

# 嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书

## 摘要(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

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）根据 2012 年 12 月 13 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）的批复》（证监许可[2012]1681 号）的核准公开发售，本基金基金合同于 2013 年 2 月 5 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

### 重要提示

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 8 月 5 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）。

### 一、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。

## （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、外资金融机构管理司、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。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高峰先生，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年至今任万盟并购集团董事长。

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

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，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，历任督察长和公司副总经理。

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

曲扬女士，经济学硕士，毕业于中央财经大学信息系，具有12年证券从业经验。2004年至2007年，任中信基金固定收益研究员、交易员；2007年至2010年6月，任中国光大银行债券自营投资业务副主管；2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理。2011年11月18日起至2012年11月21日任嘉实稳固收益债券基金经理。2011年11月18日至今任嘉实债券基金经理。2013年5月21日至今任嘉实丰益纯债定期债券基金经理。2014年4月18日至今任嘉实稳固收益债券基金经理。2012年12月11日至今任嘉实纯债债券基金经理。

2015年4月18日至今任嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接基金经理。2016年3月18日至今任嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券基金经理。2016年3月30日至今任嘉实新财富混合、嘉实新起航混合基金经理。2016年4月26日至今任嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合基金经理。2016年5月17日至今任嘉实稳丰纯债债券基金经理。2016年7月15日至今任嘉实稳鑫纯债债券基金经理。2015年4月18日至今任本基金基金经理。

王亚洲先生，4年证券从业经历。具有基金从业资格。曾任国泰基金管理有限公司债券研究员，2014年6月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部任研究员。

2015年7月9日至今任嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接基金经理，2015年7月9日至今任本基金基金经理。

胡永青先生，硕士研究生，13年证券从业经历，具有基金从业资格。曾任天安保险股份有限公司固定收益组合经理，信诚基金管理有限公司投资经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理。2011年12月5日至2013年12月25日任国泰双利债券证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金的基金经理，2012年7月31日至2013年10月25日任国泰信用债券型证券投资基金的基金经理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系全回报策略组组长。2014年3月28日至今任嘉实丰益策略定期债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实信用债券基金经理，2014年10月9日至今任嘉实元和基金经理。2015年4月18日至今任嘉实稳固收益债券基金经理。2016年3月14日至今任嘉实新财富混合基金经理。2016年3月30日至今任嘉实新常态混合基金经理。2016年4月12日至今任嘉实新思路混合基金经理。2016年4月18日至今任嘉实稳泰债券基金经理。2016年4月29日至今任嘉实稳丰纯债债券基金经理。2016年5月5日至今任嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合基金经理。2016年6月3日至今任嘉实稳盛债券基金经理。2015年12月15日至今任本基金基金经理。

#### （2）历任基金经理

2013年2月5日至2014年6月20日，杨宇先生任本基金基金经理。

2014年6月20日至2015年4月18日，裴晓辉先生任本基金基金经理。

### 3、债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，债券投资决策委员会的成员包括：公司固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系资深基金经理王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及投资经理王怀震先生、嘉实国际CIO Thomas Kwan先生。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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。

## 三、相关服务机构

### （一）场外销售机构

#### 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) 88832125 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

## 2、代销机构

(1) 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](http://www.icbc.com.cn) 客服电话 95588

(2) 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 刘士余 (原)

电话 (010) 85109219 传真 (010) 85109219

网址 [www.abchina.com](http://www.abchina.com) 客服电话 95599

(3) 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](http://www.boc.cn) 客服电话 95566

(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](http://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](http://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](http://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](http://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](http://www.spdb.com.cn) 客服电话 95528

(9) 中国民生银行股份有限公司

住所、办公地址 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人 洪崎 联系人 杨成茜

电话 (010)58560666 传真 (010) 57092611

网址 [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn) 客服电话 95568

(10) 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](http://www.psbc.com) 客服电话 95580

(11) 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](http://www.hzbank.com.cn) 客服电话 400-888-8508

(12) 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](http://www.jsbchina.cn) 客服电话 (025) 96098、4008696098

(13) 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](http://www.jnbank.com.cn) 客服电话 96005

(14) 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 刘洋

电话 021-20835785 传真 021-20835879

网址 [licaik.ehexun.com](http://licaik.ehexun.com) 客服电话 4009200022

(15) 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 李娟

电话 021-80359115 传真 021-38509777

网址 [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com) 客服电话 400-821-5399

(16) 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 IJ 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 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 客服电话 4006-788-887

(17) 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 <http://www.1234567.com.cn/> 客服电话 400-1818-188

(18) 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 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人 杨文斌 联系人 张茹

电话 021-20613999 传真 021-68596916

网址 [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com) 客服电话 4007009665

(19) 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 <http://www.fund123.cn/> 客服电话 4000-766-123

(20) 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 单丙烨

电话 021-20691869 传真 021-20691861

网址 [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com) 客服电话 400-089-1289

(21) 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](http://www.5ifund.com) 客服电话 4008-773-772

(22) 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](http://www.myfund.com) 客服电话 4008886661

(23) 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](http://a.leadfund.com.cn) 客服电话 400-067-6266

(24) 嘉实财富管理有限公司

住所、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 12-15 单元

法定代表人 赵学军 联系人 景琪

电话 021-38789658 传真 021-68880023

网址 [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn) 客服电话 400-021-8850

(25) 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](http://www.yixinfund.com) 客服电话 400-6099-200

(26) 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](http://www.wy-fund.com) 客服电话 400-059-8888

(27) 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](http://www.niuniufund.com) 客服电话 4006236060

(28) 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

(29) 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](http://www.jimufund.com) 客服电话 400-068-1176

(30) 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](http://www.lufunds.com) 客服电话 4008219031

(31) 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

(32) 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](http://www.yingmi.cn) 客服电话 020-89629066

(33) 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/](http://www.jnlc.com/) 客服电话 010-59336512

(34) 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

(35) 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 邮编：100088

注册地址 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

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.tjtm.com.cn> <http://www.txsec.com> 客服电话 010-66045678

(36) 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](http://www.gtja.com) 客服电话 4008888666

(37) 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](http://www.csc108.com) 客服电话 400-8888-108

(38) 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](http://www.htsec.com) 客服电话 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

(39) 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](http://www.swhysc.com) 客服电话 021-962505

(40) 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 崔少华 联系人 奚博宇  
电话 (027) 65799999 传真 (027) 85481900  
网址 [www.95579.com](http://www.95579.com) 客服电话 95579 或 4008-888-999

(41) 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](http://www.essence.com.cn) 客服电话 4008001001

(42) 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](http://www.bhzq.com) 客服电话 4006515988

(43) 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](http://www.i618.com.cn) 客服电话 400-666-1618

(44) 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](http://www.cindasc.com) 客服电话 95321

(45) 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](http://www.cgws.com) 客服电话 4006666888、(0755) 33680000

(46) 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](http://www.ebscn.com) 客服电话 4008888788、10108998

(47) 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](http://www.gzs.com.cn) 客服电话 (020) 961303

(48) 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](http://www.962518.com) 客服电话 (021) 962518、4008918918

(49) 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](http://www.dtsbc.com.cn) 客服电话 4007121212

(50) 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 055165161821 传真 055165161672

网址 [www.hazq.com](http://www.hazq.com) 客服电话 96518、4008096518

(51) 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](http://www.ccnew.com) 客服电话 95377

(52) 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](http://www.guodu.com) 客服电话 400-818-8118

(53) 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](http://www.hysec.com) 客服电话 4008-000-562



(54) 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](http://www qlzq.com.cn) 客服电话 95538

(55) 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](http://www.jyzq.cn) 客服电话 400-8888-228

(56) 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](http://www.avicsec.com) 客服电话 400-8866-567

(57) 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](http://www.westsecu.com) 客服电话 95582

(58) 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](http://www.hfzq.com.cn) 客服电话 (0591) 96326

(59) 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](http://www.ciccs.com.cn) 客服电话 (010) 85679238; (010) 85679169

(60) 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](http://www.cfsc.com.cn) 客服电话 (021) 32109999, (029) 68918888

(61) 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](http://www.china-invs.cn) 客服电话 400 600 8008

(62) 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](http://www.zszq.com) 客服电话 4001022011

(63) 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](http://www.rxzq.com.cn) 客服电话 4006609839

(64) 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](http://www.lxsec.com) 客服电话 95564

(65) 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

(66) 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

(67) 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

(68) 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

(69) 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

## (二) 场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

## (三) 基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

（四）出具法律意见书的律师事务所

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 层

联系电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

负责人：韩炯

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（五）审计基金财产的会计师事务所

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 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：许康玮、张勇

#### 四、基金的名称

本基金名称：嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）

#### 五、基金的类型

本基金类型：上市契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

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，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资于依法发行或上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工

具（但须符合中国证监会相关规定）。其中，本基金投资于中证中期企业债指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如果以后跟踪同一标的指数的目标 ETF 基金合同生效，基金管理人可以将本基金变更为该目标 ETF 的联接基金，并根据相关法律法规和本基金合同相应修改投资范围、投资策略等条款。上述变更无需召开基金份额持有人大会。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，包括但不限于固定收益远期交易、固定收益期货（含国债期货等）、固定收益互换（含利率互换、信用风险缓释工具、信用违约互换等）等，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份债券，或选择非成份债券作为替代，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，通过“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量控制跟踪误差最小化。

由于采用抽样复制法，同时结合本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券只数、权重和券种与标的指数成份券个数、权重和券种间将存在差异。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。

### (A) 资产配置策略

为实现最优跟踪标的指数的投资目标，本基金将不低于 80% 的基金资产投资于标的指数成份债券和备选成份债券。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份债券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行抽样优化调整，以实现对标指数的有效跟踪。

### (B) 债券投资策略

本基金通过分层抽样复制法进行被动式指数化投资，在力求控制跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，如“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量控制跟踪误差最小化。

## 1、债券投资组合的构建

本基金由标的指数成份债券和备选券构建组成。构建原则如下：

- 1) 投资标的以分层抽样配置标的指数成份债券为目标；并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入；
- 2) 当遇到包括但不限于成份债券流动性不足、法律法规禁止本基金投资于相关券种、价格严重偏离合理估值、单只成份债券交易量不符合市场交易惯例、基金规模太大或太小导致投资管理受到市场流动性和个券发行量的影响等情况，及预期标的指数成份债券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据相关市场情况，对个券权重和券种进行适当调整，或部分投资于备选成份券，以期在规定的风险承受限度之内，控制跟踪误差。

## 2、债券投资组合的调整

### 1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份债券的调整而进行相应调整。

### 2) 不定期调整

a) 基金管理人将基于久期、权重、信用等级、期限分布匹配的基础上，综合考虑样本券流动性、交易规模等因素，对债券投资组合进行动态抽样调整，以期实现对标的指数的有效跟踪。

b) 若成份券遇到包括但不限于退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

## 3、替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求及其它特殊市场情况，基金管理人在标的指数成份债券及备选券无法满足投资需求的情况下，可综合考虑以下原则在成份券和备选成份券外寻找成份券替代券构建投资组合。构建替代组合的方法如下：

- 1) 按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则，挑选其它可投资标的构造成份券替代券库；
- 2) 采用成份券替代券库中各债券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；
- 3) 考察上述债券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，从而使替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

## 4、债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，我们将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，

如“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等。

#### 1) 久期匹配

“久期匹配”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标，从而使得在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

#### 2) 信用等级匹配

“信用等级匹配”是指以投资组合各信用等级权重与标的指数权重相一致为目标，力争实现基金组合各信用等级债券权重与标的指数分布相匹配，减少信用等级错配的跟踪误差。

#### 3) 期限匹配

“期限匹配”是指衡量各个期限的债券权重，力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配，减少期限利差变动造成的跟踪误差

### 5、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制和对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。本基金基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### (C) 衍生品投资

未来，如法律法规或监管机构允许基金投资衍生品的，在履行适当程序后基金可以参与相关衍生品投资。基金衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征，以便更好地实现基金的投资目标。基金将主要投资于与利率、标的指数、标的指数成份券或构成基金组合的其他非成份券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等。基金持有金融衍生工具风险敞口的绝对总额不得超过基金资产的 5%。基金的衍生品投资只能用于风险对冲而不能用于投机。

#### (D) 其他品种

未来，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在依法履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，并更新和丰富基金投资策略。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{中证中期企业债指数} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$

中证中期企业债指数由上海证券交易所市场、深圳证券交易所市场以及银行间市场上市交易的 BBB 级及以上信用级别、剩余期限在 4-7 年之间、固定利率付息和一次还本付息的企业债、公司债和中期票据等信用债品种组成样本。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

#### 十一、基金投资组合报告

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，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 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 936,109,923.90 94.74

其中：债券 936,109,923.90 94.74

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 33,439,457.73 3.38

8 其他资产 18,531,078.21 1.88

合计 988,080,459.84 100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末，本基金未持有股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 国家债券 47,903,908.80 6.36

2 央行票据 --

3 金融债券 30,945,000.00 4.11

其中：政策性金融债 30,945,000.00 4.11

4 企业债券 389,070,015.10 51.68

5 企业短期融资券 90,166,000.00 11.98

6 中期票据 347,680,000.00 46.18

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 --

9 其他 30,345,000.00 4.03

合计 936,109,923.90 124.34

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 1080105 10 铁道 01 400,000 41,188,000.00 5.47

2 1280175 12 铁道 01 385,000 40,467,350.00 5.38

3 1480580 14 大连融达债 360,000 38,415,600.00 5.10

4 101456072 14 津城建 MTN002 300,000 32,904,000.00 4.37

5 101569022 15 中材 MTN001 300,000 31,287,000.00 4.16

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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10. 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。

11. 投资组合报告附注

(1)

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

(2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 20,537.50

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 18,391,642.50

5 应收申购款 118,898.21

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

合计 18,531,078.21

(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

报告期末，本基金未持有股票。

## 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。

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

自基金合同生效起至 2013 年 12 月 31 日 -2.11% 0.09% 0.17% 0.09% -2.28%  
0.00%

2014 年 8.18% 0.11% 10.43% 0.10% -2.25% 0.01%

2015 年 10.50% 0.09% 8.85% 0.06% 1.65% 0.03%

2016 年上半年 1.59% 0.10% 1.37% 0.06% 0.22% 0.04%

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

自基金合同生效起至 2013 年 12 月 31 日 -2.42% 0.09% 0.17% 0.09% -2.59%  
0.00%

2014 年 7.84% 0.11% 10.43% 0.10% -2.59% 0.01%

2015 年 11.76% 0.09% 8.85% 0.06% 2.91% 0.03%

2016 年上半年 1.54% 0.10% 1.37% 0.06% 0.17% 0.04%

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

图 1：嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 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

（2013 年 2 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日）

图 2：嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 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

（2013 年 2 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十五部分（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制”的有关约定。

### 十三、基金的费用与税收

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- (4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金上市费和年费；
- (8) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (9) 基金资产的资金汇划费用；
- (10) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

##### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

###### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### （3）基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.015% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 25,000 元，计费区间不足一季度的，以一季度计算。

由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

（4）本条第（一）款第 4 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费和赎回费

本基金 A 类基金份额收取申购费用、赎回费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

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

本基金 A 类基金份额申购费率最高不超过 0.5%，具体如下：

申购金额（含申购费） 申购费率

M < 50 万元 0.5%

50 万元 ≤ M < 100 万元 0.4%

100 万元 $\leq$ M<200 万元 0.3%

200 万元 $\leq$ M<500 万元 0.2%

M $\geq$ 500 万元 单笔 1000 元

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

本基金通过场内赎回的赎回费率统一为 0.1%。通过场外赎回基金份额，以基金登记系统确认份额的顺序，按照“先进先出”的原则适用赎回费率。

场外 A 类份额的具体赎回费率如下：

持有期限 赎回费率

M<365 天 0.10%

365 天 $\leq$ M<730 天 0.05%

M $\geq$ 730 天 0

场外 C 类份额的具体赎回费率如下：

持有期限 赎回费率

M<30 天 0.75%

M $\geq$ 30 天 0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 A 类基金份额的赎回费用 25% 的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。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。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上刊登公告。

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，针对特定交易方式（如网上交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

## 2、转换费

1、嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 类场外份额、C 类场外份额各自与嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）场外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：

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

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

转入份额 = 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、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 转入嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 时，不收取转换费用，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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；

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 转换为嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 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。

(3) 嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 与嘉实信用债券 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 之间互转, 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 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。

(4) 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 转换为嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A 时, 嘉实中证中期企业债指数

(LOF) C 转换为嘉实成长收益混合、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A 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。

(5) 嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A 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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实丰益纯债定期债券互转，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。

(6) 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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实丰益纯债定期债券转入嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 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。

3、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 1：2014 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证券投资基金（LOF）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 2000 万元；2016 年 4 月 5 日起，嘉实信用债券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 500 万元；。2016 年 7 月 11 日起，嘉实丰益纯债单日单个基金账户的累计申购（含转入）金额不得超过 500 万元；2016 年 8 月 8 日起，嘉实新趋势单日单个基金账户的累计申购（含转入、定投）金额不得超过 10 万元，嘉实新常态单日单个基金账户的累计申购（含转入、定投）金额不得超过 1 万元。嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实对冲套利定期混合、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益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。

注 2：2013 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。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）、（二）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

#### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
3. 在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。
4. 在“五、相关服务机构”部分：更新了相关直销、代销机构信息。
5. 在“十三、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
6. “十四、基金的业绩”：基金业绩更新至2016年6月30日。
7. 在“二十七、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2016年2月5日至2016年8月5日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2016年9月14日