

关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

开通集合申购业务并修改基金合同的公告

为更好地满足投资者需求，根据《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，决定于 2021 年 1 月 26 日起对旗下嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称“300ETF”，代码：159919）开通集合申购业务，并对本基金的基金合同作相应修改。现将相关事项公告如下：

一、集合申购业务的办理

本基金可通过深圳证券交易所开通集合申购业务。在本基金开通集合申购业务期间，其他业务正常办理。

1、集合申购的定义

集合申购指投资者在本基金存续期内，在不对原有基金份额持有人利益造成影响的情况下，以符合条件的单只或多只标的指数成份证券为对价，在规定时间内申购本基金份额的行为。

2、集合申购的开放日及时间

自 2021 年 1 月 26 日起，本基金开通集合申购业务。投资者可在本基金规定的集合申购开放日办理基金份额的集合申购，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所集合申购开放日的正常交易时间，但法律法规、中国证监会另有要求或基金合同另有规定需暂停集合申购的除外。

本基金集合申购的具体开放日以基金管理人届时发布的集合申购清单为准。

3、集合申购的原则

- （1）基金集合申购采用“份额申购”原则，即集合申购以份额申请。
- （2）基金的集合申购对价包括成份证券及其他对价。
- （3）在符合基金管理人相关要求的前提下，投资人方可办理集合申购业务。不符合基金管理人相关要求的集合申购业务申请，基金管理人有权予以拒绝。
- （4）集合申购申请提交后不得撤销。
- （5）集合申购应遵守《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《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》及交易所、登记机构的相关规定。
- （6）基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整，并在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、集合申购的程序

（1）集合申购的申请方式

投资者应当根据基金管理人或集合申购代理机构规定的程序，在集合申购开放日的具体业务办理时间内提出集合申购的申请。

投资者集合申购基金份额时，应当根据相应的集合申购清单备足申购对价。投资者应保证提交的成份证券不存在处于司法冻结、质押、限售期、大宗交易或者协议转让的受让锁定期等导致无法卖出的情形，并及时履行因集合申购导致的股份减持所涉相关义务。

（2）集合申购申请的确认

投资者集合申购申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的集合申购对价，则集合申购申请失败。

基金管理人或者集合申购代理机构对集合申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表确实接收到该申请。集合申购的确认以登记机构的确认结果为准。对于集合申购申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司对上述规则进行调整，本基金即适用其最新规则。基金管理人应在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（3）集合申购的清算交收与登记

本基金集合申购过程中涉及的基金份额及其对价的清算交收适用《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》和参与各方相关协议的有关规定。

投资人 T 日集合申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理集合申购证券和基金份额的清算交收，并将结果发送给深圳证券交易所、集合申购代理机构、基金管理人和基金托管人。

登记机构可在法律法规允许的范围内，对基金份额集合申购的清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，基金管理人应最迟于新规则开始实施前在指定媒介公告。

5、集合申购的数额限制

（1）投资人集合申购的基金份额需为最小申购单位的整数倍。最小申购单位由基金管理人确定和调整。目前，本基金最小申购单位为 90 万份。

（2）基金管理人可设定集合申购份额上限，以对当日的集合申购总规模进行控制，并通过集合申购清单等方式公告。

（3）根据单只证券的流动性以及对现有组合的投资运作影响等情况，基金管理人可规定用以进行集合申购的单只证券数量上限，如果投资者的集合申购申请接受后将使当日单只证券的集合申购数量超过该证券的集合申购数量上限，基金管理人可根据集合申购清单全部或部分拒绝该证券的集合申购申请。

6、集合申购的对价

（1）集合申购对价是指投资者集合申购基金份额时应交付的成份证券及其他对价。集合申购对价根据集合申购清单和投资者集合申购的基金份额数额确定。

（2）T 日的集合申购清单在当日深圳证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对集合申购清单格式和公告时间进行调整并公告。

（3）用于参与集合申购的证券需为在深圳证券交易所上市且在集合申购开放日前 30 个交易日的振幅小于 30% 的标的指数成份证券。停牌证券不得用于参与集合申购。基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对可用于参与集合申购的证券的范围进行调整并公告。

7、集合申购证券的处理程序

T 日，基金管理人在集合申购清单中公布可接受用于集合申购的成份证券数据和溢价比率，并据此收取集合申购证券。基金管理人自 T+1 日（指 T 日起第 1 个交易日，不含 T 日）起按照法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的规定对收到的成份证券进行组合调整，组合调整过程中投资者用于集合申购的证券的价格下跌和待买入的其他证券的价格上涨所造成的损失均由申请集合申购的投资者自行承担，计入集合申购退补款，不计入基金资产，不会对原有基金份额持有人利益造成影响。

基金管理人在 T+10 日（指 T 日起第 10 个交易日，不含 T 日）内根据预先收取的成份证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用，下同）和其他证券的实际买入成本（买入价格加交易费用，下同）完成集合申购退补款的清算，如果预先收取的成份证券（含证券溢价）实际卖出收入高于其他证券的实际买入成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的成份证券（含证券溢价）实际卖出收入低于其他证券的实际买入成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

T+10 日内，若已购入全部被替代的证券，则以用于集合申购的证券的实际卖出收入与被替代证券的实际买入成本，确定基金应退还每个投资者或每个投资者应补交的款项；若 T+10 日日终仍未能购入全部被替代的证券，则以用于集合申购的证券的实际卖出收入与已买入的部分证券的实际买入成本加上按照 T+10 日收盘价计算的未买入的部分证券价值的差额，确定基金应退还每个投资者或每个投资者应补交的款项。

对于集合申购的基金份额，投资者在其对应的集合申购退补款交收完成前不得卖出或赎回。若因投资者用于集合申购的证券停牌、流动性不足、价格异常波动等原因，导致基金管理人无法在规定时间内完成投资组合调整，或者集合申购退款的交收，或者出现投资者无法及时足额完成集合申购补款及其他可能损害基金份额持有人权益的情形，则基金管理人有权代投资者提交基金份额赎回申请，并退回相应成份证券和款项。

若基金管理人进行组合调整期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

8、集合申购代理机构

嘉实基金管理有限公司。

基金管理人可依据实际情况增减、变更集合申购代理机构。

二、基金合同的修订

因开通集合申购业务，我公司就《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的相关条款进行了修订。具体内容如下：

在“八、基金份额的申购、赎回与非交易过户”章节中新增如下段落：

“（四）其他

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购，即允许投资者在基金存续期内，以符合条件的单只或多只标的指数成分证券为对价，在规定时间内进行本基金的申购。集合申购业务的规则由基金管理人制定。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。”

三、其他事项

1、参与集合申购的股票仅限沪深 300 指数的深市非停牌成份股。

2、集合申购业务仅定期开放，投资者应避开市场波动较大的时期。

3、每次集合申购业务开放期间，除特别说明外，本基金的实物申购赎回业务、场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申购赎回业务正常办理；本基金基金份额的二级市场交易正常进行，不受影响。

4、本次基金合同的修订对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。本公司将根据此在更新基金招募说明书时，对上述内容进行相应修订。

5、本公告仅对本基金开通集合申购业务并修改基金合同的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书（更新）等法律文件，以及相关业务公告。

四、风险提示

1、集合申购业务的风险主要包括如下几方面：

(1) 投资者集合申购失败的风险

基金管理人有权根据基金合同或招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的集合申购申请，从而导致集合申购失败。

基金的集合申购清单中，对可用于集合申购的成份券范围和成份券数量进行了限定，因此，投资者在进行集合申购时，可能存在用于集合申购的证券或证券数量与集合申购清单不符，导致集合申购全部或部分失败的风险。

(2) 集合申购组合调整的风险

投资者提交集合申购申请后，基金管理人将按照招募说明书的规定对收到的成份证券进行组合调整。组合调整过程中投资者用于集合申购的证券的价格下跌和待买入的其他证券的价格上涨所造成的损失均由申请集合申购的投资者自行承担，计入集合申购退补款，不计入基金资产，不会对原有基金份额持有人利益造成影响。

(3) 基金份额无法卖出或赎回的风险

对于集合申购的基金份额，投资者在其对应的集合申购退补款交收完成前不得卖出或赎回，可能使投资者因无法及时卖出或赎回基金份额而影响投资收益。

(4) 基金管理人代为赎回基金份额的风险

若因参与集合申购的证券停牌、流动性不足、价格异常波动等原因，导致基金管理人无法在规定时间内完成投资组合调整或者集合申购退款的交收，或者出现投资人无法及时足额完成集合申购补款的交收及其他可能损害基金份额持有人权益的情形，基金管理人有权代投资者提交基金份额赎回申请，并退回相应成份证券和款项。投资者应自行承担该部分成份券价格波动造成的损失，投资者面临基金管理人代为赎回基金份额的风险。基金管理人代为赎回基金份额可能导致投资者集合申购的最终份额不是最小申购、赎回单位的整数倍，投资者面临集合申购所得份额无法全部赎回、只能在二级市场卖出部分或全部基金份额的风险。。

(5) 投资者需要补缴款项的风险

在极端市场情况下，预先收取的证券（含证券溢价）变现价值，可能低于基金其他证券的买入成本或结算成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。投资者存在需要补缴款项的风险。

(6) 业务规则变更的风险

集合申购业务规则后续或有调整，投资者需注意交易所、中国登记结算有限公司对集合申购业务的清算交收规则等进行变更的风险。

2、投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书（更新），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。

3、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。

五、咨询办法

1. 嘉实基金管理有限公司客户服务电话:400-600-8800
2. 嘉实基金管理有限公司网站:www.jsfund.cn

特此公告

嘉实基金管理有限公司
2021年1月23日