

# 嘉实沪深 300 红利低波动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08月07日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2019 年 5 月 24 日中国证券监督管理委员会《关于准予嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]948 号）注册募集。本基金基金合同于 2019 年 8 月 8 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。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。

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 2020 年 7 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 6 月 30 日（未经审计），特别事项注明除外。

## 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	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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，总部设在北京并设北京、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业务总监兼国际业务部总经理，兼任中诚国际资本有限公司总经理、中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长及法人代表。

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、商学院院长兼 MBA 教育中心主任。现任中央财经大学商学院教授。

经雷先生，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。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

何如女士，硕士研究生，14 年证券从业经历，具有基金从业资格，加拿大籍。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，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日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、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日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、2014 年 6 月 20 日至 2019 年 9 月 28 日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、2015 年 8 月 6 日至 2019 年 9 月 28 日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 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 14 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2019 年 5 月 23 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 8 月 8 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 12 月 9 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2020 年 3 月 16 日至今任嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，15 年证券从业经历，具有基金从业资格，中国台湾籍。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，现任指数投资部执行总监及基金经理。2016 年 1 月 5 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日任中创 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 2019 年 3 月 30 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 6 月 7 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实

富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 15 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 3 月 24 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）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 5 月 23 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 8 月 8 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 12 月 9 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2020 年 3 月 16 日至今任嘉实中证 500 成长估值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

本基金无历任基金经理。

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，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。

4、上述人员之间不存在近亲属关系

## 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：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2020 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 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 2020 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1094 只。自 2003 年以来，本行连续十七年获得香港《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 73 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。

### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

#### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。



（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 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）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

###### （2）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	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.citics.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	上海市黄浦区广东路 689 号		
注册地址	上海市黄浦区广东路 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、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	杨玉成	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

## (7) 安信证券股份有限公司

住所、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		
注册地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
法定代表人	黄炎勋	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355

网址	http://www.essence.com.cn	客服电话	4008001001
----	---------------------------	------	------------

## (8) 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	张伟	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

## (9) 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

## (10) 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

## (11) 东方证券股份有限公司

办公地址	中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层、12 层、13 层、22 层、25-27 层、29 层、32 层、36 层、38 层		
注册地址	中国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	王凤
电话	(021)63325888	传真	(021)63327888

网址	http://www.dfzq.com.cn	客服电话	95503
----	------------------------	------	-------

## (12) 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.foundersc.com	客服电话	95571

## (13) 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/index.jsp	客服电话	4008-000-562

## (14) 中国国际金融股份有限公司

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	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
法定代表人	沈如军	联系人	杨涵宇
电话	(010)65051166	传真	(010)85679203
网址	http://www.cicc.com.cn	客服电话	400 910 1166

## (15) 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.com	客服电话	95579 或 4008-888-999
----	---------------------	------	----------------------

## 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： 010 -59378856

传真： 010 -59378907

联系人：崔巍

### （三） 律师事务所和经办律师

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） 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	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	中国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：嘉实沪深 300 红利低波动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：股票型指数证券投资基金、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。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（股指期货、股票期权等），债券资产（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）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。

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%，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

### 1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，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（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，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投资目标所述范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

## 2、金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，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。

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

### 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。

### ③ 股票期权投资策略

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

## 3、融资及转融通证券出借

在条件许可的情况下，本基金可在不改变基金既有投资目标、投资策略和风险收益特征并在充分考虑风险控制的前提下，根据相关法律法规审慎参与融资及转融通证券出借业务。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定。

## 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

5、随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为沪深 300 红利低波动指数，业绩比较基准为沪深 300 红利低波动指数收益率。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）且在不损害持有人利益的前提下，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）且在不损害持有人利益的前提下，在履行适当程序后，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 16 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 2020 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	171,555,821.76	98.12
	其中：股票	171,555,821.76	98.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,065,500.47	1.75
8	其他资产	221,811.01	0.13
9	合计	174,843,133.24	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	16,409,410.00	9.45
C	制造业	22,911,680.00	13.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,268,132.00	13.98
E	建筑业	13,598,903.00	7.83
F	批发和零售业	2,391,238.00	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	4,278,912.00	2.47
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	76,192,363.40	43.89
K	房地产业	10,381,144.00	5.98
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	-	-
	合计	170,431,782.40	98.18

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,029,146.02	0.59
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	94,893.34	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
	合计	1,124,039.36	0.65

## 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	601288	农业银行	1,702,200	5,753,436.00	3.31
2	601988	中国银行	1,612,900	5,612,892.00	3.23
3	601328	交通银行	1,028,000	5,273,640.00	3.04
4	600016	民生银行	869,300	4,928,931.00	2.84
5	601398	工商银行	978,000	4,870,440.00	2.81
6	601169	北京银行	974,700	4,776,030.00	2.75
7	600015	华夏银行	769,800	4,711,176.00	2.71
8	601229	上海银行	540,700	4,487,810.00	2.59
9	600900	长江电力	234,500	4,441,430.00	2.56
10	601006	大秦铁路	607,800	4,278,912.00	2.47

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688177	百奥泰	9,309	530,799.18	0.31
2	688106	金宏气体	8,195	338,945.20	0.20
3	688568	中科星图	5,854	94,893.34	0.05
4	688027	国盾量子	1,839	66,535.02	0.04
5	603087	甘李药业	624	62,587.20	0.04

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

(a) 根据中国银行保险监督管理委员会北京监管局发布法人行政处罚信息公开表京银保监罚决字（2019）56 号，对民生银行总行同业票据业务管理失控、违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产、案件风险信息报送管理不到位等 12 项违规事实于 2019 年 12 月 20 日做出行政处罚决定，责令民生银行股份有限公司改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚，对顾立辉给予警告并处 5 万元罚款的行政处罚。2020 年 2 月 14 日，中国人民银行发布银罚字【2020】1 号，于 2020 年 2 月 10 日对中国民生银行股份有限公司作出行政处罚决定，因其未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，处以 2360 万元罚款。2019 年 9 月 11 日，北京银保监局发布行政处罚信息公开表（京银保监罚决字（2019）28 号），对北京银行股份有限公司个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权等违法违规事实，于 2019 年 9 月 3 日作出行政处罚决定，责令北京银行改正，并给予合计 110 万元罚款。2019 年 10 月 8 日，北京银保监局发布行政处罚信息公开表（京银保监罚决字（2019）38 号），对北京银行股份有限公司员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改、同业业务专营部门制改革不到位、同业投资违规接受第三方金融机构信用担保等违法违规事实，于 2019 年 9 月 25 日作出行政处罚决定，责令北京银行改正，并给予合计 100 万元罚款。2020 年 3 月 9 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）3 号），因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 50 万元的行政处罚。2020 年 4 月 24 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）11 号），对“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求、信贷资金被挪用作保证金、未将集团成员纳入集团客户统一授信管理等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条和相关内控管理、审慎经营规定，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 200 万元的行政处罚。2020 年 4 月 22 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）12 号），对监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在的违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 230 万元的行政处罚。

2020 年 1 月 8 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（银保监罚决字【2019】24 号），对交通银行股份有限公司授信审批不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规事实，于 2019 年 12 月 27 日作出行政处罚决定，罚款合计 150 万元。2020 年 4 月 20 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字(2020)6 号），对交通银行股份有限公司理财产品数量漏报、信贷业务担保合同漏报、分户账账户数据应报未报等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，罚款合计 260 万元。2020 年 4 月 20 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）7 号），对中国工商银行股份有限公司理财产品数量漏报、贷款核销业务漏报、委托贷款业务应报未报等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，罚款合计 270 万元。2020 年 4 月 20 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）4 号），对监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在的违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司处以罚款 270 万元的行政处罚。本基金投资于“民生银行（600016）”、“北京银行（601169）”、“农业银行（601288）”、“交通银行（601328）”、“工商银行（601398）”、“中国银行（601988）”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，民生银行、北京银行、农业银行、交通银行、工商银行、中国银行为标的指数成份股，本基金投资于“民生银行”、“北京银行”、“农业银行”、“交通银行”、“工商银行”、“中国银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(b) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他四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	19,400.22
2	应收证券清算款	202,107.13
3	应收股利	-
4	应收利息	303.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	221,811.01

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688177	百奥泰	530,799.18	0.31	科创板新股锁定
2	688106	金宏气体	338,945.20	0.20	科创板新股锁定
3	688568	中科星图	94,893.34	0.05	新发未上市
4	688027	国盾量子	66,535.02	0.04	新发未上市

## 十二、基金的业绩

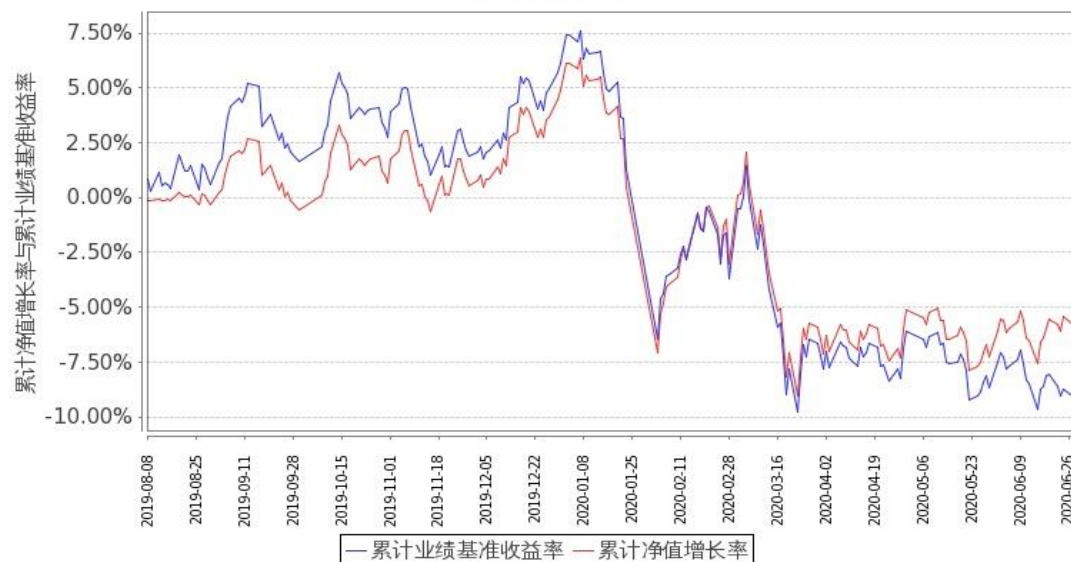
(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2019年08月08日 (基金合同生效日)至 2019年12月31日	4.88%	0.56%	6.15%	0.65%	-1.27%	-0.09%
2020年1月1日至 2020年6月30日	-9.89%	1.16%	-14.31%	1.17%	4.42%	-0.01%

月 30 日						
--------	--	--	--	--	--	--

（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300红利低波动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：嘉实沪深 300 红利低波动 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

（2019 年 8 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日）

注：本基金基金合同生效日 2019 年 8 月 8 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 6 个月为建仓期，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（六）投资限制）的有关约定。

### 十三、费用概览

（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、诉讼或仲裁费；
- 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、券商佣金及其他类似性质的费用等）；

7、基金资产的银行汇划费用；

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许可使用费；

10、基金的上市初费和年费；

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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 5 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 5 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、基金合同生效后标的指数许可使用费

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。

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可使用协议的规定，基金合同生效后，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

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000 元（大写：伍万圆），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。若一个季度累计计提指数许可使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于季度末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。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次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但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，按费用实际支出金额，列入或摊入当期基金费用，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，申购赎回代理机构可按照不超过 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

下列费用不列入基金费用：

- 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各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行，但本基金运作过程中应缴纳的增值税等以基金管理人名义缴纳的税费由基金财产承担。

## 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》、《公开募集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：更新相关销售机构的信息。
5. 在“八、基金份额的上市交易”部分：增加了扩位场内简称。
6. 在“九、基金份额的申购、赎回”部分：更新了申购赎回的相关内容。
7. 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。
8. 在“十一、基金的业绩”部分：更新了基金业绩的相关数据。
9. 在“二十三、其他应披露事项”部分：列示了相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司  
2020 年 08 月 07 日