基金合同等编写。

本招募说明书阐述了嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)的投资目标、投资策略、风险、费率、管理等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本招募说明书。

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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中,除非文义另有所指,下列词语具有以下含义:

序号	词语	释义
1	招募说明书或本招募说明书	指《嘉实沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
2	基金合同	指《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充。
3	《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》。
4	《运作办法》	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会发布并于同年 7 月 1 日起

		施行的《证券投资基金运作管理办法》。
5	《销售办法》	指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会发布并于同年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》。
6	《信息披露办法》	指 2004 年 6 月 11 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》。
7	《业务规则》	指 2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日起施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》。
8	元	指人民币元
9	本基金	指嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
10	发售公告或基金份额发售公告	指《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金份额发售公告》
11	中国证监会	指中国证券监督管理委员会
12	中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
13	基金管理人	指嘉实基金管理有限公司
14	基金托管人	指中国银行股份有限公司 (以下简称“中国银行”)
15	注册登记业务	指本基金登记、存管、清算和交收业务, 具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。
16	注册登记代理机构	指接受基金管理人委托代为办理本基金注册登记的机构。
17	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。
18	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。
19	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、上市交易的场所。
20	代销机构	指接受基金管理人委托代为办理本基金的认购、申购、赎回及转托管等业务的机构。
21	销售机构	指基金管理人及基金代销机构。
22	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。
23	注册登记人	指中国证券登记结算有限责任公司。
24	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。
25	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。
26	基金合同当事人	指受基金合同约束, 根据本基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。
27	基金投资者	指个人投资者和机构投资者。
28	个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者。
29	机构投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体或其他组织。
30	基金合同生效日	指基金募集期结束并达到合同生效条件后向中国证监会办理基金合同备案手续并收到其书面确认之日。
31	募集期	指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。

32	存续期	指基金合同生效至基金合同终止, 基金存续的不定期之期限。
33	日/天	指公历日
34	月	指公历月
35	发售	指场外认购和场内认购。
36	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。
37	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。
38	工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
39	T 日	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期。
40	T+N 日	指自 T 日起第 N 个工作日 (不包含 T 日)。
41	开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。
42	认购	指在本基金募集期内, 投资者申请购买本基金份额的行为。
43	申购	指在本基金基金合同生效后, 投资者申请购买本基金份额的行为。
44	赎回	指基金份额持有人按本基金合同规定的条件, 要求基金管理人购回本基金份额的行为。
45	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。
46	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。
47	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。
48	开放式基金账户	指注册登记人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
49	证券账户	指注册登记人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注册登记人的证券登记结算系统。
50	巨额赎回	指在单个开放日内, 本基金净赎回申请份额 (本基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额) 超过上一开放日本基金总份额的 10% 的情形。
51	基金收益	指基金投资所得债券利息、股票分红、买卖证券差价、银行存款利息及其他合法收入。
52	基金资产总值	指基金购买各类证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和。
53	基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值。
54	基金份额净值	指基金资产净值除以基金份额总数。
55	基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值, 以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。
56	不可抗力	指任何无法预见、无法避免和无法克服的事件或因素, 包括但不限于地震、洪水等自然灾害, 战争、骚乱、火灾、政府征用、没收, 相关法律、法规的变更, 突发停电或其他突发事件、证券交

		易场所暂停或停止交易。
57	指定媒体和网站	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站, 包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ), 基金管理人网站 ( <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> )。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

##### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元
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	安奎
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, 是中国第一批基金管理公司之一, 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、南京、福州、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、登记结算部、基金运营部、信息技术部、财务部、人力资源部、战略发展部等部门。

股票投资部、固定收益部、定量投资部、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、客户服务部、电子商务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。登记结算部、基金运营部、信息技术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工作。人力资源部负责公司企业文化建设、文字档案、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 2012 年 2 月 29 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、29 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、嘉实优质企业股票、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、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。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、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

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。中共党员,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外

经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、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董事、总经理。

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。

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 年至今任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今任立信投资有限责任公司董事长。

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。

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。

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有限公司,历任督察长和公司副总经理。

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有限公司,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公司总经理助理。

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

杨宇先生,经济学硕士,毕业于南开大学数学系和金融学系,具有13年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理,2003年3月15日至2004年7月7日任万家(原天同)180指数证券投资基金基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司,2005年8月29日至今任本基金基金经理。

杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。

本基金无历任基金经理。

### 3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,投资决策委员会的成员包括:公司总经理赵学军先生、公司副总经理戴京焦女士,总经理助理詹凌蔚先生、公司总经理助理邵健先生、股票投资部总监刘天君先生、机构投资部总监党开宇女士、资深基金经理陈勤先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托经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;

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、编制中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

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、有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

#### (四) 基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反法律法规行为的发生。

3、本基金管理人建立健全内部控制制度,采取有效措施,禁止将基金财产用于下列投资或活动:

(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,但是国务院另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、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其基金管理人、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) 依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

(1) 越权或违规经营,违反基金合同或托管协议;

(2) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

(3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假;

(4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(5) 玩忽职守、滥用职权;

(6) 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;

(7) 除按依法进行基金资产管理外,直接或间接进行其他股票投资;

(8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不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) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

#### **(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、总监及资深基金经理组成,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、督察长以及相关管理部门负责人组成,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工作流程、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) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

1912 年 2 月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从 1912 年至 1949 年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年，中国银行改为国有独资商业银行。2003 年，中国银行启动股份制改造。2004 年 8 月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及 31 个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset

(《财资》) 评为中国最佳贸易融资银行, 被 Finance Asia (《金融亚洲》) 评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行, 被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇, 中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展, 向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部, 为进一步树立以投资者为中心的服务理念, 中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部, 下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队, 现有员工 120 余人。另外, 中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前, 中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内, 中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务, 为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元, 居同业前列。

## (三) 证券投资基金托管情况

截至 2011 年 12 月末, 中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合 (LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信



天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业 (TMT) 50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII)、博时抗通胀增强回报 (QDII)、华安大中华升级股票型 (QDII)、信诚全球商品主题 (QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型 (QDII) 等 137 只证券投资基金, 覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金, 满足了不同客户多元化的投资理财需求, 基金托管规模位居同业前列。

#### (四) 托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权, 并在辖内实行业务授权管理和从业

人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行爲,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### (五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## 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) 65180615
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	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元		
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		
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	(0755) 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	(0532) 6677766	传真	(0532) 66777676
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 313 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331
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	(0591) 88013673	传真	(0591) 88013670
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	(025) 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	庄文胜		

**2. 代销机构**

## (1) 中国银行股份有限公司

注册地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号		
办公地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号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

## (2) 中国工商银行股份有限公司

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

## (3) 中国农业银行股份有限公司

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	蒋超良	联系人	滕涛
电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

## (4) 中国建设银行股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 25 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心		
法定代表人	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

## (5) 交通银行股份有限公司

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

## (6) 招商银行股份有限公司

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	<a href="http://www.cmbchina.com">www.cmbchina.com</a>	客服电话	95555

## (7) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址	上海市浦东新区浦东南路 500 号		
办公地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	倪苏云、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	<a href="http://www.spdb.com.cn">www.spdb.com.cn</a>	客服电话	95528

## (8) 兴业银行股份有限公司

住所	福州市湖东路 154		
办公地址	上海市江宁路 168		
法定代表人	高建平	联系人	潘玲
电话	(021) 52629999	传真	(021) 62569070
客服电话	95561	网址	www.cib.com.cn

## (9) 中国民生银行股份有限公司

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)58560666	传真	(010) 57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

## (10) 中信银行股份有限公司

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	田国立	联系人	丰靖
电话	(010) 65557083	传真	(010) 65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

## (11) 华夏银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 22 号		
法定代表人	吴建	联系人	郑鹏
电话	010-85238667	传真	010-85238680
网址	www.hxb.com.cn	客服电话	95577

## (12) 深圳发展银行股份有限公司

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

## (13) 北京银行股份有限公司

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

## (14) 平安银行股份有限公司

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	<a href="http://bank.pingan.com">http://bank.pingan.com</a>	客服电话	95511-3

## (15) 宁波银行股份有限公司

住所	宁波市鄞州区宁南南路 700 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	<a href="http://www.nbcb.com.cn">www.nbcb.com.cn</a>	客服电话	96528, 962528 上海、北京地区

## (16) 中国光大银行股份有限公司

注册地址	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	010-683636157
网址	<a href="http://www.cebbank.com">www.cebbank.com</a>	客服电话	95595

## (17) 东莞银行股份有限公司

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	<a href="http://www.dongguanbank.cn">www.dongguanbank.cn</a>		

## (18) 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	<a href="http://www.gdb.com.cn">www.gdb.com.cn</a>		

## (19) 杭州银行股份有限公司

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	<a href="http://www.hzbank.com.cn">www.hzbank.com.cn</a>

## (20) 浙商银行股份有限公司

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	<a href="http://www.czbank.com">www.czbank.com</a>	客服电话	95527

## (21) 江苏银行股份有限公司

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	<a href="http://www.jsbchina.cn">www.jsbchina.cn</a>	客服电话	(025) 96098、 4008696098

## (22) 乌鲁木齐商业银行股份有限公司

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	<a href="http://www.uccb.com.cn">www.uccb.com.cn</a>	客服电话	(0991) 96518

## (23) 中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010) 60833722	传真	(010) 60833739
网址	<a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a>	客服电话	95558

## (24) 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

## (25) 中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	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

## (26) 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

## (27) 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.sywg.com	客服电话	(021) 962505

## (28) 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

## (29) 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	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

## (30) 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	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

## (31) 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	4008881111、95565

## (32) 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	孙菁菁
电话	025-83290537	传真	025- 51863323
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

## (33) 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	李春芳
电话	(0755) 83516089	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006668888、(0755) 33680000

## (34) 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 10 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

## (35) 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

## (36) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路 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

## (37) 渤海证券股份有限公司



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

## (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) 82558355
网址	www.essence.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

注册地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755) 82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

## (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) 中国中投证券有限责任公司

住所地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.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 号新南城商务中心 A 栋 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	李丹
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	杨宝林	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	南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	(0791) 86768681	传真	(0791) 86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

## (49) 中信证券(浙江)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	沈强	联系人	丁思聪
电话	(0571) 96598	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	曾小普	联系人	徐美云
电话	(0791) 86285337	传真	(0791) 86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

## (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	刘莹
电话	(029) 87416787	传真	(029) 87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

## (55) 广州证券有限责任公司

办公地址	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼		
法定代表人	刘东	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

## (56) 国联证券股份有限公司

注册地址	江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层		
办公地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702		
法定代表人	雷建辉	联系人	沈刚
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	95570

## (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		
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	李铮
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	许嘉行
电话	(0571) 87901912	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	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街 111 号		
法定代表人	庞介民	联系人	王旭华
电话	(010) 66297386	传真	(0471) 4961259
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471) 4972343

## (61) 东海证券有限责任公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼		
法定代表人	朱科敏	联系人	梁旭
电话	(0519) 88157761	传真	(0519) 88157761
网址	www.longone.com.cn	客服电话	400-888-8588

## (62) 东方证券股份有限公司

住所	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层		
办公地址	上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021) 63325888	传真	(021) 63326173
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

## (63) 第一创业证券股份有限公司

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

## (64) 宏源证券股份有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010) 88085858	传真	(010) 88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

## (65) 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	余政	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

## (66) 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) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

## (67) 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

## (68) 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	方文
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
网址	www.csc.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

## (69) 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

## (70) 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	苏卓仁
电话	(0769) 22112062	传真	(0769) 22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769) 961130

## (71) 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) 8784656	传真	(0931) 4890628
客服电话	(0931) 4890208、(0931) 4890619	网址	www.hlzqgs.com

## (72) 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

## (73) 财通证券有限责任公司

住所、办公地址	杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571) 87925129	传真	0571-87818329
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571) 96336、962336 (上海地区)

## (74) 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

## (75) 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) 4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

## (76) 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	牟冲
电话	(010) 58328366、(010) 58328722	传真	(010) 58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

## (77) 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	洪家新	联系人	雷蕾
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
客服电话	(021) 32109999, (029) 68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

## (78) 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	客服电话	4001022011

## (79) 天相投资顾问有限公司

注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701		
办公地址	北京市西城区金融大街 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		
天相投顾网址	http://www.txsec.com		
天相基金网网址	http://jijin.txsec.com		

## (80) 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

## (81) 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

## (82) 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

## (83) 爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888	传真	021- 68728782

客服电话	(021) 63340678	网址	www.ajzq.com
------	----------------	----	--------------

## (84) 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	毛雪梅
电话	(021) 50122222	传真	(021) 50122200
客服电话	4008209898	网址	www.cnhbstock.com

## (85) 方正证券股份有限公司

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	郭军瑞
电话	(0731) 85832503	传真	(0731) 85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

## (86) 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	刘晓章
电话	(0755) 83007069	传真	(0755) 83007167
客服电话	4008-698-698	网址	www.ydsc.com.cn

## (87) 西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢		
法定代表人	王珠林	联系人	陈诚
电话	(023) 63786464	传真	(023) 63786311
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.com.cn

## (88) 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	冯杰
电话	(010)83991743	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	(010) 83991888		

## (89) 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	高冠江	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

## (90) 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

## (91) 华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 8 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 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

## (92) 国海证券有限责任公司

住所、办公地址	广西桂林市辅星路 13 号		
法定代表人	张雅锋	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0755-83700205
客服电话	95563 (全国)	网址	www.ghzq.com.cn

## (93) 国信证券股份有限公司

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
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

## (94) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818	传真	021-68775878
网址	www.cf-clsa.com	客服电话	68777877

## (95) 华西证券有限责任公司

住所	四川省成都市陕西街 239 号		
办公地址	深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼深圳总部		
法定代表人	杨炯洋	联系人	金达勇
电话	(0755) 83025723	传真	(0755) 83025991
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

## (二) 深圳证券交易所(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、华福证券、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)。

### (三) 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	朱立元
电话	(010) 59378839	传真	(010) 59378907

### (四) 律师事务所和经办律师

名称	国浩律师(北京)事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路 38 号泰康金融大厦 9 层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	(010) 65171188	传真	(010) 65176801
经办律师	黄伟民		

### (五) 会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所有限公司		
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	吴海霞
电话	(021) 61238888	传真	(021) 61238800
经办注册会计师	汪棣、吴海霞		

## 六、基金份额的场内认购

本基金为契约型上市开放式基金。基金存续期限为不定期。本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2005 年 6 月 20 日证监基金字[2005]103 号文核准募集。

本基金的发售包括场内认购和场外认购两种方式。本章是有关基金的场内认购，发售后登记在证券登记结算系统的基金份额适用本章的相关规定。本章不适用于发售后登记在注册登记系统的基金份额，此等份额适用下一章《基金的场外认购》的相关规定。

除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

### (一) 基金份额的募集期限、销售渠道、销售对象

1、募集期限：2005年7月5日至2005年8月19日。

2、销售对象：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律法规及有关禁止购买证券投资基金者除外）。

3、销售渠道：本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，销售渠道为深圳证券交易所会员单位。

#### (二) 募集目标

本基金不预设募集规模上限。

#### (三) 认购的时间

在发售期内，深圳证券交易所将于交易日交易时间内持续挂牌定价销售本基金份额（具体时间见发售公告）。

#### (四) 认购方式与费率结构

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但认购资金一旦交付，撤销申请不予接受。本基金份额的面值为 1 元，挂牌价格为基金面值。投资人认购采用全额缴款的认购方式。

投资人场内认购需缴纳认购费用。

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。认购费率按认购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

费率表如下：

认购金额 (M, 含认购费)	认购费率
M < 50 万元	1.0%
50 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.6%
M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔

#### (五) 认购的数额约定

本基金场内认购最低份额为 1000 份，超过 1000 份的为 1000 份的整数倍。

#### (六) 认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金持有人所有。利息折算的份额保留至 1 份，余额计入基金资产。

#### (七) 认购金额和利息折算的份额的计算

本基金场内认购采用份额认购的方式。本基金认购金额和利息折算的份额（精确到个位数）的计算如下：

认购金额 = 挂牌价格 × (1 + 认购费率) × 认购份额

认购费用 = 挂牌价格 × 认购份额 × 认购费率

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

利息折算的份额 = 利息 / 挂牌价格

## 七、基金份额的场外认购

本基金的发售包括场外认购和场内认购两种方式。本章是有关基金的场外认购, 发售后登记在注册登记系统的基金份额适用本章的相关规定。本章不适用于发售时登记在证券登记结算系统的基金份额, 此等份额适用上一章《基金的场内认购》的相关规定。除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外, 任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

### (一) 募集方式

场外认购, 分为代销与直销两种方式。

### (二) 募集期限

2005 年 7 月 5 日至 2005 年 8 月 19 日。

### (三) 销售对象

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者(法律法规及有关禁止购买证券投资基金者除外)。

### (四) 销售渠道

本基金通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点向投资人公开发售。

### (五) 认购时间

2005 年 7 月 5 日至 2005 年 8 月 19 日, 具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

### (六) 本基金场外认购费用及认购份额计算公式

#### 1、认购费用

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。认购费率按认购金额采用比例费率, 投资人在一天之内如果有多笔认购, 适用费率按单笔分别计算。

认购费率表如下:

认购金额 (M, 含认购费)	认购费率
$M < 50$ 万元	1.0%
$50 \text{ 万元} \leq M < 200$ 万元	0.8%
$200 \text{ 万元} \leq M < 500$ 万元	0.6%
$M \geq 500$ 万元	按笔收取, 1000 元/笔

#### 2、计算公式

本基金场外认购采用金额认购的方式。认购份额采用四舍五入的方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

本基金认购份额的计算如下：

认购费用= 认购金额/（1+认购费率） × 认购费率

净认购金额= 认购金额/（1+认购费率）

认购份额=（净认购金额+利息）/ 基金份额面值

#### （七）认购的程序

1、申请方式：书面申请或管理人公布的其他方式。

2、认购款项支付：基金投资人认购时，采用全额缴款方式，若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

#### （八）投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

##### 2、认购方式

本基金认购采取金额认购的方式。

##### 3、认购确认

销售网点受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记与过户机构的确认登记为准。投资人可在基金合同正式生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

##### 4、认购限制

（1）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已申请的认购一旦被注册登记人确认，就不再接受撤销申请。

（2）在募集期内，本基金场外首次认购的最低金额为 1000 元，追加认购的最低金额为 1000 元。场外首次认购和追加认购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准。本基金直销网点最低认购金额为 2 万元。

#### （九）募集目标

本基金不设募集规模上限。

#### （十）认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金持有人所有，其中利息以注册登记人的记录为准。

#### (十一) 有关本基金认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购的方式。认购份额采用四舍五入的方法保留至小数点后两位, 由此产生的误差计入基金资产。

## 八、基金合同的生效

### (一) 基金合同生效时间

本基金根据《关于同意嘉实沪深300指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字(2005)103号)和《关于同意嘉实沪深300指数证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函(2005)171号)核准公开发售。实际募集期限为2005年7月5日至2005年8月19日。本基金基金合同自2005年8月29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限制

本基金合同生效后, 基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 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和报送解决方案。

## 九、基金份额的交易

本基金的日常交易包括上市交易和申购赎回两种方式。本章是有关基金的上市交易。

### (一) 上市交易的地点: 深圳证券交易所

### (二) 上市交易日期: 2005 年 10 月 17 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比照封闭式基金的有关规定办理。

### (五) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易, 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

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

#### (七) 暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- (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) 违反国家有关法律、法规，被中国证监会决定暂停上市；
- (4) 深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

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。

#### (八) 恢复上市的公告

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，并在至少一种指定报刊和网站上刊登恢复上市公告。

#### (九) 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，基金管理人在报经中国证监会批准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。

## 十、基金份额的申购和赎回

本基金的日常交易包括申购赎回和上市交易两种方式。本章是有关基金的申购和赎回。

### (一) 申购、赎回场所

- 1、嘉实基金管理有限公司直销机构。
- 2、经基金管理人委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点（详见第五章“柜台（场外）基金份额发售机构”）。

### (二) 申购、赎回的开放日及开放时间

本基金自 2005 年 9 月 15 日起办理场外日常申购业务。

本基金自 2005 年 10 月 17 日起办理场外赎回业务、场内的申购与赎回业务。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日,开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整,应报中国证监会备案,并在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

### **(三) 申购、赎回的原则**

1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日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。

3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、投资者提交赎回申请时,由系统自动识别先前认购/申购基金份额的时间,按每笔交易的具体时间来计算持有期限,系统会采取先进先出法,即先认购/申购的基金份额会先赎回,按不同的持有期限分别计算收取赎回费。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### **(四) 申购、赎回的数额限制**

1、代销网点每个账户首次申购的最低金额为 1,000 元,直销中心每个账户首次申购的最低金额为 2 万元。已在任一网点(包括直销中心)有认(申)购本基金记录的投资者,最低申购金额为 1000 元。

2、本基金不设最低赎回份额,且本基金份额持有人在本基金销售机构进行某笔赎回后,在该等销售机构保留的本基金基金份额余额不设最低份额限制。

3、基金管理人可根据市场情况,调整申购、赎回份额的数量限制。本基金代销机构首次申购和追加申购的最低金额的调整按照基金管理人和代销机构约定的为准。本基金直销最低申购金额由基金管理人调整;调整前的三个工作日基金管理人必须在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### **(五) 申购、赎回的程序**

1、申请方式:书面申请或基金销售机构规定的其他方式。

2、基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续,向基金销售机构提出申购、赎回的



申请。

投资人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，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

### 3、申购、赎回申请的确认

T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日后到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### 4、申购、赎回的款项支付

基金申购采用全额缴款方式，若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。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项通常在 T+7 日内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回或延期支付的情形时，款项的支付办法参照本基金合同和招募说明书的有关条款办理。

5、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

## (六) 申购份额、赎回金额的计算方式

### 1、申购份额及余额的处理方式

本基金的申购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，申购份额采用四舍五入的方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

### 2、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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

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

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

但本基金申购金额在 500 (含) 万元以上，适用绝对数额的申购费金额 (每笔 1000 元)，即净申购金额=申购金额-申购费用。

例：某投资人投资 10 万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000 元
基金份额净值 (NAV)	1.0160 元
申购费用	$100,000 - 98,522.17 = 1,477.83$ 元
净申购金额	98,522.17 元

申购份额	$98,522.17/1.016=96,970.64$ 份
------	-------------------------------

### 3、基金赎回金额的计算

赎回费 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 - 赎回费

例：某投资人赎回 10,000 份本基金，假设赎回当日的基金份额净值为 1.0560 元，持有期不足一年，则其可得到的赎回金额为：

赎回份额	10,000 份
基金份额净值 (NAV)	1.0560 元
赎回费用	$10,000 \times 1.056 \times 0.5\% = 52.80$ 元
赎回金额	$10,000 \times 1.056 - 52.80 = 10,507.20$ 元

### 4、赎回金额的处理方式

本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用，赎回金额保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

### 5、基金份额净值的计算

本基金每个工作日公告基金份额净值，当日基金份额净值在当天收市后计算，并在下一工作日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

当日基金份额净值 = 当日基金资产净值 / 当日基金份额数

## (七) 申购费率和赎回费率

### 1、申购费率

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减，可适用以下前端收费费率标准：

申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 50 万元	1.5%
50 万元 ≤ M < 200 万元	1.2%
200 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔

个人投资者通过本基金管理人网上交易和电话交易系统申购本基金实行申购费率优惠，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、中国农业银行金穗卡持卡人，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开放式基金业务，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%，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。

基金招募说明书及相关临时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、本基金场内的赎回费率统一为 0.5%；本基金场外赎回费率不高于 0.5%，随在开放式基金账户中的持有期限的增加而递减：

持有期限	赎回费率
持有期<一年	0.5%
一年≤持有期<两年	0.25%
持有期≥两年	0

注：就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可按中国证监会规定的程序调整申购费率、赎回费率，并在《招募说明书》及其他公告进行公开披露。基金管理人调整申购费率、赎回费率应最迟在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站公告。

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，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。

#### （八）赎回费的归属和申购费、赎回费的用途

本基金赎回费的 25% 归入基金财产所有。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。

#### （九）申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续。

投资者赎回基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动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，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站上刊登公告。

#### （十）拒绝或暂停接受申购的情形及处理

本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、不可抗力；
- 2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金持有人利益产生损害；

4、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；

5、基金管理人、基金托管人、代销机构或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

6、基金场内交易停牌时；

7、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。

#### **(十一) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理**

本基金发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、不可抗力；

2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金场内交易停牌时；

4、法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。已确认的赎回申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回份额。投资者在申请赎回时可以选择将当日未获受理部分予以撤销。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停赎回或延缓支付赎回款项的，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回或延缓支付赎回款项的公告。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并按时支付赎回款项。

#### **(十二) 巨额赎回的情形及处理方式**

1、巨额赎回的认定

巨额赎回指在单个开放日内，本基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申

请总份额之余额) 净转出申请 (转出申请总份额扣除转入总份额后的余额) 之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

## 2、巨额赎回的处理

(1) 全额赎回: 当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回时, 按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回: 当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难, 或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时, 基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下, 对其余申请延期办理。对于当日的赎回申请, 应当按单个账户赎回申请量占基金赎回申请总量的比例, 确定当日受理的赎回份额; 未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外, 延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回优先权并将以该开放日的基金份额净值为基准计算, 以此类推, 直到全部完成赎回申请为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时, 基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告, 并说明有关处理办法。

### (3) 巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并部分延期赎回时, 基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告, 并说明有关处理办法。

## 3、连续巨额赎回的情形及处理方式

基金连续两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; 已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项, 但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日, 并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

### (十三) 与暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项相关的公告

发生上述暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项情况的, 基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

若发生暂停的时间为一天, 第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

若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 1 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告, 并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

若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; 当连续暂停时间超过两个月时, 可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结

束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## 十一、基金份额的非交易过户和基金间转换

### (一) 基金份额的非交易过户

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法执行情况下的非交易过户。其中,“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;“捐赠”只受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形;“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供相关资料。

### (二) 基金间的份额转换

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工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2工作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工作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工作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

**A、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:**

- ①因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的转入申请;
- ②证券交易场所交易时间临时停市;
- ③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;
- ④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;

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转入;

⑥法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

**B、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:**

- ①因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项;
- ②证券交易场所交易时间临时停市;
- ③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;
- ④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;
- ⑤法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

**C、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。

## 十二、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### (一) 基金份额的登记

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。

### (二) 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、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，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、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。

### (三) 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公司的相关规定办理。

3、跨系统转登记限于在已注册的开放式基金账户和其证券账户之间进行。

4、基金份额的跨系统转登记需要两个交易日的交易时间，即持有人 T 日提交跨系统转登记申请，如处理成功，经过两个工作日（T+2 日）可申请赎回或卖出。

5、暂停跨系统转登记的情形

(1) 本基金合同生效日至开放申购赎回日期间。

(2) 本基金收益分配期间（R-2 日至 R 日，R 日为权益登记日）。

(3) 处于冻结状态的基金份额。

## 十三、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力

争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

## （二）投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以运用衍生金融产品进行风险管理。

## （三）投资理念

本基金以拟合、跟踪沪深 300 指数为原则，进行被动式指数化投资，力求获得该指数所代表的中国证券市场的平均收益率，为投资者提供一个投资沪深 300 指数的有效投资工具。

本基金认为，中国经济将保持持续、稳定、快速发展，为中国证券市场的长期发展奠定了扎实的宏观经济基础。沪深 300 指数可以充分代表中国证券市场，本基金通过指数化投资方式投资于沪深 300 指数成份股票，为投资者分享中国经济增长的成果提供了一个有效的投资工具。

## （四）业绩衡量基准

本基金以沪深 300 指数为标的指数，业绩衡量基准为 95% 的沪深 300 指数增长率加 5% 的银行同业存款收益率。本基金原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，选用以上业绩衡量基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同开发的中国 A 股市场指数，它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数，流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的标的指数。

### 1、沪深 300 指数的选股原则

#### （1）选样空间

A、上市时间一般不少于一个季度，除非该股票上市以来日均总市值在全部沪深 A 股中排在前三十位；

B、非 ST、\*ST 股票，非暂停上市股票；

C、公司经营状况良好，最近一年无重大违法违规事件、财务报告无重大问题；

D、股票价格无明显的异常波动或市场操纵；

E、剔除其他经专家委员会认定的不能进入指数的股票

#### (2) 选样标准

选取规模大、流动性好的股票作为样本股。

#### (3) 选样方法

对样本空间股票在最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 50% 的股票，然后对剩余股票按照日均总市值由高到低排名，选取排名在前 300 的股票作为样本股。

### 2、沪深 300 指数的计算方法

指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点。指数计算以调整股本为权重，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。其中，调整股本根据分级靠档方法获得。分级靠档方法如下表所示：

流通比例 (%)	≤10	(10, 20]	(20, 30]	(30, 40]	(40, 50]	(50, 60]	(60, 70]	(70, 80]	>80
加权比例 (%)	自由流通比例	20	30	40	50	60	70	80	100

举例如下：某股票自由流通比例为 7%，低于 10%，则采用自由流通股本为权数；某股票自由流通比例为 35%，落在区间 (30, 40] 内，对应的加权比例为 40%，则将总股本的 40% 作为权数。

注：自由流通比例是指公司总股本中剔除以下基本不流通的股份后的股本比例：①公司创建者、家族和高级管理者长期持有的股份；②国有股；③战略投资者持股；④冻结股份；⑤受限的员工持股；⑥交叉持股等。

### 3、成份股的定期调整

(1) 原则上指数成份股原则每半年进行一次调整，一般为 1 月初和 7 月初实施调整，提前两周公布调整方案。

(2) 每次调整的比例定为不超过 10%。样本调整设置缓冲区，排名在 240 名的新样本优先进入，排名在 360 名之前的老样本优先保留。

(3) 最近一次财务报告亏损的股票原则上不进入新选样本，除非该股票影响指数的代表性。

(4) 定期调整时设置备选名单，以用于样本股的临时调整。当指数因为样本退市、合

并等原因出现样本空缺或需要临时更换样本时,依次选择备选名单中排名最靠前的股票作为样本股。备选名单中股票数量一般为指数样本数量的 5%,当备选名单中股票数量使用过半时,将补充新名单。沪深 300 指数设置 15 只股票的备选名单。

#### 4、临时调整

(1) 对符合样本空间条件、且总市值(不含境外上市股份)排名在沪深市场前10位的新发行股票,启用快速进入指数的规则,即在其上市第十个交易日结束后进入指数,同时剔除原指数样本中最近一年日均总市值排名最末的股票。

(2) 当新发行股票符合快速进入指数的条件,但上市时间距下一次样本股定期调整生效日不足20个交易日时,不启用快速进入指数的规则,与定期调整一并实施。

(3) 对于增发、重组和合并等行为导致股票总市值增加,符合上述快速进入条件的,处理方式和新发行股票一致;

(4) 两家或多家成份股合并,合并后的新公司股票保留成份股资格,产生的样本股空缺由备选名单中排名最高的股票填补。原成份股保留在指数中至新公司股票进入指数止。

(5) 一家成份股公司合并另一家非成份股公司,合并后的新公司股票保留成份股资格。原成份股保留在指数中至新公司股票进入指数止。

(6) 一家非成份股公司收购或接管另一家成份股公司,自该成份股退市日起,由备选名单上排名最高的公司股票作为指数样本;如果合并后的新公司股票排名高于备选名单上排名最高的公司股票,则新公司股票成为指数样本,原成份股保留在指数中至新公司股票进入指数止。

(7) 一家成份股公司分拆为两家或多家公司,分拆后形成的公司能否作为指数样本视这些公司的排名而定。

①如果分拆后形成的公司股票排名都高于原成份股中排名最低的股票,分拆后形成的公司股票全部作为新样本进入指数,原成份股中排名最低的股票被剔除以保持指数样本数量不变。分拆后形成的公司股票于上市第二日计入指数,原被分拆公司股票保留在指数中至新样本进入指数止。

②如果分拆后形成的公司中部分公司股票排名高于原成份股中排名最低的股票,则这些公司股票作为新样本进入指数。新样本于上市第二日计入指数,原被分拆公司股票保留在指数中至新样本进入指数止。

③如果分拆后形成的公司股票全部低于原成份股中排名最低的股票,但全部或部分公司股票高于备选名单中排名最高的股票,则分拆形成的公司股票中排名最高的股票替代被分拆

公司作为新样本进入指数。新样本于上市第二日计入指数,原被分拆公司股票保留在指数中至新样本进入指数止。

④如果分拆后形成的公司股票全部低于原成份中排名最低的股票,同时低于备选名单上排名最高的股票,则备选名单上排名最高的股票作为指数样本。自原被分拆成份股退市之日起,备选名单排名最高的公司股票计入指数。

(8) 如果成份股公司申请破产,尽快将其从指数中删除,产生的样本股空缺由备选名单中排名最高的股票填补。

(9) 当样本股公司退市或暂停上市时,自退市或暂停上市之日起,将其从指数样本中剔除,由备选样本中排名最高的股票替代。

## 5、指数的发布

沪深 300 指数在交易时间内通过行情系统实时对外发布,收市指数在每个交易日收市后通过中国证监会指定信息披露报刊和其他新闻媒体对外发布。

如果沪深 300 指数被停止发布或由其他指数替代或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下,本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则,变更基金的标的指数和投资对象。本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象,不需召开基金份额持有人大会通过,但应报中国证监会,并在中国证监会指定的媒体上公告。

### (五) 投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓期为 3 个月,3 个月之后本基金投资组合将达到基金合同的相关规定。

#### 1、资产配置比例

本基金原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股,其中备选成份股投资比例不高于 15%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

#### 2、股票组合构建

##### (1) 股票投资原则

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据沪深 300 指数成份股的基准

权重构造股票指数化投资组合。

### (2) 股票组合构建方法

本基金原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建股票投资组合。如有(a)因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依指数权重购买某成份股,或(b)预期标的指数的成份股即将调整,或(c)其他影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,结合经验判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近标的指数的收益率。

### (3) 风险收益目标

本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资,在日常管理过程中,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%,以实现对标指数的有效跟踪,分享中国股票市场的长期收益。

## (六) 投资组合比例调整

### 1、定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

### 2、不定期调整

A、当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B、根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

C、根据法律、法规的规定,成份股在标的指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

## (七) 风险收益特征

风险中等,获得证券市场平均收益率。

## (八) 投资禁止行为与限制

1、基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (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,但是国务院另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、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其基金管理人、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) 依照法律行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；

## 2、本基金投资组合比例限制

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

(2) 股票、债券和现金的投资比例不得违反本基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定；

(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 3 个月内达到规定的标准。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

### (九) 基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

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、有利于基金财产的安全与增值；

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，保护基金投资者的利益。

### (十) 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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年1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12月31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	24,712,789,329.06	94.71

	其中：股票	24,712,789,329.06	94.71
2	固定收益投资	1,002,841,000.00	3.84
	其中：债券	1,002,841,000.00	3.84
	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	328,111,957.24	1.26
6	其他资产	50,238,217.93	0.19
7	合计	26,093,980,504.23	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	167,999,740.70	0.65
B	采掘业	2,693,696,600.40	10.34
C	制造业	8,689,777,043.32	33.36
C0	食品、饮料	1,831,872,996.74	7.03
C1	纺织、服装、皮毛	87,124,081.98	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	488,868,066.95	1.88
C5	电子	253,284,796.57	0.97
C6	金属、非金属	1,984,959,591.79	7.62
C7	机械、设备、仪表	2,859,167,876.29	10.98
C8	医药、生物制品	1,174,644,515.40	4.51
C99	其他制造业	9,855,117.60	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	615,167,567.49	2.36
E	建筑业	664,873,035.85	2.55
F	交通运输、仓储业	761,752,497.16	2.92
G	信息技术业	904,992,908.17	3.47
H	批发和零售贸易	657,204,487.35	2.52
I	金融、保险业	7,657,901,926.53	29.40
J	房地产业	1,161,979,717.66	4.46
K	社会服务业	208,699,377.22	0.80
L	传播与文化产业	54,467,821.47	0.21
M	综合类	452,940,605.74	1.74
	合计	24,691,453,329.06	94.80



## (2) 报告期末积极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	-	-
C	制造业	21,336,000.00	0.08
C0	食品、饮料	21,336,000.00	0.08
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	21,336,000.00	0.08

## 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	67,667,334	803,211,254.58	3.08
2	600016	民生银行	123,597,534	727,989,475.26	2.80
3	601318	中国平安	18,333,520	631,406,428.80	2.42
4	601328	交通银行	125,286,985	561,285,692.80	2.15
5	600000	浦发银行	61,242,110	519,945,513.90	2.00
6	601166	兴业银行	41,315,666	517,272,138.32	1.99
7	601398	工商银行	109,976,991	466,302,441.84	1.79
8	601088	中国神华	18,047,465	457,142,288.45	1.76
9	600519	贵州茅台	2,272,251	439,226,118.30	1.69
10	000002	万科A	52,969,558	395,682,598.26	1.52

注：根据本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法。原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%。

## (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

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	002646	青青稞酒	1,200,000	21,336,000.00	0.08

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只积极投资的股票。

## 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	70,205,000.00	0.27
2	央行票据	832,176,000.00	3.20
3	金融债券	100,460,000.00	0.39
	其中：政策性金融债	100,460,000.00	0.39
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	1,002,841,000.00	3.85

## 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	1101018	11 央行票据 18	3,300,000	319,506,000.00	1.23
2	1101022	11 央行票据 22	1,700,000	164,458,000.00	0.63
3	1101030	11 央行票据 30	1,600,000	154,768,000.00	0.59
4	110249	11 国开 49	1,000,000	100,460,000.00	0.39
5	1101050	11 央行票据 50	900,000	86,958,000.00	0.33

## 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	1,637,031.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,648,646.89
5	应收申购款	26,952,539.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,238,217.93

### (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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002646	青青稞酒	21,336,000.00	0.08	ipo 网下锁定三个月

## 十四、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年12月31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。

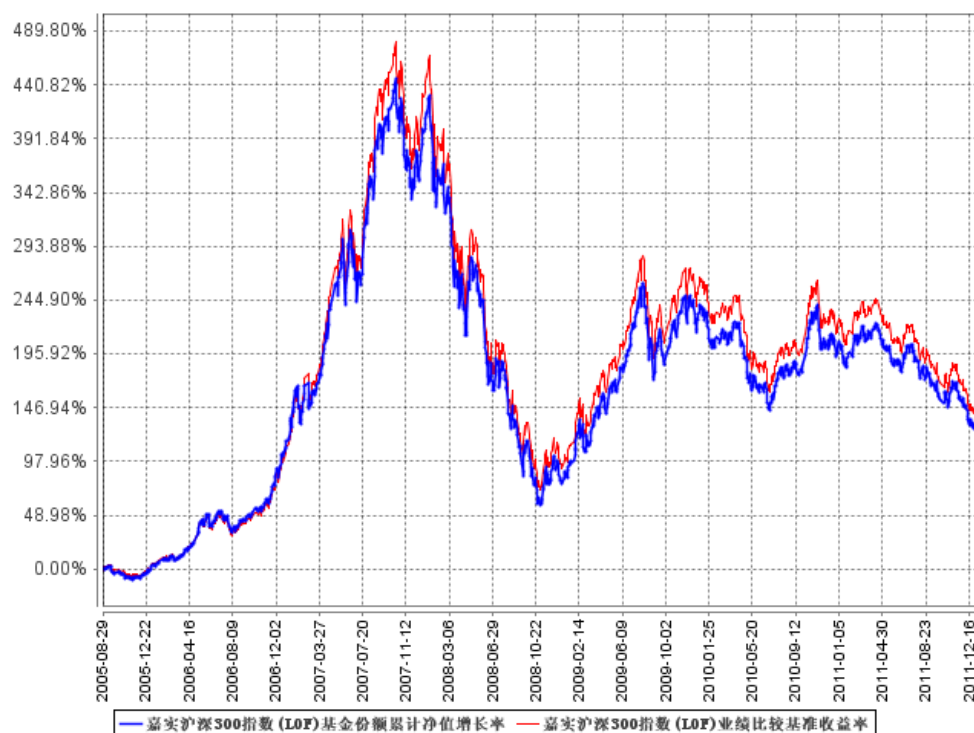
### (一) 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2005年8月29日基金合同生效日至2005年12月31日	-1.90%	0.82%	-0.48%	0.89%	-1.42%	-0.07%
2006年年度	120.19%	1.32%	112.79%	1.33%	7.40%	-0.01%

2007 年年度	130.32%	2.18%	150.20%	2.18%	-19.88%	0.00%
2008 年年度	-64.36%	2.92%	-63.85%	2.89%	-0.51%	0.03%
2009 年年度	91.97%	1.95%	90.72%	1.95%	1.25%	0.00%
2010 年年度	-11.45%	1.50%	-11.77%	1.50%	0.32%	0.00%
2011 年年度	-22.95%	1.23%	-23.82%	1.23%	0.87%	0.00%

(二) 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

嘉实沪深300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：嘉实沪深300指数 (LOF) 累计份额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  
(2005年8月29日至2011年12月31日)

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效起 3 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第十七条（（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制）的规定：（1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；（2）原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。（3）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

## 十五、基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

## 十六、基金的财产

### (一) 基金财产的构成

基金财产是由基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项和其它投资构成。

### (二) 基金资产总值

基金资产总值是指基金购买的各类证券价值、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；
- 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、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是指开放日闭市之后基金资产净值除以当日基金份额而得到的金额。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金托管人名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券账户、以基金的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会及人民银行备案。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、注册登记人自有的资产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的保管与处分

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有资产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有资产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的资产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算资产。非因基金财产本身承

担的债务，不得对基金财产强制执行。

基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。

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。

## 十七、基金资产估值

(注：本节“基金资产估值”为本基金实施《企业会计准则》后调整的基金估值方法和会计政策。参见 2007 年 9 月 28 日本基金管理人发布的《关于调整旗下证券投资基金估值方法和会计政策的公告》)

### (一) 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### (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

基金所持有的金融资产和金融负债。

### (四) 估值方法

#### 1、股票估值方法

##### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一种股票的收盘价估值；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。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

### (3) 有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在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) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(6) 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。

## 3、权证估值

### (1) 配股权证的估值

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

### (2) 认沽/认购权证的估值

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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。未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股

权, 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

#### 4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下, 基金管理人采用上述 1-4 项规定的方法对基金财产进行估值, 均应当被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人具有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后, 将估值结果以书面形式报给基金托管人, 基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核, 基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人, 由基金管理人对外公布。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。

#### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易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、基金托管人无法准确评估基金财产价值时;
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### (七) 基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人进行复核。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净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人, 由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。(参见 2010 年 3 月 23 日本基金管理人发布的《关于嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额净值计算位数变更的公告》)

#### (八) 估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位 (含第四位) 内发生差错时, 视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 并采取合理的措施防



止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 5 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十八、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、因运用基金财产带来的成本或费用的节约；
- 5、已实现的其他合法收入。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）基金收益分配原则

- 1、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、场外投资者可以选择现金分红或红利再投资，场内投资者只能选择现金分红，本基金分红的默认方式为现金分红；
- 3、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配四次。全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

7、每一基金份额享有同等分配权。

#### **(四) 基金收益分配方案**

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### **(五) 基金收益分配方案的确定与公告**

基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

#### **(六) 收益分配中发生的费用**

- 1、收益分配中采用红利再投资方式的免收再投资的费用；
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

### **十九、基金的费用与税收**

#### **(一) 与基金运作有关的费用**

1、与基金运作有关的费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金管理费年费率为 0.5%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理人的管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从本基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### (2) 基金托管人的托管费

本基金托管费年费率为 0.1%, 在通常情况下, 按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率, 计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H: 为每日应支付的基金托管费;

E: 为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3) 上述 (一) 基金费用第 (3) — (8) 项费用, 除上款规定的费用外, 由基金托管人根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额, 从当期基金财产中支付。

(4) 基金首次发行中所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支, 不另从基金财产中支付, 与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支; 若本基金发行失败, 发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

### 3、不列入基金费用的项目

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本基金财产的损失, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费, 下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、基金认购费用

#### (1) 场内认购费用

认购费用用于本基金直接发售和代理发售时发生的开支, 包括市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用, 不列入基金资产。

#### (2) 场外认购费用

投资人在募集期内可以多次认购基金份额, 但认购资金一旦交付, 撤销申请不予接受。本基金份额的面值为人民币一元, 按面值发售, 投资人认购采用全额缴款的认购方式。本基金对认购设置级差费率, 认购费率随认购金额的增加而递减, 最高认购费率不超过 1.0%。

## 2、申购费

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减：

申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 50 万元	1.5%
50 万元 ≤ M < 200 万元	1.2%
200 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔

## 3、赎回费

(1) 本基金场内的赎回费率统一为 0.5%；本基金场外赎回费率不高于 0.5%，随在开放式基金账户中的持有期限的增加而递减：

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.5%
一年 ≤ 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

注：就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

(2) 本基金收取的赎回费中 25% 的部分归入基金财产。

## 4、转换费

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 ≥ 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。

### (三) 其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用,以及因故与本基金有关的其他费用,将依照国家法律法规的规定,予以收取和使用。

(四) 本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 二十、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,基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计,但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务;

2、基金的会计年度为公历每年 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计算:若基金合同生效少于 3 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的会计制度;

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) 基金审计

1、本基金管理人聘请具有证券业从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师须与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,须事先征得基金管理人和基金托管人同意。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,须经基金托管人(或基金管理人)同意,在两日内编制更换会计师事务所报告书,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中国证监会派出机构备案。

## 二十一、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《业务规则》、基

金合同及其他有关规定。本基金信息披露事项应当在中国证监会规定时间内,通过指定报刊和网站等媒介披露,并保证投资人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。

公开披露的基金信息包括:

(一) 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,基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前,将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

基金合同生效后,基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内,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报刊上。

(二) 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报刊和网站上。

(三) 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报刊和网站上登载基金合同生效公告。

(四) 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(五) 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。

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日,将前日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(六) 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,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(七) 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九十日内,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报刊上。

基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,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报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的,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。

《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。

#### (八) 临时报告

基金发生重大事件,即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事件,有关信息披露义务人应当在两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中国证监会派出机构备案。重大事件包括:

- 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、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、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。

#### (九) 基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前三十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。

#### (十) 澄清公告

在基金合同期限内，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、基金上市交易的证券交易所。

#### (十一) 中国证监会规定的其他信息。

(十二) 本基金在条件成熟的情况下，为了方便投资者交易本基金，可以增加信息披露的范围。

#### (十三) 信息披露文件的存放与查阅

本基金《招募说明书》(包括更新的招募说明书)、基金合同、年度报告、半年度报告、季度报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金代销机构的办公场所和营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易



所,供公众查阅、复制。

投资人也可直接登录基金管理人网站([www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn))查阅信息披露文件。

投资者按上述方式所获得的文件及其复印件,基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十二、风险揭示

本基金主要面临的风险有:与基准指数偏离的跟踪误差风险,流动性风险,市场风险(系统风险),操作风险、技术风险及合规性风险等。

### (一) 与业绩基准偏离的风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪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 0.3%以内。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、标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为;
- 2、标的指数成份股的调整;
- 3、基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击;
- 4、申购、赎回因素带来的跟踪误差;
- 5、新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差;
- 6、基金现金资产的拖累;
- 7、基金的管理费和托管费带来的跟踪误差;
- 8、指数成份股停牌、摘牌,成份股涨、跌停板等因素带来的偏差;
- 9、由于缺少衍生金融工具,基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差;
- 10、其他因素带来的偏差。

### (二) 流动性风险

#### 1、成份股的流动性风险

虽然本基金的业绩基准指数中成份股的流动性相对来说都比较高,但仍不排除可能面临交易量不足所引起的流动性风险,进而影响基金管理人把申购资金及时转化为投资组合和将赎回所需的现金直接变现,以及影响到因标的指数成份股的调整而带来的基金投资组合的调整。

#### 2、本基金在二级市场的流动性风险

本基金作为上市开放式基金,可以在二级市场挂牌交易,因此也可能面临因市场交易量

不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

### **(三) 市场风险**

市场风险是指证券市场价格因受各种因素（如政策因素、经济周期波动、利率因素、投资者心理等）的影响而引起的波动，对本基金资产产生潜在风险。本基金作为指数基金，基金收益率的变动与标的指数的变动高度一致，当标的指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金净值相应下跌的风险。

### **(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) 操作风险**

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

### **(六) 技术系统风险**

在基金的申购赎回过程中、各种交易行为或者后台运作中，可能因为软件系统和硬件系统故障而影响申购、赎回和交易的正常进行，从而导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、托管银行、注册登记机构、证券交易所等。

### **(七) 网络安全风险**

指数据在传递过程中，因通讯故障造成的数据丢失，或因非法入侵等网络安全问题引起的数据被篡改等，从而造成不能正常交易、不能正常交收的风险。

### **(八) 合规性风险**

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

### **(九) 不可抗力风险**

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

### **(十) 投资者认知风险**

可能存在由于投资者对本产品缺乏足够的认知和了解而造成的投资偏离预期的风险。

### **(十一) 其他风险**

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

## 二十三、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、本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意；

2、变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会批准，自批准之日起生效。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变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，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变更后公布，并报中国证监会备案。

3、以下基金合同变更事项需召开基金份额持有人大会：

- (1) 提前终止基金合同；
- (2) 基金扩募或者延长基金合同期限；
- (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；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 基金合同约定的其他事项。

### (二) 基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

- (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，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- (4) 基金合同约定的其他情形；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照本基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

### (三) 基金财产的清算

1、清算小组

(1) 自基金合同终止之日起三十个工作日内成立基金财产清算小组, 清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 清算小组成员由基金管理人、基金托管人、注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

## 2、清算程序

- (1) 基金合同终止后, 由清算小组统一接管基金财产;
- (2) 清算小组对基金财产进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估价;
- (4) 对基金财产进行变现;
- (5) 聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书;
- (6) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (7) 公布基金清算公告;
- (8) 进行基金剩余资产的分配。

## 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由清算小组从基金财产中支付。

## 4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5、基金清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由清算小组公告。

## 6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人权利与义务

## 1、基金份额持有人的权利

- (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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照法律法规和基金合同规定的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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为要求赔偿或依法提起诉讼;
- (9) 获取基金业务及财务状况的公开资料;
- (10) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同及相关业务规则;
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回等事宜涉及的款项, 承担规定的费用;
- (3) 在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、基金份额持有人及其他基金当事人合法权益的活动;
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- (6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### (二) 基金管理人的权利与义务

#### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金, 办理基金备案手续;
- (2) 自本基金合同生效之日起, 依法并依照基金合同的规定独立运用基金财产;
- (3) 依据有关法律规定及本基金合同决定基金收益分配方案;
- (4) 根据基金合同的规定, 获取基金管理费及其他约定和法定的收入;
- (5) 在符合有关法律法规的前提下, 并经中国证监会批准后, 制订和调整开放式基金业务规则, 决定本基金的相关费率结构和收费方式;
- (6) 销售基金份额, 获取认 (申) 购费;

- (7) 选择和更换代销机构, 并对其销售代理行为进行必要的监督;
- (8) 依照有关法律法规, 代表基金行使因运营基金财产而产生的股权、债权及其他权利;
- (9) 担任注册登记人或选择和更换注册登记代理机构, 并对其注册登记代理行为进行必要的监督;
- (10) 基金合同规定的情形出现时, 决定暂停或拒绝受理基金份额的申购、暂停受理基金份额的赎回申请或延缓支付赎回款项;
- (11) 监督基金托管人, 如认为基金托管人违反基金合同或有关法律法规的规定, 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;
- (12) 以自身名义, 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;
- (13) 召集基金份额持有人大会;
- (14) 在更换基金托管人时, 提名新任基金托管人;
- (15) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金, 办理基金备案手续;
- (2) 遵守基金合同;
- (3) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- (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) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回及其他业务或委托其他机构代理这些业务;
- (6) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册登记工作或委托其他机构代理该项业务;
- (7) 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;
- (8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得以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;
- (9) 依法接受基金托管人的监督;
- (10) 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值;

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

(12) 严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、和本基金合同及其他有关规定,受理并办理申购、赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(13) 严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》和本基金合同及其他有关规定履行信息披露及报告义务;

(14) 保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;

(15) 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收益;

(16) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(17) 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;

(18) 编制基金的财务会计报告;保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;

(19) 确保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或招募说明书公告的时间和方式查阅与基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;

(20) 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;

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

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

(23) 因估值错误导致基金持有人的损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(24) 基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时,应代表基金向基金托管人追偿;

(25) 为基金聘请会计师和律师;

(26) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(27) 以基金管理人名义代表基金份额持有人利益行使诉讼权及其他权力;

(28) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

(29) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

## 1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金财产；
- (2) 获取基金托管费；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 监督基金管理人，如认为基金管理人违反基金合同或有关法律法规的规定，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；
- (5) 在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；
- (6) 提议召开基金份额持有人大会；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (3) 设有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；
- (4) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定外，不得委托其他人托管基金财产；
- (5) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；
- (6) 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资产以及不同的基金财产相互独立；对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账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (7) 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；
- (8) 设立证券账户、银行存款账户等基金财产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；
- (9) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《运作办法》、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；
- (10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；
- (11) 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额认购、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；

(13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资符合基金合同等法律文件的规定；

(14) 在基金定期报告内出具基金托管人意见，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；

(15) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录、基金份额持有人名册等 15 年以上；

(16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(17) 依据基金管理人的指令或有关规定支付基金份额持有人的收益和赎回款项；

(18) 参加基金清算小组，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、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失，承担赔偿责任，其违反基金合同责任不因其退任而免除；

(21) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(22) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(23) 监督基金管理人的投资运作；

(24) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合召开基金份额持有人大会；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(26) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

##### **1、召开原则**

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合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。上述通过事项如无需监管部门批准，则即刻生效；需监管部门批准的，在获得相关批准后生效。

##### **2、召开事由**

在本基金需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 修改基金合同。但本基金合同另有规定或根据法律法规变更做出相应更改的除外；

- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 决定终止基金合同;
- (5) 与其他基金合并;
- (6) 持有本基金百分之十或以上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) 提议召开基金份额持有人大会;
- (7) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (8) 转换基金运作方式;
- (9) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- (10) 变更基金类别;
- (11) 变更基金的投资目标、投资范围或投资策略;
- (12) 法律、法规或中国证监会规定的其他情形。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同, 不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- (2) 调低基金管理费、基金托管费;
- (3) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系的变化;
- (5) 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;
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 在正常情况下, 基金份额持有人大会由基金管理人召集, 基金份额持有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定;

(2) 在更换基金管理人或基金管理人未行使召集权的情况下, 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十日内决定是否召集, 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六十日内召开; 基金管理人决定不

召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集。

(4) 在基金管理人和基金托管人均未行使召集权的情况下, 单独或合计持有权益登记日百分之十或以上份额的基金份额持有人有权自行召集; 若就同一事项出现若干个基金份额持有人提案, 则由提出该等提案的基金份额持有人共同推选出代表召集持有人大会。

(5) 代表基金份额百分之十或以上的基金份额持有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十日内决定是否召集, 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六十日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额百分之十或以上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十日内决定是否召集, 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六十日内召开。

(6) 基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的, 基金份额持有人可以按照《证券投资基金法》第七十二条第二款的规定自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的, 应当至少提前三十日向中国证监会备案。

(7) 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。

#### 4、通知

召开基金份额持有人大会, 召集人应在会议召开前至少三十日, 在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容:

- (1) 会议召开的时间、地点和方式;
- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 会议的议事程序;
- (4) 会议的表决方式;
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- (6) 代理投票授权委托书送达时间和地点;
- (7) 会务常设联系人姓名、电话;
- (8) 召集人需要通知的其他事项。

若采取通讯等方式开会并进行表决,会议通知中还应说明本次基金份额持有人大会所采取的具体方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见的寄交和收取方式。

## 5、召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开,也可以采取通讯等方式召开。会议的召开方式由召集人确定。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上基金份额的持有人参加方可召开,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。

(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。

亲自出席会议者应持有基金份额的凭证,受托出席会议者应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应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

(2) 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

i、召集人应按本基金合同规定公告会议通知;

ii、召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)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;

iii. 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,提交的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应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

## 6、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,如决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前三十日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少有三十日的间隔期。

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百分之十或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。

对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

i. 关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

ii. 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

## (2) 议事程序

### i. 现场开会

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；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上（不含百分之五十）多数选举产生一名基金份额持有人或其代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（八）款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。

### ii. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前三十日公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 7、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

i. 一般决议，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（不含百分之五十）通过方为有效，除下列 ii 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。

ii. 特别决议，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（不含三分之二）通过方可做出。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金合同、转换基金运作方式等重大事项必须以特别决议通过方为有效，但法律法规、本基金合同另有约定的除外。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时, 除非有充分相反证据证明, 否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

(5) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

i. 如基金份额持有人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, 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;

ii. 计票人应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;

iii. 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑, 可以对所投票数进行重新清点; 如果会议主持人未进行重新清点, 而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议, 其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点, 会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管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, 并在公告基金份额持有人大会决议时, 将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

## 9、生效与公告

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起五日内报中国证监会或其他有权机构核准或者备案, 自其核准之日或相关核准另行确定的日期或出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对基金管理人、基金托管人和全体基金份额持有人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起五个工作日内在至少一种指定媒体公告。法律法规或监管机关对基金份额持有人大会有关事项另有规定的, 从其规定。

### (五) 基金合同的终止和基金财产的清算

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

- (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，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- (4) 基金合同约定的其他情形；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。自基金终止之日，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照本基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；
- (2) 清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价；
- (4) 对基金财产进行变现；
- (5) 聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书
- (6) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (7) 公布基金清算公告；
- (8) 进行基金剩余资产的分配。

#### **(六) 争议的处理**

对于因本协议的订立、内容、履行和解释或与本协议有关的争议，本基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交设在北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

#### **(七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本基金合同可印制成册并对外公开散发，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记人办公场所查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但所载事项应以本基金合同正本为准。

## 二十五、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 (或简称“管理人”)

嘉实基金管理有限公司

#### 2、基金托管人 (或简称“托管人”)

中国银行股份有限公司

### (二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关证券法规的规定, 托管人应对基金管理人就基金财产的投资对象、基金财产的投资组合比例、基金财产的核算、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、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

(1) 基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为, 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及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人违反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。

(2) 基金托管人发现基金管理人的指令违反《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为, 可以拒绝执行, 并通知基金管理人, 向中国证监会报告。

(3) 基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、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, 并及时向中国证监会报告。按照规定监督基金管理人的投资运作。

(4) 如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议, 基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门, 有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施, 以保护基金财产的安全和基金投资者的利益, 包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。



## 2、基金管理人 对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否将基金财产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

(1) 基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。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。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，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并以书面形式对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。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。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### (三) 基金资产的保管

#### 1、基金资产保管的原则

(1) 基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。

基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管基金财产。

(2) 基金托管人应当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; 建立健全内部风险监控制度, 对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督, 防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施 (包括硬件和软件), 并对设备和设施进行维修、维护和更换, 以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据《基金法》、《管理办法》、本《基金合同》及其他有关规定外, 不为自己及任何第三人谋取利益, 基金托管人违反此义务, 利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益, 所得利益归于该基金财产; 基金托管人不得将基金财产转为其固有财产, 不得将固有资产与基金财产进行交易, 或将不同基金财产进行相互交易; 违背此款规定的, 将承担相应的责任, 包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任。

(5) 基金托管人必须将基金财产与自有资产严格分开, 将基金财产与其托管的其他基金财产严格分开; 基金托管人应当为基金设立独立的账户, 建立独立的账簿, 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。

(6) 除依据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金财产;

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金财产; 未经基金管理人的正当指令, 不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## 2、基金合同生效时募集资金的验证和入账

(1) 基金募集期满或基金宣布停止募集时, 由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资, 并分别出具验资报告, 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。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入基金托管人基金银行账户中, 并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴, 由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动, 包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款, 均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 本基金银行账户的开立和使用, 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。

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

#### 4、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金, 以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本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另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户; 亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户, 用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金、结算互保基金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理, 而不同于上述关于账户开设、使用的规定。

(5) 在本托管协议订立日之后, 本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的, 涉及相关账户的开设、使用的, 若无相关规定, 则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、国债托管专户的开设和管理

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账户, 并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后, 由基金托管人负责向中国银监会进行报备。

#### 6、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库, 但要与非本基金的其他实物证券分开保管; 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的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。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。

#### 7、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由基金托管人保管。

#### (四) 基金资产的财务处理

##### 1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应每工作日对基金财产估值。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资产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结束后计算得出当日的该基金份额资产净值,并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人;如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异,且双方经协商未能达成一致,基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布,基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

##### 2、基金账册的建账和对账

(1) 基金管理人和基金托管人在本基金《基金合同》生效后,应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册,对双方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金财产的安全。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。

(2) 双方应每日核对账目,如发现双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,保证双方平行登录的账册记录完全相符。

##### 3、基金财务报表与报告的编制和复核

(1) 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 日内完成;招募说明书在本基金《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次,于该等期间届满后 1 个月内公告;季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起十五个工作日内予以公告;半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告;年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

(2) 基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供相应的基金托管人复核;基金托管人在收到后应立即进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度

报告完成当日, 将有关报告提供给基金托管人复核, 基金托管人应在收到后 5 日内完成复核, 并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日, 将有关报告提供给基金托管人复核, 基金托管人应在收到后 10 日内完成复核, 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, 基金托管人应在收到后 15 日内完成复核, 并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

(3) 基金托管人在复核过程中, 发现双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, 调整以双方认可的账务处理方式为准; 若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后, 基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书, 双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之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。

#### **(五) 基金份额持有人名册的保管**

基金份额持有人名册, 包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每半年最后一个交易日的基金份额持有人名册, 应当根据有关法律法规的规定妥善保管之。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的, 基金管理人(注册登记人)应当提供任何必要的协助。

#### **(六) 适用法律与争议解决**

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决, 但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的, 则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会, 根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外, 各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间, 双方当事人应恪守基金/基金管理人和基金/基金托管人职责, 各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务, 维护各基金份额持有人的合法权益。

#### **(七) 托管协议的修改与终止**

1、本协议双方当事人经协商一致, 可以对协议进行修改。修改后的新协议, 其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议, 报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 基金或《基金合同》终止；
- (2) 本基金更换基金托管人；
- (3) 本基金更换基金管理人；
- (4) 发生《基金法》、《管理办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十六、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，有权增加和修改以下服务项目：

### (一) 持有人交易资料的寄送服务

#### 1、场外投资者

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定制纸质对账单的投资者寄送季度对账单。

#### 2、场内投资者

每次交易结束后，可在 T+1 个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) 红利再投资服务

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除息日的基金份额净值自动转为本基金份额，并免收申购费用。

### (三) 定期定额投资计划

本基金从 2006 年 1 月 9 日开始正式推出定期定额投资业务。投资者可与中国银行、中国工商银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行等代销机构就本基金申请开办“定期定额投资业务”约定每期固定申购金额。具体受理网点见相应代销机构各分支机构的公告。

### (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短信服务。基金份额持有人可通过拨打客户服务电话 400-600-8800(免长途费)、(010) 85712266，也可通过基金管理人网站定制短信服务。

## （五）在线服务

通过登录基金管理人网站，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址实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### 2、信息资讯服务

投资者或基金份额持有人可以利用基金管理人网址获取基金和基金管理人各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等最新资料。

### 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、顺德农商银行社借记卡、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、中国民生银行借记卡、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(免长途费)、(010)85712266，或传真 (010) 65182266。

### 2、互联网站

网址：<http://www.jsfund.cn>

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

## 二十七、其它应披露事项

自 2011 年 8 月 29 日至 2012 年 2 月 29 日, 本基金的临时报告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

序号	公告事项	法定披露日期	备注
1	关于对中国农业银行借记卡持卡人开展嘉实基金网上直销交易费率优惠的公告	2011 年 9 月 1 日	含本基金
2	关于增加温州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2011 年 11 月 2 日	含本基金
3	关于直销网上交易系统开通智能交易及定投业务升级的公告	2011 年 11 月 8 日	含本基金
4	关于旗下开放式基金通过中信万通证券开办定投业务的公告	2011 年 12 月 7 日	含本基金
5	关于变更开放式基金业务规则的公告	2011 年 12 月 9 日	含本基金
6	关于旗下基金直销账户中国银行有关信息变更的公告	2011 年 12 月 16 日	含本基金
7	关于增加华夏银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2011 年 12 月 26 日	含本基金
8	关于增加财富里昂证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2012 年 1 月 7 日	含本基金
9	关于嘉实直销网上交易有关建行卡功能升级和申购费率优惠调整的公告	2012 年 1 月 12 日	含本基金
10	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	2012 年 1 月 12 日	含本基金
11	嘉实基金管理有限公司关于住所变更的公告	2012 年 1 月 12 日	
12	关于嘉实旗下开放式基金通过华夏银行开办定投业务及其费率优惠的公告	2012 年 2 月 21 日	含本基金

## 二十八、招募说明书的存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记人的办公场所, 投资者可在办公时间免费查阅; 也可按工本费购买基金招募说明书复制件或复印件, 但应以基金招募说明书正本为准。

## 二十九、备查文件目录

- (一) 中国证监会批准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的文件
- (二) 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同



(三) 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 登记结算服务协议

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议

(八) 中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人或/及基金托管人的住所; 投资者如需了解有关详细信息, 可向基金管理人或/及基金托管人申请查阅。

**嘉实基金管理有限公司**

**2012 年 4 月 25 日**