



# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 (LOF) 更新招募说明书

(2016年第2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

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 由嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事宜而来。《关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》经2012年8月6日嘉实沪深300指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会2012年8月21日证监许可 [2012] 1146号文核准。自2012年8月21日起，由《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》生效，原《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

本招募说明书是对原《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。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、本基金的特定风险等等。嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“嘉实沪



深300ETF”)的联接基金，主要通过投资于嘉实沪深300ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与嘉实沪深300指数及嘉实沪深300ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。投资者在投资本基金之前，请仔细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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为2016年8月21日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（未经审计）。



## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人 .....	8
四、基金托管人 .....	17
五、相关服务机构 .....	18
六、基金的历史沿革和存续 .....	39
七、基金份额的交易 .....	40
八、基金份额的申购和赎回 .....	42
九、基金份额的非交易过户和基金间转换 .....	49
十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记 .....	55
十一、基金的投资 .....	55
十二、基金的业绩 .....	65
十三、基金的融资融券和转融通 .....	67
十四、基金的财产 .....	67
十五、基金资产估值 .....	68
十六、基金的收益与分配 .....	72
十七、基金的费用与税收 .....	73
十八、基金的会计与审计 .....	75
十九、基金的信息披露 .....	76
二十、风险揭示 .....	79
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	82
二十二、基金合同的内容摘要 .....	84
二十三、基金托管协议的内容摘要 .....	101
二十四、对基金份额持有人的服务 .....	110
二十五、其它应披露事项 .....	112
二十六、招募说明书的存放及其查阅方式 .....	113
二十七、备查文件目录 .....	113



## 一、绪言

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》)、《公开募集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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》(以下简称“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》)以及基金合同等编写。

本招募说明书阐述了嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 招募说明书》
2	基金合同	指《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》及对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 日由中国证监会公布，于 2004 年 7 月 1 日起实施并于 2014 年 7 月 7 日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订。
5	《销售办法》	指 2011 年 6 月 9 日由中国证监会发布并于同年 10 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
10	原基金	指本基金的前身嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
11	原基金变更	指根据中国证监会核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议生效的文件和相关公告，原基金变更为本基金后涉及的一系列变更
12	中国证监会	指中国证券监督管理委员会
13	中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
14	基金管理人	指嘉实基金管理有限公司
15	基金托管人	指中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）
16	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。
17	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。
18	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。
19	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。
20	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。
21	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。
22	销售机构	指基金管理人及基金代销机构。



23	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。
24	注册登记人	指中国证券登记结算有限责任公司。
25	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。
26	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。
27	基金合同当事人	指受基金合同约束, 根据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。
28	基金投资者	指个人投资者和机构投资者。
29	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。
30	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。
31	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。
32	募集期	指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。
33	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。
34	日/天	指公历日
35	月	指公历月
36	发售	指场外认购和场内认购。
37	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。
38	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。
39	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。
40	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。
41	T+N 日	指自 T 日起第 N 个工作日 (不包含 T 日)。
42	开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。
43	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。
44	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。
45	赎回	指基金份额持有人按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。
46	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。
47	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。
48	《登记结算业务实施细则》	指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订;
49	交易型开放式指数证券投资基金	指《登记结算业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”;
50	标的指数	指中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 指数及其未来可能发生的变更;



51	目标 ETF	另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ETF”），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金以嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实沪深 300ETF”）为目标 ETF；
52	ETF 联接基金	将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，与目标 ETF 的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标 ETF 的 ETF 联接基金；
53	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。
54	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
55	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。
56	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。
57	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。
58	基金资产总值	指基金购买的各类证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和。
59	基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值。
60	基金份额净值	指基金资产净值除以基金份额总数。
61	基金份额价格：	指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；
62	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。
63	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。
64	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	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11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	邓红国
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%，德意志资产管理(亚洲)有限公司30%，立信投资有限责任公司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. 管理基金情况

截止2016年9月19日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、97只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、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300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实优质企业混合、嘉实海外中国混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信





用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券。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

邓红国先生, 董事长, 硕士研究生, 中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长; 中国人民银行国际司、外资金机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员; 中国银监会银行监管三部副主任、四部主任; 中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014 年 12 月 2 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。

高峰先生, 董事, 美国籍, 美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁, 美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加入德意志银行以来, 曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长, 2008 年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。



陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010 年 11 月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

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2月至2000年5月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 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，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

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责任公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005 年 9 月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。



曾宪政先生，监事，法学硕士。1999 年 7 月至 2003 年 10 月就职于首钢集团，2003 年 10 月至 2008 年 6 月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008 年 7 月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

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，历任督察员和公司副总经理。

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。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

何如女士，硕士研究生，10 年证券从业经历。曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，任产品管理部高级产品经理职位，负责指数产品及 ETF 创新产品的设计与开发、指数研究及产品管理工作；2012 年 9 月加入指数投资部，先后担任基金经理助理、基金经理职位，现任指数投资部副总监。2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接基金经理，2014 年 6 月 13 日至今任嘉实中证主要消费 ETF 基金经理，2014 年 6 月 13 日至今任嘉实中证医药卫生 ETF 基金经理，2014 年 6 月 20 日至今任嘉实中证金融地产 ETF 基金经理，2015 年 8 月 6 日至今任嘉实中证金融地产 ETF 联接基金经理，2016 年 1 月 5 日任嘉实沪深 300ETF、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接以及本基金基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，11 年证券从业经历。曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资



部，现任公司指数投资部执行总监。2016 年 1 月 5 日任嘉实沪深 300ETF、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接以及本基金基金经理。2016 年 3 月 24 日至今担任嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实中创 400ETF 及嘉实中创 400ETF 联接基金经理。

## (2) 历任基金经理

2005 年 8 月 29 日至 2016 年 1 月 5 日，杨宇先生任本基金基金经理。

## 3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼股票投资业务联席 CIO 邵健先生，公司总经理赵学军先生，股票投资业务联席 CIO 兼研究总监陈少平女士，助理 CIO 兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理邹唯先生、胡涛先生。

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利益；
- (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) 股票投资决策委员会由公司总经理、公司副总经理、总监及资深基金经理组成，负责指导权益类基金资产的运作、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

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：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

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

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

### (三) 证券投资基金托管情况

截至 2016 年 06 月 30 日，中国银行已托管 475 只证券投资基金，其中境内基金 444 只，QDII 基金 31 只，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

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

2007 年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016 年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

#### (五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

### 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	北京市东城区建国门南大街 7 号万豪中心 D 座 12 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵佳		

##### (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 2 期 53 层 09-11 单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	邵琦		

##### (3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司



办公地址	成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	王启明		

## (4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层		
电话	(0755) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	陈寒梦		

## (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) 66777766	传真	(0532) 66777676
联系人	胡洪峰		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 88021391
联系人	王振		

## (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	吴志锋		

## (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	徐莉莉		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120
联系人	周炜		

**2. 代销机构**



## (1) 中国银行股份有限公司

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		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号		
法定代表人	田国立		
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	易会满	联系人	杨菲
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

办公地址	上海市银城中路 188 号		
注册地址	上海市银城中路 188 号		
法定代表人	牛锡明	联系人	张宏革
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	李建红	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

## (7) 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 9 号		
法定代表人	李庆萍	联系人	廉赵峰
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

## (8) 上海浦东发展银行股份有限公司



办公地址	上海市中山东一路 12 号		
注册地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	高天、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

## (9) 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	卞晁煜
电话	(021) 52629999	传真	(021) 62569070
网址	www.cib.com.cn	客服电话	95561

## (10) 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	010-63639709
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595

## (11) 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	洪崎	联系人	杨成茜
电话	(010)58560666	传真	(010)57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

## (12) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街 3 号		
注册地址	北京市西城区金融大街 3 号		
法定代表人	李国华	联系人	王硕
传真	(010) 68858117		
网址	www.psbc.com	客服电话	95580

## (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	谢小华
电话	(010) 66223587	传真	(010) 66226045
网址	www.bankofbeijing.com.cn	客服电话	95526

## (14) 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



## (15) 上海银行股份有限公司

住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号		
法定代表人	金煜	联系人	汤征程
电话	021-68475888	传真	021-68476111
网址	www.bankofshanghai.com	客服电话	95594

## (16) 广发银行股份有限公司

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
网址	www.gdb.com.cn	客服电话	800-830-8003 、 400-830-8003

## (17) 平安银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦		
法定代表人	肖遂宁	联系人	张青
电话	0755-22166118	传真	0755-82080406
网址	www.bank.pingan.com	客服电话	95511-3 或 95501

## (18) 宁波银行股份有限公司

住所、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

## (19) 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	www.czbank.com	客服电话	95527

## (20) 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) 22119061	传真	(0769) 22117730
网址	www.dongguanbank.cn	客服电话	4001196228

## (21) 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
网址	www.hzbank.com.cn	客服电话	400-888-8508

## (22) 温州银行股份有限公司



住所	温州市车站大道华海广场 1 号楼		
办公地址	温州市车站大道 196 号		
法定代表人	邢增福	联系人	林波
电话	(0577) 88990082	传真	(0577) 88995217
网址	www.wzbank.cn	客服电话	(0577) 96699

## (23)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	夏平	联系人	展海军
电话	(025) 58587018	传真	(025) 58587038
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025) 96098、 4008696098

## (24)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	www.uccb.com.cn	客服电话	(0991)96518

## (25)江苏江南农村商业银行股份有限公司

办公地址	常州市和平中路 413 号		
注册地址	常州市和平中路 413 号		
法定代表人	陆向阳	联系人	包静
电话	13951229068	传真	0519-89995170
网址	www.jnbank.com.cn	客服电话	96005

## (26)泉州银行股份有限公司

办公地址	福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
注册地址	福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
法定代表人	傅子能	联系人	董培姗、王燕玲
电话	0595-22551071	传真	0595-22578871
网址	http://www.qzccb.com	客服电话	4008896312

## (27)天相投资顾问有限公司

办公地址	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层		
注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701		
法定代表人	林义相	联系人	尹伶
电话	010-66045529	传真	010-66045518
网址	http://www.jjm.com.cn	客服电话	010-66045678

## (28)和讯信息科技有限公司

办公地址	北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		
注册地址	北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		



法定代表人	王莉	联系人	刁甜
传真	021-20835879		
网址	<a href="http://fund.licaike.com/">http://fund.licaike.com/</a>	客服电话	4009200022

## (29)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼		
注册地址	上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室		
法定代表人	汪静波	联系人	张裕
电话	021-38509735	传真	021-38509777
网址	<a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>	客服电话	400-821-5399

## (30)深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼		
注册地址	深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 II 单元		
法定代表人	薛峰	联系人	童彩平
电话	0755-33227950	传真	0755-33227951
网址	<a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a>	客服电话	4006-788-887

## (31)上海天天基金销售有限责任公司

办公地址	上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼		
注册地址	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层		
法定代表人	其实	联系人	潘世友
电话	021-54509998	传真	021-64385308
网址	<a href="http://www.1234567.com.cn/">http://www.1234567.com.cn/</a>	客服电话	400-1818-188

## (32)上海好买基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室		
注册地址	上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室		
法定代表人	杨文斌	联系人	张茹
电话	021-20613999	传真	021-68596916
网址	<a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>	客服电话	4007009665

## (33)杭州数米基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼		
注册地址	杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号		
法定代表人	陈柏青	联系人	张裕
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	<a href="http://www.fund123.cn/">http://www.fund123.cn/</a>	客服电话	4000-766-123

## (34)上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层		
注册地址	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室		
法定代表人	张跃伟	联系人	单丙焱
电话	021-20691869	传真	021-20691861





网址	www.erichfund.com	客服电话	400-089-1289
----	-------------------	------	--------------

(35)浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼		
注册地址	浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室		
法定代表人	凌顺平	联系人	林海明
传真	0571-86800423		
网址	www.5ifund.com	客服电话	4008-773-772

(36)北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址	北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层		
注册地址	北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号		
法定代表人	闫振杰	联系人	李静如
电话	010-59601366-7024		
网址	www.myfund.com	客服电话	4008886661

(37)上海利得基金销售有限公司

办公地址	上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼		
注册地址	上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室		
法定代表人	沈继伟	联系人	曹怡晨
电话	021-50583533	传真	021-50583633
网址	a.leadfund.com.cn	客服电话	400-067-6266

(38)嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

(39)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

办公地址	北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809		
注册地址	北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809		
法定代表人	沈伟桦	联系人	程刚
电话	010-52855713	传真	010-85894285
网址	www.yixinfund.com	客服电话	400-6099-200

(40)众升财富(北京)基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元		
法定代表人	李招弟	联系人	高晓芳
电话	010-59393923	传真	010-59393074
网址	www.wy-fund.com	客服电话	400-059-8888



## (41)深圳腾元基金销售有限公司

办公地址	广东省深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 室		
注册地址	广东省深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 室		
法定代表人	曾革	联系人	鄢萌莎
电话	0755-33376922	传真	0755-33065516
网址	www.tenyuanfund.com	客服电话	4006877899

## (42)北京广源达信投资管理有限公司

办公地址	北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层		
注册地址	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室		
法定代表人	齐剑辉	联系人	王英俊
电话	010-57298634	传真	010-82055860
网址	www.niuniufund.com	客服电话	4006236060

## (43)上海汇付金融服务有限公司

办公地址	上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼		
注册地址	上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼		
法定代表人	冯修敏	联系人	陈云卉
电话	021-33323998	传真	021-33323837
网址	暂无	客服电话	400-820-2819

## (44)北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址	北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼 2 层		
注册地址	北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼 2 层		
法定代表人	董浩	联系人	姜颖
电话	13522549431	传真	010-65951887
网址	www.jimufund.com	客服电话	400-068-1176

## (45)上海陆金所资产管理有限公司

办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼		
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元		
法定代表人	郭坚	联系人	宁博宇
电话	021-20665952	传真	021-22066653
网址	www.lufunds.com	客服电话	4008219031

## (46)大泰金石投资管理有限公司

办公地址	上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼中心		
注册地址	南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室		
法定代表人	袁顾明	联系人	朱海涛
电话	15921264785	传真	021-20324199
网址	http://www.dtfunds.com	客服电话	400-928-2266



## (47)珠海盈米财富管理有限公司

办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203		
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491		
法定代表人	肖雯	联系人	黄敏嫦
电话	020-89629019	传真	020-89629011
网址	www.yingmi.cn	客服电话	020-89629066

## (48)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

办公地址	北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层		
注册地址	北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室		
法定代表人	彭运年	联系人	仲甜甜
电话	010-59336492	传真	010-59336510
网址	www.jnlc.com/	客服电话	010-59336512

## (49)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		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
法定代表人	杨德红	联系人	芮敏祺
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

## (50)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
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

## (51)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	周杨
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

## (52)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

## (53)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	孙树明	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

(54) 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	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

(55) 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	陈有安	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

(56) 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

(57) 申万宏源证券有限公司

住所、办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
法定代表人	李梅	联系人	钱达琛
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	www.swhysc.com	客服电话	021-962505

(58) 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

(59) 华泰证券股份有限公司

办公地址	江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场		
注册地址	江苏省南京市江东中路 228 号		



法定代表人	周易	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	0755-82492962(深圳)
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

(60)中信证券(山东)有限责任公司

住所、办公地址	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼		
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.citicssd.com	客服电话	95548

(61)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	刘阳
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755) 33680000

(62)平安证券有限责任公司

住所	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

(63)中国中投证券有限责任公司

住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层		
法定代表人	高涛	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

(64)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	夏中苏
电话	(0591)38281963	传真	(0591)38507538
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

(65)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

(66)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
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

(67)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	薛峰	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

(68)广州证券股份有限公司

住所、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	邱三发	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

(69)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	杨树财	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

(70)华安证券股份有限公司

办公地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号		
注册地址	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号		
法定代表人	李工	联系人	甘霖、钱欢
电话	55165161821	传真	55165161672
网址	www.hazq.com	客服电话	96518、4008096518

(71)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

(72)华西证券股份有限公司

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

## (73)申万宏源西部证券有限公司

住所、办公地址	新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 258 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
法定代表人	李季	联系人	唐岚
电话	010-88085258	传真	0991-2301802
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

## (74)中泰证券有限公司

住所、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)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	姜昧军	联系人	方文
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

## (76)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

## (77)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
网址	www.hfzq.com.cn	客服电话	(0591) 96326

## (78)中国国际金融有限公司

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层		
法定代表人	李剑阁	联系人	廉赵峰
电话	(010) 65051166	传真	(010) 85679535
网址	www.ciccs.com.cn	客服电话	(010) 85679238 ; (010) 85679169



## (79) 联讯证券股份有限公司

办公地址	广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼		
注册地址	广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼		
法定代表人	徐刚	联系人	彭莲
电话	0752-2119700	传真	0752-2119660
网址	www.lxsec.com	客服电话	95564

## (80) 英大证券有限责任公司

住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	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	吴骏	联系人	吴尔晖
电话	0755-83007159	传真	0755-83007034
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4000-188-688

## (81) 宏信证券有限责任公司

办公地址	四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 10 楼		
注册地址	四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 11 楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	www.hxzq.cn	客服电话	4008366366

## (82) 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	杨泽柱	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

## (83) 西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦		
法定代表人	余维佳	联系人	张煜
电话	(023) 63786141	传真	(023) 6378212
网址	www.swsc.com.cn	客服电话	4008096096

## (84) 湘财证券股份有限公司

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

## (85) 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
----	-----------------	------	------------

(86)民生证券股份有限公司

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.msyzq.com	客服电话	400-619-8888

(87)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

(88)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

(89)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

(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
网址	www.dxzq.net.cn	客服电话	400-8888-993

(91)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	4008601555

(92)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
网址	www.cindasc.com	客服电话	95321



## (93)南京证券股份有限公司

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

## (94)上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼		
法定代表人	龚德雄	联系人	许曼华
电话	(021) 53686888	传真	(021)53686100-7008
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518 、 4008918918

## (95)新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	(010) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

## (96)大同证券有限责任公司

住所	大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
办公地址	山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 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

## (97)国联证券股份有限公司

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		
注册地址	江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层		
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

## (98)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

## (99)国海证券股份有限公司

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
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	95563 (全国)



## (100) 东莞证券股份有限公司

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

## (101) 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	菅明军	联系人	程月艳 范春艳
电话	0371--69099882	传真	0371--65585899
网址	www.ccnew.com	客服电话	95377

## (102) 国都证券股份有限公司

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

## (103) 东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

## (104) 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		
网址	www.bocichina.com.cn	客服电话	4006208888

## (105) 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

## (106) 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	俞驰
电话	(0791) 86285337	传真	(0791) 86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

## (107) 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

(108) 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

(109) 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

(110) 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

(111) 华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	(0931) 96668、 4006898888

(112) 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)

(113) 上海华信证券有限责任公司

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.shhxzq.com	客服电话	68777877



## (114) 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	孔泉
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	(021) 32109999 , (029) 68918888

## (115) 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	程宜荪	联系人	牟冲
电话	(010) 58328112	传真	(010)58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

## (116) 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

## (117) 国融证券股份有限公司

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	董晶姗
电话	(010)83991737	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839

## (118) 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		
注册地址	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	刘爽
电话	0451-85863719	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

## (119) 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
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

## (120) 华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898



## (121) 长城国瑞证券有限公司

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	王勇	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

## (122) 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	宫龙云	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888	传真	021- 68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	(021) 63340678

## (123) 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	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人寿保险大厦十二层、十五层、十六层、十七层、十八层		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010-85556100	传真	010-85556088
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	400-898-4999

## (124) 天风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼		
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼		
法定代表人	余磊	联系人	崔成
电话	027-87610052	传真	027-87618863
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008005000

## (二) 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

## (三) 律师事务所和经办律师

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	吕红、黎明		

## (四) 会计师事务所和经办注册会计师



名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	许康玮、张勇		

## 六、基金的历史沿革和存续

### （一）基金的历史沿革

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）由嘉实沪深300指数证券投资基金通过基金合同修订变更而来。

嘉实沪深300指数证券投资基金经中国证监会《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）批准募集，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

嘉实沪深300指数证券投资基金自2005年7月5日至2005年8月19日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》于2005年8月29日生效。2005年10月17日起，嘉实沪深300指数证券投资基金在深圳交易所上市。

2012年8月6日嘉实沪深300指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》，同意嘉实沪深300指数证券投资基金变更投资范围及其相关事宜，将嘉实沪深300指数证券投资基金变更为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），允许本基金投资股指期货，参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务，并基于上述投资范围的变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金名称、投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决定事项已经中国证监会于2012年8月21日核准生效，自该日起，《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效（但该基金合同第四章“基金份额的场外认购”和第五章“基金份额的场内认购”仅适用于嘉实沪深300指数证券投资基金的募集，对变更后的嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）不适用），并取代原《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》，嘉实沪深300指数证券投资基金正式变更为



嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)，本基金当事人将按照《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》享有权利并承担义务。

## (二) 基金份额的变更登记

基金合同生效后，中国证券登记结算有限责任公司将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。

## (三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

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。

## (四) 本基金与目标ETF的联系与区别

本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：

1、在基金的投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪；

2、在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎目标ETF；而本基金作为上市开放式基金，日常交易包括申购赎回和上市交易两种方式，投资者既可以通过银行等场外代销机构申购和赎回本基金份额，也可以在交易所买卖本基金或进行基金份额的申购与赎回。

本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：

1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；

2、申购赎回的影响。目标ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

## 七、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：原基金已于 2005 年 10 月 17 日在深圳交易所上市。因召开基金





份额持有人大会，基金管理人向深圳证券交易所申请原基金自 2012 年 8 月 6 日开始持续停牌。2012 年 8 月 27 日，经基金管理人向深圳证券交易所申请，本基金复牌。**本基金的上市首日仍按 2005 年 10 月 17 日计算。**

### (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。

## 八、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

原基金自 2005 年 9 月 15 日起办理场外日常申购业务。

原基金自 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。

原基金变更不影响本基金的场内外正常申赎。

本基金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 元，直销中心柜台每个账户首次申购的最低金额为 20000 万元。已在任一网点（包括直销中心）有认（申）购本基金或原基金记录的投资者，最低申购金额为 1,000 元。

投资者通过嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币 1 元；追加申购单笔最低限额为人民币 1 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,

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

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

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

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

$$\text{赎回费} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费}$$

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(如果投资人在本基金基金合同生效前连续持有原基金直至本基金基金合同生效后赎回,该投资人的持有期将按原基金持有期加上本基金持有期合并计算)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直销网上交易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%，但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，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；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%。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。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

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(如果投资人在本基金基金合同生效前连续持有原基金直至本基金基金合同生效后赎回，该投资人的持有期将按原基金持有期加上本基金持有期合并计算)：

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



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、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、所投资的目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的；
- 5、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；
- 6、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；
- 7、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；
- 8、基金场内交易停牌时；
- 9、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。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有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、所投资的目标 ETF 暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- 5、所投资的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌,且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的;
- 6、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。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的重大事项,但基金管理人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。

注:2013 年 4 月 9 日,本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》,自 2013 年 4 月 12 日起,在本公司基金网上直销系统开通旗下部分





基金产品的后端收费模式 (包括申购、定期定额投资、基金转换等业务)、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

## 九、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;“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,嘉实基金管理有限公司开始办理嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)与原基金场外份额之间的日常转换业务。自2013年3月22日起,开始办理本基金与嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)场外份额之间的日常转换业务。

本基金在直销渠道(仅限于直销柜台及网上直销)上开放办理与本基金管理人旗下的嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、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、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创400联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实机构快线货币、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券之间的转换业务。

投资者在开放日办理本基金的转换业务,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合



同的规定公告暂停转换时除外。若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 1、转换费率

(1) 嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)、嘉实中证中期企业债指数(LOF) A/C 类场外份额与嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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（嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 除外）；根据嘉实中证中期企业债指数证券投资基金 (LOF) 基金合同的约定，对于持有期限少于 30 日的 C 类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

(2) 通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

1) 嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转换为嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；



F 为转入基金适用的申购费率；

M 为嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B 或嘉实机构快线货币 C 全部转出时账户当前累计未付收益。

2) 嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C 转换为嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) 时, 采用“赎回费+申购费率”算法:

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

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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;

F 为转入基金适用的申购费率;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3) 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) 与嘉实成长收益混合、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、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实多元债券 A、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创 400 联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实丰益信用定期债券 A 互转, 以及转入嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券时, 仅收取转出基金的赎回费, 计算公式如下:

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

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(2) 通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式），采用以下规则：

1) 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

2) 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

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。

注：2014年5月23日起，嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过500万元；2015年7月9日起，嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过500万元；自2015年7月22日起，嘉实安心货币单日单个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过200万元；自2015年11月16日起，嘉实中证中期企业债指数（LOF）单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过2000万元；2016年4月5日起，嘉实信用债券型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过500万元；自2016年7月11日起，丰益纯债单个开放日每个基金账户的累计申购（含转入）金额不得超过500万元；自2016年8月8日起，嘉实新趋势灵活配置混合型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转入及定投）的金额不得超过10万元，嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转入及定投）的金额不得超过1万元；嘉实对冲套利定期混合、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用定期债券为定期开放，在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告

### 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发生转出基金的基金合同规定的暂停赎回和/或转入基金的基金合同规定的暂停申购时的情形;

⑦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发生转出基金的基金合同规定的暂停赎回和/或转入基金的基金合同规定的暂停申购时的情形;

⑥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



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时,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) 本基金收益分配期间(R-2 日至 R 日,R 日为权益登记日)。

(2) 处于冻结状态的基金份额。

## 十一、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%，实现对沪深 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

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

## （三）投资理念

本基金遵循指数化投资理念，通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股等，力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。

## （四）投资策略

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

### 1、资产配置比例

本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标





ETF 份额可计入在内), 持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 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、组合构建

在投资运作过程中, 本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上, 决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利, 以增强基金收益。

此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品, 如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的, 基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况, 包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等, 并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

## 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%, 以实现对标的指数的有效跟踪, 分享中国股票市场的长期收益。

### (五) 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%的银行活期存款税后利率。

本基金管理人在基金管理期间有权更换标的指数和业绩衡量基准, 标的指数和业绩衡量基准的更换将提前3个月在指定媒体上公告。

### (六) 风险收益特征

风险中等, 获得证券市场平均收益率。

### (七) 投资禁止行为与限制

1、为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:



- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (5) 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;
- (6) 法律、行政法规, 或中国证监会规定禁止的其他活动。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对本基金合同约定投资禁止行为进行变更的, 以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述投资禁止行为, 如适用于本基金, 本基金可相应调整禁止行为。

## 2、本基金投资组合比例限制

1) 本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90% (已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内);

2) 持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的10%;

3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和, 不超过该证券的10%;

4) 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;

5) 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%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例, 遵从法规或监管部门的相关规定;

6) 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%;

7) 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%; 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%;

8) 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;

9) 本基金从事股票指数期货投资时, 遵循相关法律法规的规定:

a) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%;

b) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%;

c) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票及目标ETF总市值的20%;

d) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

e) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

f) 本基金投资股指期货的, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

10) 不违反基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定;

11) 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本基金变更为ETF联接基金的基金合同生效之日起3个月内达到规定的标准。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。法律法规另有规定的从其规定。

如法律法规或监管部门调整上述限制性规定, 基金管理人在履行适当程序后, 按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制, 履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

### 3. 目标ETF发生相关变更情形时的处理

目标ETF出现下述情形之一的, 本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金; 若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金, 则本基金将本着维护投资者合法权益的原则, 履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地, 基金合同中将去掉关于目标ETF的表述部分, 或将变更标的指



数，届时将由基金管理人另行公告。

(1) 目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

(2) 目标ETF终止上市；

(3) 目标ETF基金合同终止；

(4) 目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）。

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。

#### **（八）投资组合比例调整**

1. 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。

2. 基金经理每日根据本基金申购赎回情况及已有现金滞留，在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。

3. 通常情况下，联接基金的投资组合主要体现为持有目标ETF基金份额；对于目标ETF暂停申购、停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的现金，基金经理将根据市场情况按照本基金的投资范围约定的其他投资品种进行投资。

4. 风险管理部门定期对本基金的运行情况和跟踪偏离进行量化评估并出具评估报告。基金经理根据评估报告分析投资操作、组合状况和跟踪误差来源等情况，并相应进行组合调整。

#### **（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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据原基金合同规定，于2016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2016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	422,446,294.99	2.61
	其中：股票	422,446,294.99	2.61
2	基金投资	14,878,369,171.55	91.84
3	固定收益投资	129,884,000.00	0.80
	其中：债券	129,884,000.00	0.80
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	738,002,237.04	4.56
8	其他资产	32,437,775.58	0.20
	合计	16,201,139,479.16	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	328,692.00	0.00
B	采矿业	14,720,422.63	0.09
C	制造业	139,220,822.72	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,769,949.67	0.10
E	建筑业	14,614,469.64	0.09
F	批发和零售业	8,959,044.40	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	12,909,958.57	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,588,564.33	0.16



J	金融业	152,988,886.83	0.95
K	房地产业	16,827,575.72	0.10
L	租赁和商务服务业	5,064,701.26	0.03
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,979,090.88	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	719,641.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,986,682.24	0.05
S	综合	2,747,667.00	0.02
	合计	422,446,294.99	2.61

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	539,576	17,288,015.04	0.11
2	600016	民生银行	1,177,600	10,515,968.00	0.06
3	601166	兴业银行	664,300	10,123,932.00	0.06
4	600036	招商银行	513,844	8,992,270.00	0.06
5	000651	格力电器	400,400	8,824,816.00	0.05
6	601328	交通银行	1,368,600	7,705,218.00	0.05
7	600519	贵州茅台	25,089	7,323,980.88	0.05
8	600000	浦发银行	430,779	6,707,229.03	0.04
9	600030	中信证券	392,100	6,363,783.00	0.04
10	600837	海通证券	403,100	6,215,802.00	0.04

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,884,000.00	0.80
	其中：政策性金融债	129,884,000.00	0.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	-	-



8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	129,884,000.00	0.80

#### 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	160401	16 农发 01	700,000	69,986,000.00	0.43
2	160209	16 国开 09	600,000	59,898,000.00	0.37

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 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序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序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

#### 9. 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	嘉实沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	14,878,369,171.55	91.95

#### 10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF1607	沪深 300 股指期货 IF1607 合约	32	29,888,640.00	152,040.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					152,040.00
股指期货投资本期收益 (元)					2,387,640.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-2,026,260.00



## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股、备选成份股和目标 ETF。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 12. 投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2015 年 11 月 27 日，中信证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查。

2015 年 8 月 25 日，海通证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查；2015 年 9 月 11 日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，公司如果放弃陈述、申辩和听证的权利，证监会将按照行政处罚事先告知书所述事实、理由和依据作出正式的行政处罚决定。2015 年 11 月 27 日，海通证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查。

本基金投资于“中信证券（600030）”、“海通证券（600837）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，中信证券、海通证券为标的指数的成份股，本基金投资于“中信证券”、“海通证券”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(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	7,255,943.37
2	应收证券清算款	22,057,996.37
3	应收股利	-
4	应收利息	1,403,797.42
5	应收申购款	1,720,038.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	32,437,775.58

**(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**

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	000651	格力电器	8,824,816.00	0.05	重大事项停牌

**十二、基金的业绩**

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在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**

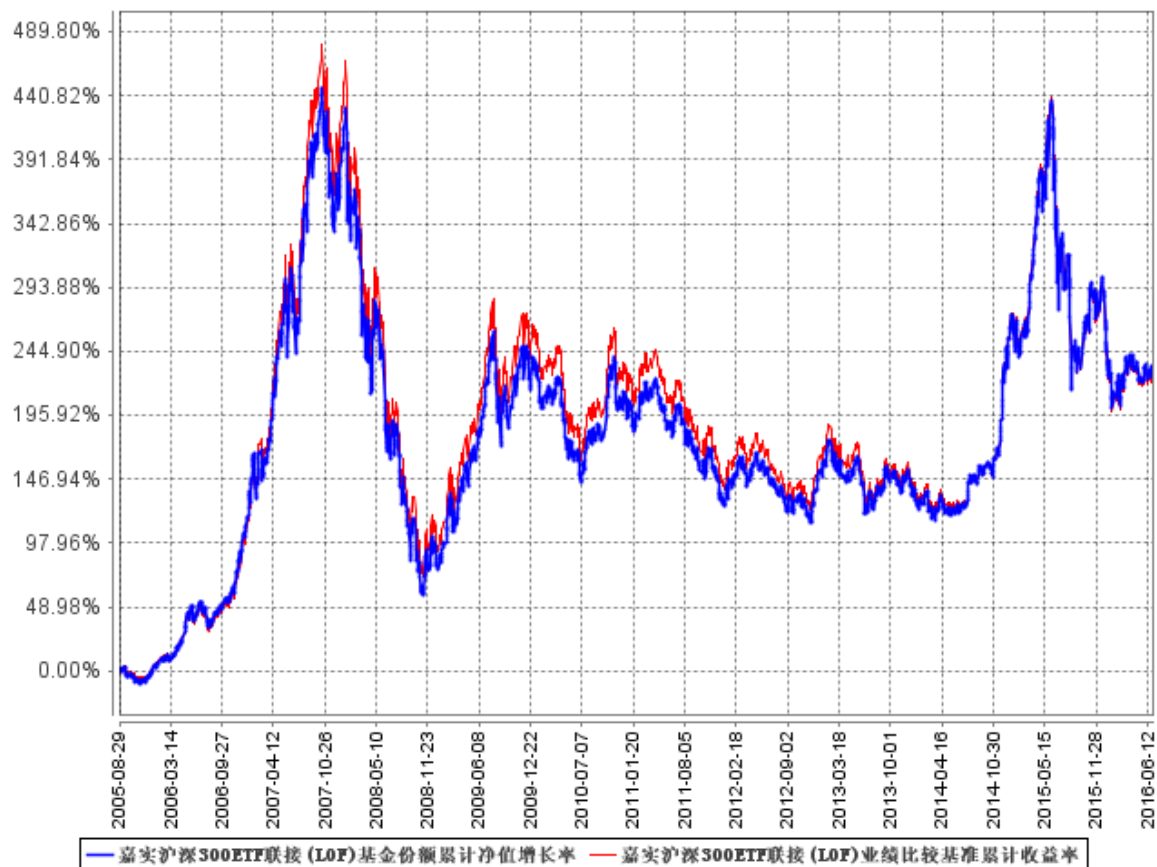
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005年8月29日基金合同生效日至2005年12月31日	-1.90%	0.82%	-0.48%	0.89%	-1.42%	-0.07%
2006年年度	120.19%	1.32%	112.79%	1.33%	7.40%	-0.01%
2007年年度	130.32%	2.18%	150.20%	2.18%	-19.88%	0.00%
2008年年度	-64.36%	2.92%	-63.85%	2.89%	-0.51%	0.03%
2009年年度	91.97%	1.95%	90.72%	1.95%	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%
2012年年度	8.81%	1.21%	7.30%	1.22%	1.51%	-0.01%



2013 年年度	-5.16%	1.32%	-7.16%	1.32%	2.00%	0.00%
2014 年年度	51.12%	1.14%	48.69%	1.15%	2.43%	-0.01%
2015 年年度	6.98%	2.35%	5.70%	2.36%	1.28%	-0.01%
2016 年上半年度	-13.97%	1.74%	-14.66%	1.75%	0.69%	-0.01%

(二)自基金合同生效以来基金份额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300ETF联接 (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 300ETF 联接 (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

(2005 年 8 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日)

注：根据 2012 年 8 月 21 日中国证监会《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2012]1146 号)，变更了投资范围并更名为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。本基金自 2012 年 8 月 21 日起 3 个月内为建仓期 (原持有的沪深 300 指数成份股、备选成份股调整为嘉实沪深 300ETF)，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）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 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。

### 十三、基金的融资融券和转融通

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、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

### 十四、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、目标 ETF 投资及其估值调整；
- 7、股票投资及其估值调整；
- 8、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、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。

## 十五、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、目标 ETF 估值方法

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值。

## 2、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。

## 3、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。

#### 4、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。

#### 5、其他资产的估值方法

股指期货以估值日的结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 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。

7、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、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形时；
- 3、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；
- 4、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 6 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。



## 十六、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。





## 十七、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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额，若为负数，则E取0。

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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产



后的余额，若为负数，则 E 取 0。

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、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

### 2、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（如果投资人在本基金基金合同生效前连续持有原基金直至本基金基金合同生效后赎回，该投资人的持有期将按原基金持有期加上本基金持有期合并计算）：

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。

### 3、转换费

嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF)、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A/C 类场外份额与嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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, 当持有期限少于 30 日的嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 类场外份额转出时, 所收取的赎回费全额归入转出基金资产, 其他情况下, 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。

## 十八、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。

## 十九、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、目标ETF变更;

27、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制件或复印件。

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、风险揭示

(一) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将对本基金资产产生潜在风险,主要包括:

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,导致市



市场价格波动, 影响基金收益而产生风险。

#### (2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表, 而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响, 从而产生风险。

#### (3) 利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动, 同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券, 收益水平会受到利率变化的影响。

#### (4) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值, 如果发生通货膨胀, 基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消, 从而影响基金资产的保值增值。

#### (5) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响, 如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化, 从而导致基金投资收益变化。

### (二) 本基金特有的风险

由于本基金为目标 ETF 的联接基金, 主要通过投资于目标 ETF 来力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率, 因此目标 ETF 的特有风险也是本基金的特有风险。简要说明如下, 具体情况可参见目标 ETF 招募说明书:

#### 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。

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离:

(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) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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。

#### 4、基金份额价格与份额净值发生偏离的风险

本基金在证券交易所的份额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, 但是份额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。

#### 5、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。

#### 6、其他投资于目标 ETF 的风险

包含目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、目标 ETF 退市风险及第三方机构服务的风险等等。

#### (三) 信用风险

指基金在交易过程发生交收违约, 或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失。

#### (四) 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金, 或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中, 可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难, 导致流动性风险, 甚至影响基金份额净值。

#### (五) 管理风险



在基金管理运作过程中,可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### (六) 操作或技术风险

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、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者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、注册登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### (七) 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。

#### (八) 其它风险

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。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人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。

## 二十一、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、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，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。

## 二十二、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、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) 出席或者委派代表出席目标ETF份额持有人大会,对目标ETF份额持有人大会审议事项行使表决权,参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例折算;

(11) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 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。

## 3、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。

#### 4、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。

## 5、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。

## 6、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。

## (二) 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) 变更基金份额持有人大会程序;

(13) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会

(14) 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、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、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 8 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、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。

## 10、 本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面的联系

鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。

本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日本基金所持有的目标ETF份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基



金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的, 须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会, 本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的, 由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会。

### (三) 基金收益分配原则、执行方式

#### 1. 基金收益分配的原则

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。

#### 2. 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。

#### 3. 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。

#### 4. 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。

### (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例;

#### 1、基金管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数, 则取0)的



0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额，若为负数，则E取0。

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、基金托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的

0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额，若为负数，则E取0。

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、基金首次发行中所发生的律师费、会计师费及与基金有关的法定信息披露费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付；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。

除基金管理费、基金托管费之外的基金费用，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，从基金财产中支付。

## （五）基金财产的投资方向和投资限制

### 1. 投资范围

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转





债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

## 2. 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,但是本基金投资目标ETF或者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) 本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内);
- 2) 持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
- 3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
- 4) 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;



5) 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%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例, 遵从法规或监管部门的相关规定;

6) 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%;

7) 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%; 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%;

8) 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;

9) 本基金从事股票指数期货投资时, 遵循相关法律法规的规定:

a) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%;

b) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%;

c) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票及目标ETF总市值的20%;

d) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

e) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

f) 本基金投资股指期货的, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

10) 不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;

11) 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本基金变更为ETF联接基金的基金合同生效之日起3个月内达到规



定的标准。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。法律法规另有规定的从其规定。

如法律法规或监管部门调整上述限制性规定，基金管理人在履行适当程序后，按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

### (3) 目标ETF发生相关变更情形时的处理

目标ETF出现下述情形之一的，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将去掉关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

(1) 目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

(2) 目标ETF终止上市；

(3) 目标ETF基金合同终止；

(4) 目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）。

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。

### (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

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、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、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。

### **(七) 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，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。

### **(八) 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，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。

### **(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**



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基金合同复制件或复印件,但所载事项应以基金合同正本为准。

## 二十三、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) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:

#### 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内),持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金



份额持有人大会决定。

2、对基金投融资比例进行监督。

1) 本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90% (已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内) ;

2) 持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的10%;

3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和, 不超过该证券的10%;

4) 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;

5) 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%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例, 遵从法规或监管部门的相关规定;

6) 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%;

7) 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%; 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%;

8) 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;

9) 本基金从事股票指数期货投资时, 遵循相关法律法规的规定:

a) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%;

b) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%;

c) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票及目标ETF总市值的20%;



d) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

e) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

f) 本基金投资股指期货的, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

10) 不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;

11) 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本基金变更为ETF联接基金的基金合同生效之日起3个月内达到规定的标准。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。法律法规另有规定的从其规定。

如法律法规或监管部门调整上述限制性规定, 基金管理人在履行适当程序后, 按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制, 履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

3、对基金投资禁止行为进行监督。

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, 但是本基金投资目标ETF或者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;

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更, 致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消, 基金管理人在依法履行相应程序后, 本基金可相



应调整禁止行为和投资限制规定。

为对基金禁止从事的关联交易进行监督,基金管理人和基金托管人应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。

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库,交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化,及时对交易对手库予以更新和调整,并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督;

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则,对银行间交易对手的资信状况进行评估,控制交易对手的资信风险,确定与各类交易对手所适用的交易结算方式,在具体的交易中,应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失,基金托管人不承担责任。

6、基金如投资银行存款,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定,事先确定符合条件的所有存款银行的名单,并及时提供给基金托管人,基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督;

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

B. 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复核。

C. 基金托管人在上述第A、B款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定,应及时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并改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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,基金托管人应及时向中国证监会报告。

D. 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》、本协议约定的,应当立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

E. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,包括但不限于: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。

### (三) 基金管理人

1、在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金资产、开设基金资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、根据基金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。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金资产、未对基金资产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时,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,基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

### (四) 基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

(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。

## 3、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, 而不限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。

#### 4、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。

#### 5、基金资产投资的有关有价凭证的保管

基金资产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 7、与基金资产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

### (五) 基金资产净值计算和会计核算

#### (A) 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、基金管理人应每开放日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》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开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值, 并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核无误后, 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。



3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金资产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除《基金合同》和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金资产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金资产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、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。

8、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。

#### (B) 基金会计核算

##### 1、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。

## 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

## 3、基金财务报表和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；招募说明书在《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45日内公告。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15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。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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人应在收到后3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个工作日内完成复核，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个工作日内完成复核，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个工作日内完成复核，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。

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。

## （六）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(注册登记机构)应当提供任何必要的协助。

#### (七) 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。

#### (八) 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。

## 二十四、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

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个工作日内向基金份额持有人寄送交易对账单。基金管理人在每年第1-3季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单,在每年第4季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日仍持有



份额的投资者寄送年度对账单；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。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

## 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并不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讯。



### 3、网上交易服务

投资者可登录本基金管理人网站，通过直销网上交易办理认购/申购、赎回、转换、定期定额申购、定期定额赎回、定期定额转换、查询等业务。具体参见相关公告。

#### (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)

### 二十五、其它应披露事项

自 2016 年 2 月 21 日至 2016 年 8 月 21 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	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	2016 年 3 月 18 日	含本基金
2	关于增加大泰金石为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	2016 年 4 月 6 日	含本基金
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	2016 年 4 月 8 日	含本基金
4	关于增加上海好买基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 4 月 18 日	含本基金
5	关于增加联讯证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 5 月 6 日	含本基金
6	关于增加利得基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	2016 年 5 月 30 日	含本基金
7	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	2016 年 6 月 1 日	含本基金
8	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与大同证券定投业务的公告	2016 年 6 月 14 日	含本基金
9	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展费率优惠活动的公告	2016 年 6 月 30 日	含本基金
10	嘉实基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过陆金所资管开办定投业务的公告	2016 年 7 月 1 日	含本基金





11	关于增加蛋卷基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 7 月 27 日	含本基金
12	关于增加深圳新兰德为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 7 月 27 日	含本基金
13	关于增加广源达信为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 7 月 29 日	含本基金
14	关于增加“万得投顾”为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2016 年 8 月 5 日	含本基金

## 二十六、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。

## 二十七、备查文件目录

- (一) 中国证监会《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议的批复》
- (二) 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同
- (三) 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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**

**2016 年 9 月 30 日**