

# 嘉实中关村A股交易型开放式指数 证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经2016年11月30日中国证券监督管理委员会《关于准予嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2925号）注册募集。本基金基金合同于2017年6月7日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

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。

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、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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年6月7日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31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	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、北京怀柔分公司。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。

### (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

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职)；中国银行业监督管理委员会(下称银监会)非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部(融资性担保业务监管部际联席会议办公室)主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障

基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、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。

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。

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。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商

学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

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

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。

经雷先生，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998 年到 2008 在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008 年到 2013 年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013 年 10 月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官，现兼任公司固定收益业务首席投资官。

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

陈正宪先生，硕士研究生，12 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及基金经理。2016 年 1 月 5 日至今担任嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF) 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 联接及嘉实中创 400ETF 基金经理。2017 年 6 月 29 日至今任嘉实富时中国 A50ETF 联接基金经理。2017 年 7 月 3 日至今任嘉实富时中国 A50ETF 基金经理。2017 年 7 月 15 日至今任嘉实创业板 ETF 基金经理。2017 年 6 月 7 日至今任本基金基金经理。

刘珈吟女士，硕士研究生，9 年证券从业经历。2009 年加入嘉实基金管理有限公司，任指数投资部指数研究员一职，现任指数投资部基金经理。2016 年 3 月 24 日至今担任嘉实中创 400ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF 及嘉实中创 400ETF 基金经理。2017 年 6 月 7 日至今任本基金基金经理。

### (2) 历任基金经理

无。

## 3、股票投资决策委员会

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，公司总经理经雷先生，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，资深基金经理胡涛先生、张金涛先生和谭丽女士。

## 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2017 年末，中国工商银行资产托管部共有员工 230 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年末，中国工商银行共托管证券投资基金 815 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、网下现金及网下股票直销机构：嘉实基金管理有限公司

###### (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号上海国金中心二期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) 84362200	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	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室		
电话	(0532) 66777997	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) 88061392	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 137 号信合广场 801A 单元		
电话	(0591) 88013670	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、销售机构：

(1) 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	北京市东城区朝内大街 188 号		
注册地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	<a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>	客服电话	400-8888-108

(2) 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		
注册地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
法定代表人	霍达	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	<a href="http://www.cmschina.com">http://www.cmschina.com</a>	客服电话	4008888111、95565

(3) 中信证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
注册地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座		
法定代表人	张佑君	联系人	郑慧



电话	010-60838888		
网址	http://www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

(4) 中国银河证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座		
办公地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层		
法定代表人	陈共炎	联系人	辛国政
电话	010-83574507	传真	010-83574807
网址	http://www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

(5) 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		
注册地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	周杰	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021)23219000	传真	(021)23219100
网址	http://www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

(6) 申万宏源证券有限公司

住所	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层		
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 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	王叔胤
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	021-962505/95523

(7) 兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路 268 号		
办公地址	福建省福州市湖东路 268 号		
注册地址	福建省福州市湖东路 268 号		
法定代表人	杨华辉	联系人	乔琳雪
电话	021-38565547		
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

(8) 中信证券(山东)有限责任公司

住所	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼		
办公地址	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层		
注册地址	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		

法定代表人	姜晓林	联系人	吴忠超
电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	http://www.zxwt.com.cn	客服电话	95548

(9) 东方证券股份有限公司

办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层		
注册地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	孔亚楠
电话	(021)63325888	传真	(021)63326729
网址	http://www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

(10) 方正证券股份有限公司

住所	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
注册地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013
网址	http://www.foundersc.com	客服电话	95571

(11) 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		
注册地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	周健男	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

(12) 申万宏源西部证券有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼		
办公地址	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
法定代表人	韩志谦	联系人	王怀春
电话	0991-2307105	传真	0991-2301927
网址	Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co.,Ltd.	客服电话	4008-000-562

(13) 中泰证券股份有限公司

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
----	-------------------	--	--

办公地址	济南市市中区经七路 86 号		
注册地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	许曼华
电话	021-20315290		
网址	<a href="http://www.zts.com.cn/">http://www.zts.com.cn/</a>	客服电话	95538

(二) 登记结算机构

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：周明

电话：010-59378888

传真：010-59378907

联系人：朱立元

(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：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫峰

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

(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 号领展企业广场二座普华永道中心 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：薛竞、张勇

#### 四、基金的名称

本基金名称：嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 3%。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。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）、衍生工具（权证、股指期货等），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

#### 八、基金的投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投

投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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。

#### ① 股指期货投资策略

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。

#### ② 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

#### ③ 资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

### 1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

### 3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资

管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

(1) 研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台，整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

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

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

(4) 交易执行：集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

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

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

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

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中关村 A 股指数，业绩比较基准为中关村 A 股指数收益率。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。若变更标的指数对投资范围和投资策略有实质性影响，且对基金份额持有人利益造成实质性影响，则需召开持有人大会，并报证监会备案。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法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股票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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4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2018年3月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,283,410.41	97.32
	其中：股票	25,283,410.41	97.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,000.00	0.01
	其中：债券	3,000.00	0.01
	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	690,228.31	2.66
8	其他资产	2,284.08	0.01
9	合计	25,978,922.80	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	250,030.30	0.97
C	制造业	12,998,251.76	50.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,176.00	0.66
E	建筑业	2,211,298.00	8.57
F	批发和零售业	251,566.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	27,204.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,040,577.15	27.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	59,850.00	0.23
L	租赁和商务服务业	702,776.00	2.72
M	科学研究和技术服务业	216,727.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	727,981.00	2.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	568,479.20	2.20
S	综合	57,494.00	0.22
	合计	25,283,410.41	97.99



## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

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

### (1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方A	407,200	2,166,304.00	8.40
2	601390	中国中铁	113,600	837,232.00	3.24
3	600031	三一重工	74,600	586,356.00	2.27
4	600588	用友网络	13,900	530,841.00	2.06
5	300003	乐普医疗	14,700	495,684.00	1.92
6	002310	东方园林	22,700	470,344.00	1.82
7	300072	三聚环保	14,300	463,320.00	1.80
8	300070	碧水源	24,600	445,752.00	1.73
9	600271	航天信息	17,300	437,517.00	1.70
10	600085	同仁堂	11,600	402,056.00	1.56

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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,000.00	0.01

## 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	127006	敖东转债	20	2,000.00	0.01

2	127005	长证转债	10	1,000.00	0.00
---	--------	------	----	----------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

**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. 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	2,144.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	139.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,284.08

**(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**

**a) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

**b) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

## 十二、基金的业绩

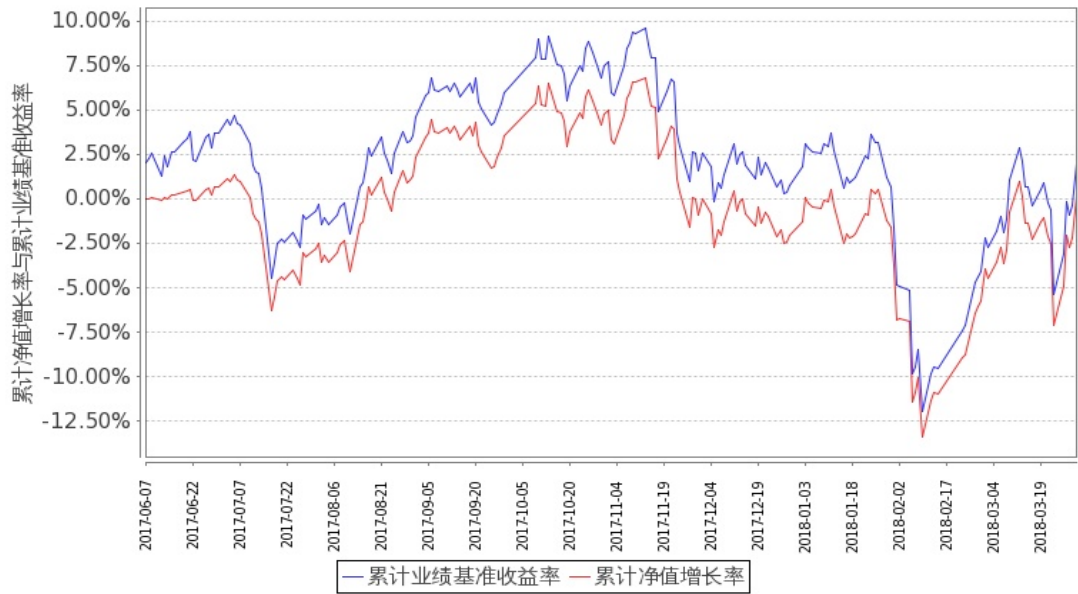
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

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
2017年6月7日（基金合同生效日）至2017年12月31日	-2.24%	0.93%	0.77%	1.00%	-3.01%	-0.07%

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

中关村A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：嘉实中关村 A 股 ETF 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

(2017 年 6 月 7 日至 2018 年 3 月 31 日)

注：本基金基金合同生效日 2017 年 6 月 7 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（七）投资限制）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、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金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) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (8) 基金资产的银行汇划费用；
- (9) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (10) 基金的上市初费和月费；
- (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人 and 基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

###### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### (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 0.03%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

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 50,000 元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。基金成立日所在季度，当季指数使用许可费的计算方法如下：

当季指数使用许可费 =  $\max(50000 \text{ 元} \times \text{基金当季存续天数} \div \text{当季天数}, \text{当季累计计提的指数使用许可费})$

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个季度（自然季度）结束后 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。

上述“1. 基金费用的种类中第（4）—（11）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，

按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(三) 不列入基金费用的项目

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金税收

基金和基金份额持有人根据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《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》、《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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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：更新相关代销机构、经办注册会计师、会计师事务所办公地址信息。

5.在“九、基金份额的申购、赎回”部分：更新了申购赎回清单的格式举例。

6.在“十、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。

7.在“十一、基金的业绩”：基金业绩更新至 2018 年第一季度末。

8.在“二十三、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2017 年 12 月 7 日至 2018 年 6 月 7 日相关临时公告事项。

9.根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人 2018 年 3 月 22 日发布的《关于修改嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同及托管协议的公告》，更新了“基金份额的申购、赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露、风险揭示”等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司

2018 年 7 月 20 日