

# 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资 基金更新招募说明书摘要

(2020年1月18日更新)

**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

本基金经 2013 年 7 月 12 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]921 号）核准公开发售，本基金基金合同于 2014 年 6 月 20 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

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。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。

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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》中对上交所跨市场股票型交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式的调整优化指引，本次更新招募说明书更新与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节，并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本情况

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27楼09-14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	经雷
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%，DWS Investments Singapore Limited 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、武汉分公司。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，2017年12月起任公司董事长。

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。

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。

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

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。

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。

雷霆先生，董事、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年在美国国际集团（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；2018年3月起任公司总经理。

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。

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。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监，现任基金运营总监。

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。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

刘珈吟女士，硕士研究生，10年证券从业经历，具有基金从业资格。2009年加入嘉实基金管理有限公司，曾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日至今任中创400交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016年3月24日至今任深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017年6月7日至今任嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年1月14日至今任嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金(LOF)基金经理、2019年3月30日至今任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019年3月30日至今任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年9月20日至今任嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年11月28日至今任嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

李直先生，硕士研究生，5年证券从业经历，具有基金从业资格。2014年7月加入嘉实基金，从事指数基金投资研究工作。2017年12月26日起至今担任深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年3月30日起至今任中创400交易型开放式指数证券投资基金、嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年9月26日起至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起至今任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起至今任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年9月28日起至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年11月1日起至今任嘉实新兴科技

100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 12 月 5 日起至今任嘉实先进制造 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

何如女士，管理时间为 2014 年 6 月 20 日至 2019 年 9 月 28 日。

3、Smart Beta 及量化投资决策委员会

Smart Beta 及量化投资决策委员会的成员包括：Smart-Beta 和量化投资负责人张峰先生，Smart-Beta 和量化投资首席投资官杨宇先生，公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生，部门负责人刘斌先生、陈正宪先生、何如女士。上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

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：许俊**

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2019年12月31日，中国银行已托管764只证券投资基金，其中境内基金722只，QDII基金42只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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。2017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。



### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、申购赎回代理券商

###### （1）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	上海市静安区南京西路 768 号		
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	http://www.gtja.com	客服电话	4008888666

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

###### （3）国信证券股份有限公司

办公地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦		
注册地址	深圳市红岭中路 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	李颖
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

###### （4）招商证券股份有限公司

住所	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		

法定代表人	霍达	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	4008881111、95565

## (5) 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	广州市天河区马场路26号广发证券大厦		
注册地址	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室		
法定代表人	孙树明	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305
网址	http://www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

## (6) 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

## (7) 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

## (8) 海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路98号		
办公地址	上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦		
注册地址	上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦		

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

## (9) 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	陈宇
电话	021-33388214	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

## (10) 华泰证券股份有限公司

办公地址	江苏省南京市江东中路 228 号		
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	http://www.htsc.com.cn	客服电话	95597

## (11) 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 1 号楼 2001		
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	焦刚
电话	(0531) 89606166	传真	(0532) 85022605
网址	http://www.zxwt.com.cn	客服电话	95548

## (12) 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	深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层		
注册地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层		

	及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元		
法定代表人	高涛	联系人	胡芷境
电话	0755-88320851	传真	0755-82026539
网址	http://www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

## (13) 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

## (14) 东方证券股份有限公司

办公地址	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦		
注册地址	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦		
法定代表人	潘鑫军	联系人	王凤
电话	(021)63325888	传真	(021)63327888
网址	http://www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

## (15) 方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼 3701-3717		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼 3701-3717		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013
网址	http://www.founder.com	客服电话	95571

## (16) 长城证券股份有限公司

住所	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层		
注册地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层		

法定代表人	曹宏	联系人	金夏
电话	(021)62821733	传真	(0755)83515567
网址	http://www.cgws.com	客服电话	4006666888、 (0755)33680000

## (17) 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

## (18) 广州证券股份有限公司

住所	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		
办公地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层		
注册地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层...		
法定代表人	胡伏云	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	http://www.gzs.com.cn	客服电话	95396

## (19) 东北证券股份有限公司

办公地址	长春市生态大街6666号		
注册地址	吉林省长春市生态大街6666号		
法定代表人	李福春	联系人	安岩岩
电话	(0431)85096517	传真	(0431)85096795
网址	http://www.nesc.com.cn	客服电话	95360

## (20) 申万宏源西部证券有限公司

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	李琦	联系人	王怀春
电话	0991-2307105	传真	0991-2301927
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	4008-000-562

	.com/index.jsp		
--	----------------	--	--

## (21) 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	http://www.zts.com.cn	客服电话	95538

## (22) 第一创业证券股份有限公司

住所	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼		
办公地址	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 9、16-20 楼		
注册地址	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼		
法定代表人	刘学民	联系人	毛诗莉
电话	(0755)23838750	传真	(0755)25838701
网址	http://www.firstcapital.com.cn	客服电话	95358

## (23) 中航证券有限公司

住所	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		
办公地址	中国北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼中航资本大厦		
注册地址	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层		
法定代表人	王晓峰	联系人	戴蕾
电话	(0791) 86768681	传真	(0791) 86770178
网址	http://www.avicsec.com/	客服电话	400-8866-567

## (24) 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	福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层		
注册地址	福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	(0591) 87383623	传真	(0591) 87383610
网址	http://www.hfzq.com	客服电话	(0591) 96326

	om. cn/		
--	---------	--	--

## (25) 长江证券股份有限公司

住所	湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦		
办公地址	湖北省武汉市江汉区新华路特8号		
注册地址	湖北省武汉市江汉区新华路特8号		
法定代表人	李新华	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
网址	http://www.cjsc.c om	客服电话	95579 或 4008-888-999

## (26) 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	天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022) 28451991	传真	(022) 28451892
网址	http://www.bhjq.c om	客服电话	4006515988

## (27) 东吴证券股份有限公司

住所	苏州工业园区星阳街5号		
办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号		
注册地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号		
法定代表人	范力	联系人	方晓丹
电话	(0512) 65581136	传真	(0512) 65588021
网址	http://www.dwzq.c om. cn	客服电话	95330

## (28) 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		
注册地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	尹旭航
电话	(010) 63081493	传真	(010) 63081344
网址	http://www.cindas c. com	客服电话	95321

## (29) 上海证券有限责任公司

住所	上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼		
办公地址	上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼		
注册地址	上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼		
法定代表人	李俊杰	联系人	邵珍珍
电话	(021)53686888	传真	(021)53686100-700 8
网址	http://www.shzq.com	客服电话	(021)962518、 4008918918

## (30) 新时代证券股份有限公司

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		
注册地址	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	叶顺德	联系人	田芳芳
电话	(010)83561146		
网址	http://www.xsdzq.cn	客服电话	95399

## (31) 国联证券股份有限公司

办公地址	无锡市金融一街 8 号		
注册地址	江苏省无锡市金融一街 8 号		
法定代表人	姚志勇	联系人	祁昊
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	http://www.glsc.com.cn	客服电话	95570

## (32) 平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层		
办公地址	深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层		
注册地址	深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层		
法定代表人	何之江	联系人	周一涵
电话	021-38637436	传真	021-58991896
网址	stock.pingan.com	客服电话	95511-8

## (33) 国海证券股份有限公司

住所	广西桂林市辅星路 13 号		
办公地址	广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦		
注册地址	广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号		



法定代表人	何春梅	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0771-5530903
网址	http://www.ghzq.com.cn	客服电话	95563（全国）

## (34) 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		
注册地址	东莞市莞城区可园南路一号		
法定代表人	陈照星	联系人	李荣
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712
网址	http://www.dgzq.com.cn	客服电话	95328

## (35) 中原证券股份有限公司

住所	郑州市郑东新区商务外环路10号		
办公地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号		
注册地址	河南省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、李盼盼
电话	0371-69099882	传真	0371-65585899
网址	http://www.ccnew.com	客服电话	95377

## (36) 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		
注册地址	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	翁振杰(代)	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311
网址	http://www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

## (37) 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		
注册地址	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	http://www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

## (38) 华龙证券股份有限公司

办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼		
注册地址	甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼		
法定代表人	李晓安	联系人	范坤
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
网址	http://www.hlzq.c om	客服电话	95368

## (39) 华鑫证券有限责任公司

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元		
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		
注册地址	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	俞洋	联系人	杨莉娟
电话	021-54967552	传真	021-54967032
网址	http://www.cfsc.c om.cn	客服电话	021-32109999;029- 68918888;40010999 18

## (40) 江海证券有限公司

办公地址	哈尔滨市松北区创新三路 833 号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	赵洪波	联系人	周俊
电话	0451-85863726	传真	0451-82337279
网址	http://www.jhzq.c om.cn/	客服电话	400-666-2288

## (41) 华宝证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	http://www.cnhbst ock.com	客服电话	4008209898

## (42) 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	北京朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦18层		
注册地址	北京市西城区金融大街8号		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010-85556100	传真	010-85556088
网址	http://www.hrsec. com.cn	客服电话	400-898-4999

## 2、二级市场交易代办证券公司

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

### （二） 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：周明

电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

### （三） 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所、办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话：（021）5115 0298

传真：（021）5115 0398

负责人：廖海

联系人：范佳斐

经办律师：刘佳、范佳斐

### （四） 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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

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	联系人	周祎
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

## 四、基金的名称

本基金名称：嘉实中证金融地产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，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。

## 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，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

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、超短期融资券等）、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。

## 八、基金的投资策略

### （一）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。

本基金投资于股指期货后，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。

本基金投资于股指期货、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。

#### 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

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，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股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：中央交易部门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，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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

## （二）、投资组合管理

### 1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5) 其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

## 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

## 3、定期投资组合管理

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

根据标的指数的编制规则及指数样本股的定期调整或临时调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

## 4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。



## 九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中证金融地产指数，业绩比较基准为中证金融地产指数收益率，中证金融地产指数为中证行业指数之一。

为反应沪深 A 股不同行业公司股票的整体表现，为投资者提供分析工具，中证行业指数借鉴国际主流行业分类标准并结合我国上市公司特点，将中证 800 指数的 800 只样本股分为能源、原材料、工业、可选消费、主要消费、医药卫生、金融地产、信息技术、电信业务和公用事业等 10 个行业并形成相应行业指数的成份股。中证行业指数采用派许方法，按照样本股的调整股本数为权数加权计算。

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。

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2019年4月17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2019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	67,205,461.00	99.60
	其中：股票	67,205,461.00	99.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,000.00	0.07
	其中：债券	50,000.00	0.07
	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	216,952.46	0.32
8	其他资产	2,856.34	-
9	合计	67,475,269.80	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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	56,420,397.73	83.78
K	房地产业	10,551,150.27	15.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	233,913.00	0.35
	合计	67,205,461.00	99.80

## (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

### 5.3.1 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	601318	中国平安	142,700	11,002,170.00	16.34
2	600036	招商银行	135,900	4,609,728.00	6.85
3	601166	兴业银行	164,100	2,981,697.00	4.43
4	600030	中信证券	103,600	2,567,208.00	3.81
5	601328	交通银行	362,300	2,260,752.00	3.36
6	600016	民生银行	327,364	2,075,487.76	3.08
7	000002	万科A	64,300	1,975,296.00	2.93
8	601288	农业银行	504,900	1,883,277.00	2.80

9	600000	浦发银行	154,753	1,745,613.84	2.59
10	601398	工商银行	284,200	1,582,994.00	2.35

注：本基金采取完全复制法，完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合。

### 5.3.2 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）	50,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,000.00	0.07

### 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	110053	苏银转债	500	50,000.00	0.07

注：报告期末，本基金仅持有上述1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) 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) 2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银监罚决字〔2018〕1号），对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实，于2018年2月12日作出行政处罚决定，罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕1号），对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告，非真实转让信贷资产等违规事实，于2018年4月19日作出行政处罚决定，罚款5870万元。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕8号），对中国民生银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，同业投资违规接受担保等违规事实，于2018年11月9日作出行政处罚决定，罚款3160万元。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕5号），对中国民生银行股份有限公司贷款业务严重违反审慎经营规则的违规事实，于2018年11月9日作出行政处罚决定，罚款200万元。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银监罚决字〔2018〕4号），对上海浦东发展银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，通过资管计划投资分行协议存款、虚增一般存款等违规事实，于2018年2月12日作出行政处罚决定，罚款5845万元，没收违法所得10.927万元，罚没合计5855.927万元。2018年8月1日，中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号，于2018年7月26日作出行政处罚决定，对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以50万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以30万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国

国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；存在与身份不明的客户进行交易的行为，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（四）项规定，处以 40 万元罚款；对浦发银行合计处以 170 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 18 万元罚款。

2018 年 8 月 1 日，中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1 号-5 号，于 2018 年 7 月 26 日作出行政处罚决定，对交通银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 40 万元罚款；存在与身份不明的客户进行交易的行为，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（四）项规定，处以 40 万元罚款；对交通银行合计处以 130 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 8 万元罚款。2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕12 号），对交通银行股份有限公司不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权、未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产等违规事实，于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定，罚款 690 万元。2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕13 号），对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违规事实，于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定，罚款 50 万元。

本基金投资于“浦发银行(600000)”，“民生银行(600016)”，“招商银行(600036)”，“兴业银行(601166)”，“交通银行(601328)”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，浦发银行，民生银行，招商银行，兴业银行，交通银行作为标的指数的成份股，本基金投资于“浦发银行”，“民生银行”，“招商银行”，“兴业银行”，“交通银行”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，其他五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	1,628.38
2	应收证券清算款	1,173.55
3	应收股利	-
4	应收利息	54.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,856.34

### (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

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。



## 十二、基金的业绩

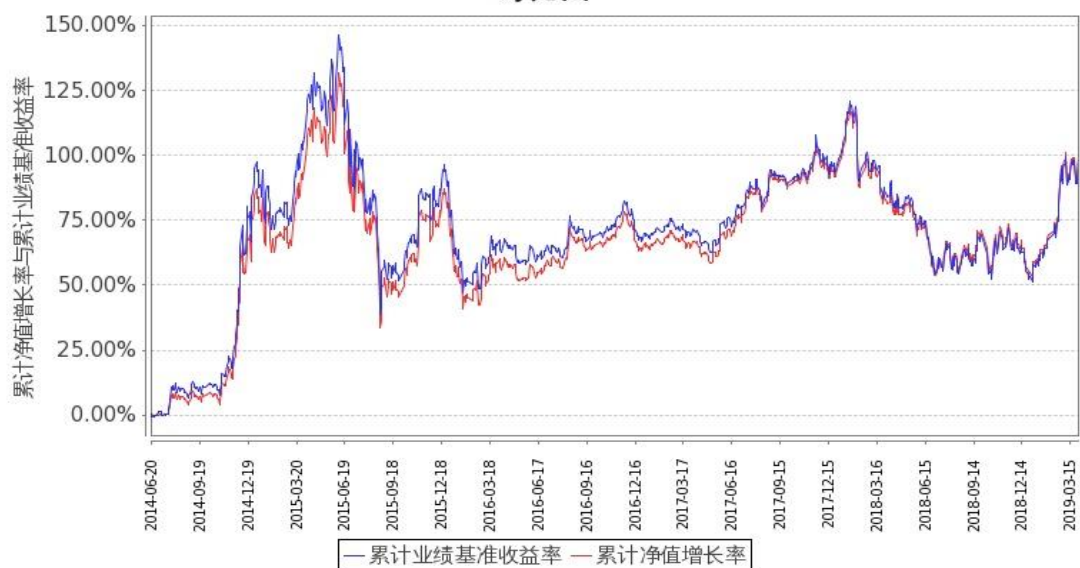
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）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	净值收益率①	净值收益率标准差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
2014年6月20日 （基金成立日）至 2014年12月31日	84.27%	1.80%	94.67%	1.89%	-10.40%	-0.09%
2015年	-2.27%	2.49%	-3.35%	2.56%	1.08%	-0.07%
2016年	-8.96%	1.29%	-10.70%	1.30%	1.74%	-0.01%
2017年	17.41%	0.76%	15.72%	0.76%	1.69%	0.00%
2018年	-19.46%	1.43%	-21.03%	1.43%	1.57%	0.00%
2019年1月1日至3月31日	28.73%	1.84%	29.21%	1.84%	-0.48%	0.00%

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

### 嘉实中证金融地产ETF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：嘉实中证金融地产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

（2014年6月20日至2019年3月31日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十三（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、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、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）；
- 7、基金资产的资金汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、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；
- 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。

### （二）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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%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、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法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 10,000 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。

除管理费、托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （二）不列入基金费用的项目、基金税收

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

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、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》、《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》、《公开募集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：本次更新招募说明书更新的主要内容。
- 2、在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关内容。
- 3、在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关内容。
- 4、在“五、相关服务机构”部分：更新相关直销机构、会计师事务所的信息。
- 5、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020年修订）》《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》中对上交所跨市场股票型交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式的调整优化指引，本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节。

嘉实基金管理有限公司

2020年1月18日