

关于嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为嘉实 中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 并修改法律文件的公告

嘉实基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2022 年 9 月 18 日经中国证监会证监许可【2022】2193 号文准予注册募集，《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2022 年 10 月 20 日生效。

本公司旗下的嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金于 2025 年 4 月 21 日获得中国证监会准予注册的批复，并于 2025 年 7 月 17 日成立运作。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的约定“若将来本基金管理人推出同一标的的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，而无需召开基金份额持有人大会”，本公司经与本基金的基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定自 2025 年 7 月 25 日起，将嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并相应修订《基金合同》等法律文件。

现将具体事宜公告如下：

一、变更为联接基金

嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金当日，本基金的登记机构

将进行基金份额变更登记，即将“嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 A 类基金份额”变更为“嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 A 类基金份额”，将“嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 C 类基金份额”变更为“嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 C 类基金份额”。

本基金的基金简称分别由“嘉实中证全指证券公司指数发起式 A”变更为“嘉实中证全指证券公司 ETF 发起联接 A”，“嘉实中证全指证券公司指数发起式 C”变更为“嘉实中证全指证券公司发起联接 C”，各类基金份额的基金代码保持不变。

前述变更不影响本基金各类基金份额净值的计算。

二、关于修改《基金合同》的说明

根据法律法规的规定和《基金合同》的相关约定，本公司经与基金托管人协商一致，就本次基金变更事项相应修改了《基金合同》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金托管协议》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金招募说明书》。本次《基金合同》修订的主要内容包括：基金投资目标、投资范围和投资策略等条款针对投资目标 ETF 进行的相应调整，基金名称、类别的变更，以及本基金变更为 ETF 联接基金的其他必要修订。《基金合同》的修订内容详见附件《〈嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同〉修订前后对照表》。

修订后的《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》、《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》自 2025 年 7 月 25 日起生效，原《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金托管协议》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金招募说明书》于同日失效。本公司届时将同步披露修订后的基金合同、托管协议以及更新的招募说明书、基金产品资料概要。

重要提示：

本基金变更为联接基金属于《基金合同》约定的不需召开基金份额持有人大会的事项，且根据法律法规及本基金的实际运作对相关条款进行必要修订的内容对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，根据《基金合同》的约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就前述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。

本基金变更前后的管理费率、托管费率、销售服务费率以及各类基金份额申购费率、赎回费率均保持不变。对于本基金变更前确认的基金份额，其持有期限将从原份额取得之日起连续计算。

本公告仅对嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改法律文件等事项予以说明。

投资者欲了解嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的详细情况，可通过本公司的客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）或登录本公司网站 www.jsfund.cn 获取相关信息。

风险提示：

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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，敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读本基金的基金合同、更新的招募说明书等。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 7 月 23 日

附：《〈嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同〉修订前后对照表》

《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》修订前后对照表

章节	原《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》条款	修改后的《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》条款
第一部分 前言	三、本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 	三、嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）由嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更而来。嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金依照《基金法》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
	七、本基金为指数基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。	七、本基金为指数基金联接基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。
第二部分 释义	1、基金/本基金：指嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金	1、基金/本基金：指嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
	4、基金合同/本基金合同：指《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	4、基金合同/本基金合同：指《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金托管协议》及	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式

对该托管协议的任何有效修订和补充	<u>联接基金</u> 托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书：指《 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 招募说明书》及其更新后的版本	6、招募说明书：指《 嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 招募说明书》及其更新后的版本
7、基金份额发售公告：指《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》	删除
无	14、ETF 联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，与目标 ETF 的投资目标类似，通过主要投资于目标 ETF 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金 15、目标 ETF：指另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ETF”），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金以嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实中证全指证券公司 ETF”）为目标 ETF
26、基金销售业务： 指基金管理人或销售机构宣传推介基金，开立基金交易账户、 发售基金份额 ，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等业务	27、基金销售业务： 指基金管理人或销售机构宣传推介基金，开立基金交易账户，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等业务
29、基金交易账户： 指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理 认购 、 申购 、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户	30、基金交易账户： 指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
30、基金合同生效日： 指 基金募集达到法律法规及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理完毕基金备案手续，并获得中国证监会书面确认的日期	31、基金合同生效日： 指《 嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同 》生效日，原《 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同 》自

	同日起失效
32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月	删除
33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	33、存续期：指 <u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》</u> 生效至 <u>本基金基金合同</u> 终止之间的不定期期限
40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为	40、认购：指在 <u>嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金</u> 的募集期内，投资人根据 <u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》、《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金招募说明书》</u> 及相关公告的规定申请购买 <u>嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金</u> 基金份额的行为
49、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约	49、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、 <u>投资目标 ETF 份额</u> 所得收益、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
50、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和	50、基金资产总值：指基金拥有的 <u>目标 ETF 份额</u> 、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
55、基金份额类别：指本基金根据 认购 /申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。各基金份额类别分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值 A类基金份额：指在投资人 认购 /申购基金份额时收取 认购 /申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不	55、基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。各基金份额类别分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值 A类基金份额：指在投资人申购基金份额时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额

第三部分 基金的基本情况	收取 认购/ 申购费用的基金份额	
	58、基金产品资料概要：指《 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 基金产品资料概要》及其更新	58、基金产品资料概要：指《 嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 基金产品资料概要》及其更新
	63、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外的投研人员，下同）等人员参与认购的资金。发起资金认购 本基金 的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年	63、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外的投研人员，下同）等人员参与认购的资金。发起资金认购 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年
	64、发起资金提供方：指以发起资金认购 本基金 且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员	64、发起资金提供方：指以发起资金认购 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员
	一、基金名称 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金	一、基金名称 嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
	二、基金的类别 股票型证券投资基金	二、基金的类别 ETF 联接基金
	四、基金的投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	四、基金的投资目标 通过主要投资于目标 ETF ，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
	五、基金的最低募集金额 本基金 为发起式基金，其中，发起资金提供方认购本基金的总	五、 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 的最低募集金额

金额不少于 1000 万元人民币，且持有期限不少于 3 年，法律法规和监管机构另有规定的除外。	嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为本基金后仍为发起式基金 ，其中，发起资金提供方认购 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 的总金额不少于 1000 万元人民币，且持有期限不少于 3 年，法律法规和监管机构另有规定的除外。
六、基金份额初始面值和认购费用 本基金基金份额初始面值为人民币 1 元。 本基金 A 类基金份额的认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C 类基金份额不收取认购费。	删除
八、基金份额类别 本基金根据 认购/ 申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人 认购/ 申购基金份额时收取 认购/ 申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取 认购/ 申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。 本基金各类基金份额分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在 认购/ 申购基金份额时可自行选择 认购/ 申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。	七、基金份额类别 本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金份额时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。 本基金各类基金份额分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在申购基金份额时可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。
九、标的指数 本基金的标的指数为中证全指证券公司指数。	八、目标 ETF 及其标的指数 目标 ETF 为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金，其标的指数为中证全指证券公司指数。
十、未来条件许可情况下的模式转换 若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数	删除

基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标ETF的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。	
无	<u>九、本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：</u> <u>1、在基金的投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对标的指数的紧密跟踪；</u> <u>2、在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申赎单位和申购赎回清单的要求申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按未知价法进行基金的申购与赎回。</u> <u>本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：</u> <u>1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> <u>2、申购赎回的影响。目标ETF采取实物申赎方式或者按照目标ETF法律文件约定的其他方式申赎，申购赎回对基金净值</u>

		影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。
第四部分基金的历史沿革（原第四部分基金份额的发售）	第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 本基金通过销售机构公开发售。销售机构的具体名单见基金份额发售公告或在基金管理人网站列明，基金管理人可不时变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1、发起资金认购 本基金发起资金认购的金额不少于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。其中发起资金指基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购的资金。 本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。 2、认购费用 本基金A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列示。基金认	第四部分 基金的历史沿革 嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更而来。 嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金经中国证监会2022年9月18日证监许可【2022】2193号《关于准予嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册募集，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金自2022年10月14日至2022年10月18日进行发售，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》于2022年10月20日生效。 《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标ETF的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。”基金管理人经与基金托管人协商一致后，决定将嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证

购费用不列入基金财产。 3、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数量以登记机构的记录为准。 4、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 5、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的损益归入基金财产。 6、认购的确认 投资者按照本基金合同的约定提交认购申请并交纳认购基金份额的款项时，基金合同成立，基金管理人按照规定办理完毕基金募集的备案手续并获中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果和基金合同生效为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认	券投资基金发起式联接基金，并据此修订《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》。 <u>自 2025 年 07 月 25 日起，嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金正式变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效。</u>
--	--

	购申请非经登记机构同意不得撤销。 5、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以于募集期结束后采取部分确认等方式对该投资人的认购申请进行限制，以使该投资人持有本基金份额数低于本基金总份额数的 50%。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50% 比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。发起资金提供方使用发起资金认购的基金份额达到或超过基金总份额 50% 的，不受上述限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。	
第五部分 基金的存续 (原 第五部分 基金备 案)	第五部分 基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币且承诺持有期限不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的，基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式	第五部分 基金的存续 删除

	如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：— 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；— 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，—并加计银行同期活期存款利息。— 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。—	
	三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 基金合同生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或监管部门规定发生变化，上述终止规定被取消或更改的，则本基金可以参照届时有效的法律法规或监管部门的规定执行。 基金合同生效后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。	<u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或监管部门规定发生变化，上述终止规定被取消或更改的，则本基金可以参照届时有效的法律法规或监管部门的规定执行。 <u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效三年后，若本基金继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。
第六部分	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付

基金 份额 的申 购与 赎回	 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(含本日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障等非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项的支付时间相应顺延。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付按照本基金合同有关条款处理。	 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(含本日)内支付赎回款项。遇<u>目标 ETF 暂停交易或赎回</u>、证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障等非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项的支付时间相应顺延。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付按照本基金合同有关条款处理。
	七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。 11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1 项至第 7 项及第 11 项拒绝或暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，	七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、<u>所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u> <u>3、所投资的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。</u> <u>4、</u>发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述拒绝或暂停申购情形之一（<u>第 10、11 项除外</u>）且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基

	基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第 8、9、10 项拒绝或暂停申购情形之一的，基金管理人有权按照维护存量基金份额持有人利益的原则，决定拒绝或暂停接受投资人申购申请，或采取部分确认等方式对该投资人的申购申请进行限制。	基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第 <u>10、11</u> 项拒绝或暂停申购情形之一的，基金管理人有权按照维护存量基金份额持有人利益的原则，决定拒绝或暂停接受投资人申购申请，或采取部分确认等方式对该投资人的申购申请进行限制。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 …… 发生上述情形（第 4、5 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时（上述第 5 项除外），基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、<u>所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u> 3、<u>所投资的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。</u> 4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 …… 发生上述情形（第 6、7 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 <u>6</u> 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时（上述第 <u>7</u> 项除外），基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。
第七部分	一、基金管理人 （一）基金管理人简况	一、基金管理人 （一）基金管理人简况

基金 合同 当事人及 权利 义务	名称：嘉实基金管理有限公司	名称：嘉实基金管理有限公司
	组织形式：有限责任公司（ 中外合资 ）	组织形式：有限责任公司（ 外商投资、非独资 ）
	（二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （14）在不违反法律法规的前提下，制订和调整有关基金开户、认购—申购、赎回、转换和非交易过户及其他相关业务的业务规则； （15）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。	（二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （14）在不违反法律法规的前提下，制订和调整有关基金开户、申购、赎回、转换和非交易过户及其他相关业务的业务规则； （15）<u>代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利，基金合同另有约定的除外；</u> <u>（16）</u>法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。
	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售—申购、赎回和登记事宜； （8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购—申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格； （24）基金管理人在募集期满未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人应当将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人； —（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议； 	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜； （8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格； （24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
	二、基金托管人	二、基金托管人

第八部分 基金份额持有人大会	(二) 基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；	(二) 基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
	三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： 无	三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： (9) <u>出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会，对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</u>
	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： (4) 交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
	一、召开事由 1、除法律法规或中国证监会或基金合同另有规定外，当需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会： 无 2、在不违反法律法规强制性要求且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： (5) 基金管理人、登记机构、销售机构在法律法规和中国证监会规定范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、收益分配等业务的规则；	一、召开事由 1、除法律法规或中国证监会或基金合同另有规定外，当需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会： <u>(11) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会；</u> 2、在不违反法律法规强制性要求且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： (5) 基金管理人、登记机构、销售机构在法律法规和中国证监会规定范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、收益分配等业务的规则；

..... (7) 在不违反法律法规规定且符合基金合同约定的前提下，本基金变更为由基金管理人管理的同一标的指数 ETF 的联接基金并相应变更基金名称、类别，修改《基金合同》的投资目标、投资范围和投资策略等条款； (8)按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。	 (7) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
无	<u>九、本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面的联系</u> <u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。</u> <u>本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日本基金所持有的目标 ETF 份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。</u> <u>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</u>

		<u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。</u>
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	一、投资目标 <u>通过主要投资于目标 ETF</u>，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
	二、投资范围 本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股。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（包含创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货等）、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）。 本基金投资于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%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。	二、投资范围 本基金的投资范围主要为目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。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（包含创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货等）、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）。 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

三、投资策略 本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合构建 本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据中证全指证券公司指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟	三、投资策略 1、<u>目标 ETF 投资策略</u> <u>本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过投资目标所述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。</u> <u>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。</u> <u>本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</u> 2、股票投资策略 <u>基金可通过买入标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股的方式申购目标 ETF。对于出现市场流动性不足等情况，导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人有权通过投资非成份股等进行适当的替代。</u> 3、存托凭证投资策略 ……
--	--

跟踪误差最小化。 1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 A 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合； B 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； C 根据法律法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 如因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目标范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、存托凭证投资策略	
四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）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基金资产净值的 90%； （10）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列投资限制： ③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%； （10）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列投资限制： ③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货

合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。 其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； ④本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%； （11）本基金若参与国债期货交易，应当符合下列投资限制： ③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。 其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；	合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。 其中，有价证券指股票、<u>目标ETF</u>、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； ④本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值<u>及目标ETF</u>的20%； （11）本基金若参与国债期货交易，应当符合下列投资限制： ③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。 其中，有价证券指股票、<u>目标ETF</u>、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
除上述（2）、（7）、（13）、（14）、（17）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整或标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。 	除上述<u>（1）、</u>（2）、（7）、（13）、（14）、（17）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整或标的指数成份股流动性限制、<u>目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌</u>等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。<u>因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（1）项规定的比例，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</u>法律法规另有规定的，从其规定。
无	<u>2、目标ETF发生相关变更情形的处理方式</u>

	<u>在标的指数符合法律法规要求的情况下，目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并，届时将由基金管理人另行公告。</u> <u>(1) 目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</u> <u>(2) 目标 ETF 终止上市；</u> <u>(3) 目标 ETF 基金合同终止；</u> <u>(4) 目标 ETF 与其他基金进行合并；</u> <u>(5) 目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）；</u> <u>(6) 中国证监会规定的其他情形。</u>
2、禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动： (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；	3、禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动： (4) 买卖<u>除目标 ETF 以外的</u>其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
五、标的指数和业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。 中证全指证券公司指数是本基金的标的指数。 	五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
六、风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基	六、风险收益特征 <u>本基金为嘉实中证全指证券公司 ETF 的联接基金，主要通过</u>

	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，具有与标的指数相似的风险收益特征。	投资于嘉实中证全指证券公司 ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证全指证券公司指数及嘉实中证全指证券公司 ETF 的表现密切相关。 本基金预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
第十三部分 基金的财产	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金持有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指 目标 ETF 份额 、基金持有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约、资产支持证券、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的股票、 目标 ETF 基金份额 、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约、资产支持证券、其它投资等资产及负债。
	四、估值方法 无	四、估值方法 1、目标 ETF 份额的估值方法 本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值。
	七、暂停估值的情形 无	七、暂停估值的情形 2、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形时；
第十五部分 基金费用	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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$	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 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。 基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.15%

与税收	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 	年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 <u>扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</u>
	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 	2、基金托管人的托管费 <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。</u>基金的托管费按前一日基金资产净值 <u>扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）</u> 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 <u>基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</u>
	三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、基金合同生效前的相关费用； 4、指数许可使用费， <u>指数许可使用费由基金管理人承担，</u> 5、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。	三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、基金合同生效前的相关费用 <u>根据《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；</u> 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。
	第十部分 基金 五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

的信息披露	2、基金招募说明书应当按照法律法规和监管要求披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 4、…… 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当按照《信息披露办法》的规定，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。	2、基金招募说明书应当按照法律法规和监管要求披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 4、……
	（二）基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日按照《信息披露办法》的规定登载于规定媒介上。 （三）基金合同生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上登载基金合同生效公告。	删除
	（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 ……	（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 ……

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。	<u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。
(七) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人； 8、本基金募集期延长或提前结束募集； 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动； 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； 21、基金变更标的指数； 	(五) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人； 8、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动； 19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； <u>20、目标 ETF 变更；</u> 21、基金变更标的指数；
(十一) 发起资金认购份额报告 基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求，在基金合同生效公告、基金年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。	(九) 发起资金认购份额报告 基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求，在<u>《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告》</u>、本基金年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

第二十二部分 基金合同的效力	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字/签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，经中国证监会书面确认后生效。	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字/签章，自 2025 年 7 月 25 日起，嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金正式变更为嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《嘉实中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金基金合同》于同日失效。
注：“第二十四部分 基金合同内容摘要”章节涉及上述内容的一并修改。		