

# 嘉实中证500交易型开放式指数 证券投资基金联接基金 更新招募说明书

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

## 重要提示

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）根据2012年11月27日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]1588号）的核准公开发售，本基金基金合同于2013年3月22日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

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。嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）为嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实中证500ETF”）的联接基金，主要通过投资于嘉实中证500ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证500指数及嘉实中证500ETF的表现密切相关。本基金的长期

平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。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、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**2013年9月22日**（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为**2013年6月30日**（未经审计）。

---

---

## 目 录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	16
五、相关服务机构 .....	19
六、基金的募集 .....	29
七、基金合同的生效 .....	31
八、基金份额的申购、赎回 .....	32
九、基金转换 .....	41
十、定期定额投资计划 .....	45
十一、基金的非交易过户、转托管、冻结和解冻 .....	46
十二、基金的投资 .....	47
十三、基金的业绩 .....	56
十四、基金的融资、融券 .....	58
十五、基金的财产 .....	59
十六、基金资产估值 .....	60
十七、基金收益与分配 .....	66
十八、基金的费用与税收 .....	68
十九、基金的会计与审计 .....	70
二十、基金的信息披露 .....	71
二十一、风险揭示 .....	75
二十二、基金合同的变更、终止与基金资产的清算 .....	78
二十三、基金合同内容摘要 .....	81
二十四、基金托管协议的内容摘要 .....	96
二十五、对基金份额持有人的服务 .....	107
二十六、其他应披露事项 .....	108
二十七、招募说明书存放及查阅方式 .....	109
二十八、备查文件 .....	110

---

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《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合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

词语或简称	含义
招募说明书或本招募说明书	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其定期的更新
基金合同或《基金合同》	《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合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
基金或本基金	依据基金合同所募集的嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
中国	中华人民共和国(仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》	指中国证监会 2012 年 6 月 19 日修订并同日颁布实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《信息披露办法》	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
元	中国法定货币人民币元
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额发售公告》

《业务规则》	指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	指中国建设银行股份有限公司；
基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，代为办理基金销售业务的机构
销售机构	指直销机构和代销机构
基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
注册登记业务	指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》规定的基金份额的登记、存管和结算等业务。
注册登记机构	指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
基金合同当事人	指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
机构投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者	指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

人民币合格境外机构投资者	指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
投资人	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者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的合称
标的指数	指中证指数有限公司编制并发布的中证 500 指数及其未来可能发生的变更
目标 ETF	另一获中国证监会核准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 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实中证 500ETF”）为目标 ETF
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，紧密跟踪业绩比较基准，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
基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
基金份额持有人大会	按照基金合同第七部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议
募集期	基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	基金合同生效后合法存续的不定期之期间
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

T 日	销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日, n 为自然数)
认购	指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
申购	指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
赎回	指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
巨额赎回	指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%
基金账户	指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
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买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
转托管	指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
基金转换	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为



定期定额投资计划	指投资人通过有关销售机构提出申请, 约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式, 由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
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
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
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值, 以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的, 使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件

### 三、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	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 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	安奎
总经理	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。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

##### 2. 部门设置情况

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险并提出防范措施。

公司目前下设股票投资部、固定收益部、定量投资部、指数投资部、机构投资部、现金管理部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务团队、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、基金运营部、登记结算部、信息技术部、财务部、人力资源部、行政管理部等部门。

股票投资部、固定收益部、定量投资部、指数投资部、现金管理部和机构投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程、

绩效考核。监察稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。机构业务团队主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。渠道发展部、营销策划部、电子商务部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。基金运营部、登记结算部、信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护,跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务工作,人力资源部、行政管理部负责公司企业文化建设、招聘、薪酬福利、激励和考核、人员培训和发展、人事档案、行政性后勤管理和服务等。

### 3. 管理基金情况

截止 2013 年 10 月 21 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、49 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势股票、嘉实 H 股指数 (QDII)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债、嘉实周期优选、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### (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

安奎先生,董事长,大学本科,中共党员,曾任吉林农业机械研究所主任;吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理;吉林省证券公司总经理;东北证券有限责

任公司监事长；吉林天信投资公司总经理；中诚信托有限责任公司副总经理。2011 年 8 月 5 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、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 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Wolfgang Matis 先生，董事，德国籍，法兰克福商学校经济专业（Frankfurt Business School of Economics）。曾任德意志银行全球固定收益负责人、全球市场负责人，董事总经理（MD）。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员、CEO 兼发言人。

Mark 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。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD。

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。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997 年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员。1998 年至 2000 年为北京大学法学院博士后研究人员、授课教师，曾任中国证监会并购重组审核委员会第一、二届委员，2000 年至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学商法研究中心副主任、法学院副教授。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北

京代表处首席代表、董事会秘书。2007 年 10 月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

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。

王利刚先生，监事，经济学学士。2001 年 2 月至今，就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部，历任人力资源部副总监、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，历任督察长和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员、硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学 MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004 年 3 月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

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

杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有 15 年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理，2003 年 3 月 15 日至 2004 年 7 月 7 日任万家（原天同）180 指数证券投资基金基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司指数投资部总监。2005 年 8 月 29 日至今任嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）（原嘉实沪深 300 指数（LOF））基金经理，2012 年 3 月 22 日至今任嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接基金经理，2012 年 5 月 7 日至今任嘉实沪深 300ETF 基金经理，2013 年 2 月 5 日至今任嘉实中证中期企业债指数（LOF）基金经理，2013 年 2 月 6 日至今任嘉实中证

500ETF 基金经理，2013 年 5 月 10 日至今任嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接基金经理。2013 年 3 月 22 日至今任本基金基金经理。

杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具有丰富的投资管理经验。

#### **(2) 历任基金经理**

本基金无历任基金经理。

#### **3、投资决策委员会**

本基金采取集体投资决策制度, 投资决策委员会的成员包括: 公司总经理赵学军先生、公司副总经理戴京焦女士, 总经理助理詹凌蔚先生、总经理助理邵健先生、定量投资部负责人张自力先生、机构投资部总监党开宇女士、资深基金经理陈勤先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### **(三) 基金管理人的职责**

1、依法募集基金, 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;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账, 进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案, 及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

#### **(四) 基金管理人承诺**

1、本基金管理人将根据基金合同的规定, 按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为, 并建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反法律法规行为的发生。

3、本基金管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将基金财产用于下列投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营，违反基金合同或托管协议；
- (2) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (5) 玩忽职守、滥用职权；
- (6) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (7) 除按依法进行基金资产管理外，直接或间接进行其他股票投资；
- (8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

### **(五) 基金管理人内部控制制度**

#### **1. 内部控制制度概述**

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

#### **2. 内部控制的原则**

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### **3. 内部控制组织体系**

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、总经理助理、总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长以及相关部门负责人组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。



(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

##### 5、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行资产总额 148,592.14 亿元，较上年末增长 6.34%。2013 年上半年，中国建设银行实现净利润 1,199.64 亿元，较上年同期增长 12.65%。年化资产回报率为 1.66%，年化加权净资产收益率为 23.90%。利息净收入 1,876.60 亿元，较上年

同期增长 10.59%。净利差为 2.54%，较上年同期提高 0.01 个百分点。净利息收益率为 2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入 555.24 亿元，较上年同期增长 12.76%。

中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有 10 家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等 5 家全资子公司，海外机构已覆盖到全球 14 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 27 家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013 年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近 30 个重要奖项。在英国《银行家》杂志 2013 年“世界银行 1000 强排名”中位列第 5，较上年上升 1 位；在美国《财富》世界 500 强排名第 50 位，较上年上升 27 位；在美国《福布斯》2013 年全球 2000 强上市企业排行榜中位列全球第 2，较上年提升 11 位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 225 人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 311 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

### （四）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

#### 3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事

故的发生，技术系统完整、独立。

### （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

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵虹		

##### （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 23 楼 01-03 室
------	--------------------------------------

电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	鲍东华		

## (3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段 86 号城市之心 30H		
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	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场 T1-1202		
电话	(0755) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	周炜		

## (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(0532) 66777766	传真	(0532) 66777676
联系人	陈建林		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331
联系人	徐莉莉		

## (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 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591) 88013673	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	简斌		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120

联系人	庄文胜
-----	-----

## 2、代销机构

## (1) 中国建设银行股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 25 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心		
法定代表人	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

## (2) 中国农业银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 69 号		
法定代表人	蒋超良	联系人	滕涛
电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

## (3) 中国银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号		
法定代表人	田国立		
电话	(010) 66596688	传真	(010) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

## (4) 中国工商银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街 55 号		
法定代表人	姜建清	联系人	刘业伟
电话	95588	传真	(010) 66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

## (5) 招商银行股份有限公司

住所、办公地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦		
法定代表人	傅育宁	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

## (6) 交通银行股份有限公司

办公地址	上海市银城中路 188 号		
注册地址	上海市银城中路 188 号		



法定代表人	牛锡明	联系人	曹榕
电话	021-58781234	传真	021-58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

## (7) 中信银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座		
法定代表人	常振明	联系人	丰靖
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

## (8) 渤海银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区马场道 201-205 号		
法定代表人	刘宝凤	联系人	王宏
电话	(022) 58316666	传真	(022) 58316569
网址	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

## (9) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦		
法定代表人	李伟	联系人	宋永成
电话	(0755) 25188064、 (0755) 25188263	传真	(0755) 25188785
网址	www.4001961200.com	客服电话	4001961200

## (10) 烟台银行股份有限公司

住所、办公地址	山东省烟台市芝罘区海港路 25 号		
法定代表人	叶文君	联系人	王淑华
电话	0535-6699660	传真	0535-6699884
网址	www.yantaibank.net	客服电话	4008-311-777

## (11) 包商银行股份有限公司

住所、办公地址	内蒙古包头市钢铁大街 6 号		
法定代表人	李镇西	联系人	张晶 刘芳
电话	(0472) 5109729	传真	(0472) 5176541
网址	http://www.bsb.com.cn	客服电话	0472-96016 010-96016 0574-967210 0755-967210 028-65558555

## (12) 嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元
----	-----------------------------------

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	www.harvestwm.cn /www.hwmfund.cn	客服电话	010-85572999

**(13) 杭州联合农村商业银行股份有限公司**

住所、办公地址	杭州市建国中路 99 号杭州联合银行大楼		
法定代表人	张晨	联系人	胡莹
电话	0571—87923324	传真	0571—87923214
网址	www.urcb.com	客服电话	96592

**(14) 万银财富（北京）基金销售有限公司**

办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元		
法定代表人	李招弟	联系人	高晓芳
电话	010-59393923	传真	010-59393074
网址	www.wy-fund.com	客服电话	400-808-0069

**(15) 上海好买基金销售有限公司**

办公地址	上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室		
注册地址	上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室		
法定代表人	杨文斌	联系人	张茹
电话	021-58870011	传真	021-68596916
网址	www.ehowbuy.com	客服电话	4007009665

**(16) 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	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

**(17) 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		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100

网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市 营业网点咨询电话
----	---------------	------	--------------------------

**(18) 申银万国证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市常熟路 171 号		
法定代表人	储晓明	联系人	李清怡
电话	(021) 54033888	传真	(021) 54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(021) 962505

**(19) 中国银河证券股份有限公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座		
法定代表人	陈有安	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

**(20) 华泰证券股份有限公司**

住所	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦、深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼		
办公地址	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦、深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼		
法定代表人	吴万善	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	025-51863323 (南京) 0755-82492962 (深圳)
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

**(21) 长城证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
法定代表人	黄耀华	联系人	刘阳
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006668888、(0755) 33680000

**(22) 国都证券有限责任公司**

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		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

**(23) 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		
---------	------------------	--	--

法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788 、 10108998

**(24) 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	天津市南开区滨水西道 8 号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

**(25) 安信证券股份有限公司**

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
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 深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355
网址	www.essence.com.cn	客服电话	4008001001

**(26) 东北证券股份有限公司**

住所、办公地址	长春市自由大路 1138 号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
电话	(0431) 85096709	传真	(0431) 85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431) 85096733

**(27) 平安证券有限责任公司**

住所	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755) 82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

**(28) 国元证券股份有限公司**

住所、办公地址	安徽省合肥市寿春路 179 号		
法定代表人	凤良志	联系人	陈玲玲
电话	(0551) 2246273	传真	(0551) 2272100
网址	www.gyzq.com.cn	客服电话	95578

**(29) 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	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

**(30) 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		
法定代表人	刘化军	联系人	王一彦
电话	(021) 20333910	传真	(021) 50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531; 400-888-8588

**(31) 宏源证券股份有限公司**

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010) 88085858	传真	(010) 88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

**(32) 新时代证券有限责任公司**

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		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	(010) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

**(33) 国金证券股份有限公司**

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028) 86690126	传真	(028) 86690126
网址	www.gjq.com.cn	客服电话	4006600109

**(34) 齐鲁证券有限公司**

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

**(35) 中山证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	(0755) 82570586	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

**(36) 天相投资顾问有限公司**

住所	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编: 100032		
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层 邮编: 100033		
法定代表人	林义相	联系人	林爽
电话	(010) 66045608	传真	(010) 66045500
网址	http://www.jjm.com.cn	客服电话	(010) 66045678

**(37) 江海证券有限公司**

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	张宇宏
电话	(0451) 82336863	传真	(0451) 82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

**(38) 华宝证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

**(39) 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		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
网址	www.cindasc.com	客服电话	400-800-8899

**(40) 国信证券股份有限公司**

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 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	齐晓燕
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

**(二) 基金注册登记机构**

---

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 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：安奎

总经理：赵学军

电话：(010) 65215588

传真：(010) 65185678

联系人：王玲

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所、办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19层

联系电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

负责人：韩炯

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(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 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金毅

经办注册会计师：许康玮、金毅

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会2012年11月27日《关于核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]1588号）核准募集。

### （二）基金运作方式和类型

- 1、基金的类别：联接基金
- 2、基金的运作方式：契约型开放式

### （三）基金存续期

不定期。

### （四）本基金与目标ETF的联系与区别

本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：

1、在基金的投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接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，实现对业绩比较基准的紧密跟踪；

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，实物申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

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：

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；

2、申购赎回的影响。目标ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；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。

### （五）基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象

1. 募集期：2013年2月21日至2013年3月20日。



## 2. 募集方式及场所:

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金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。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

## 3. 募集对象:

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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者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者。

### (六) 基金的认购

1、本基金认购费率不超过5%，按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体认购费率如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M < 50万元	1.0%
50万元 ≤ M < 200万元	0.6%
200万元 ≤ M < 500万元	0.3%
M ≥ 500万元	按笔收取，1000元/笔

本基金的认购费用由投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

## 2、募集资金利息的处理方式:

本基金的有效认购款项在基金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。利息的具体金额，以注册登记机构的记录为准。

## 3、认购份额的计算

本基金每份基金份额初始面值均为人民币1.00元。

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

$$(1) \text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率});$$

$$(2) \text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额};$$

$$(3) \text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额初始面值}.$$

其中：认购份数保留至0.01份基金份额，小数点后两位以后舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。

例一：某投资者投资10,000元认购本基金，如果其认购资金的利息为10元，则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.0\%) = 9,900.99 \text{元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{元}$$

$$\text{认购份数} = (9,900.99 + 10) / 1.00 = 9,910.99 \text{份}$$

即投资者投资10,000元认购本基金，可得到9,910.99份基金份额。

#### 4、募集资金

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。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于2013年3月22日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 八、基金份额的申购、赎回

### （一）基金投资者范围

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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者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者。

### （二）申购、赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定的代销机构另行公告。

### （三）申购、赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2013年5月13日起开始办理日常申购、赎回业务。

### （四）申购、赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须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体上公告。

#### （五）申购、赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### （六）申购、赎回的数额限制

### 1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币5,000元,投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元;但已持有本基金份额的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币1,000元。追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购,对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

### 2. 申请赎回基金的份额

单笔赎回不得少于1,000份(如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份,则必须一次性赎回基金全部份额);若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足1,000份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况,调整对申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上刊登公告并报中国证监会

## (七) 申购费用和赎回费用

1、本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高不超过5%,具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<50万元	1.2%
50万元≤M<200万元	0.8%
200万元≤M<500万元	0.4%
M≥500万元	单笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

2、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

持有期限	赎回费率
M<365 天	0.50%
365 天≤M<730 天	0.25%
M≥730 天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

#### （八）申购份额、赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

申购份额的计算结果保留至小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。

例二：二投资者分别提出申购请求，申购金额分别为110,000 元和1,100,000 元，当日基金份额净值为1.1000 元。申购份数计算如下：

	申购一	申购二
申购金额（元，A）	110,000	1,100,000

适用申购费率 (B)	1.2%	0.8%
净申购金额 (元, C)	108,695.65	1,091,269.84
申购费用 (元, D)	1,304.35	8,730.16
申购份额 (E=C/1.1)	98,814.22	992,063.49

## 2、赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额的计算结果保留至小数点后两位，小数点后两位以下舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。

例三：假定三笔赎回申请的赎回份额均为10,000份，但持有时间长短不同，其中基金份额净值为假设数，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额 (份, A)	10,000	10,000	10,000
基金份额净值 (元, B)	1.1000	1.3000	1.4000
持有时间	100天	366天	731天
适用赎回费率 (C)	0.5%	0.25%	0%
赎回总额 (元, D=A×B)	11,000	13,000	14,000
赎回费 (E=C×D)	55	32.5	0
赎回金额 (F=D-E)	10,945	12,967.5	14,000

## 3、基金份额净值计算

T日基金份额净值=T日基金资产净值/T日发行在外的基金份额总数。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留至小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。由此产生的误差在基金资产中列支。

## (九) 申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续2日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停



接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

#### (十一) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,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或无法受理投资者的申购申请。
2. 因特殊原因(包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市),导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 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;
4. 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。
5. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
6. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
8. 基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人利益的其他情形。
9. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形之一(第6项除外)且基金管理人决定拒绝或暂停申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## （十二）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，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无法正常运作或无法受理投资者的赎回申请。
2. 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 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；
4. 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；
5. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
6. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。发生上述情形之一且基金管理人决定暂停基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，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。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资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，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

## （十三）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒体上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

注：2013 年 4 月 9 日，本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自 2013 年 4 月 12 日起，在本公司基金网上直销系统（含电话交易）

---

---

开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统（含电话交易）交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。2013年9月13日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自2013年9月17日起，本基金开通网上直销后端收费模式，并执行上述优惠费率和业务规则。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

## 九、基金转换

基金转换是基金管理人给基金份额持有人提供服务的一种服务,是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件将其持有的某一只基金的基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。

### (一) 基金转换开始日及时间

本基金转换开始办理时间:2013年5月13日起。

### (二) 转换费率

(1) 嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B转换为嘉实中证500ETF联接时,转换费率均为转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

$$\text{净转入金额} = (\text{转出份额} \times \text{转出当日转出基金的基金份额净值}) / (1 + \text{转换费率}) + M$$

$$\text{转换费用} = (\text{转出份额} \times \text{转出当日转出基金的基金份额净值}) \times \text{转换费率} / (1 + \text{转换费率})$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / \text{转入当日转入基金的基金份额净值}$$

其中M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

(2) 嘉实中证500ETF联接与嘉实公司旗下原有其他23只开放式基金(包括:嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实中创400联接、嘉实优化红利、嘉实纯债债券、嘉实研究阿尔法股票)之间互转,以及嘉实中证500ETF联接转入嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B时,均采用“赎回费 + 申购费率补差”算法,计算公式如下:

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的申购补差费率，当转出基金的申购费率 $\geq$ 转入基金的申购费率时，则申购补差费率G为零；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

转出基金时,如涉及的转出基金有赎回费用,收取该基金的赎回费用。收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易等）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注：自2011年1月7日起，嘉实增长混合实施暂停转入业务；自2011年1月7日起，嘉实策略混合实施暂停转入业务；2012年6月8日起，嘉实货币A单日单个基金账户单笔申购（或转入、定投）不超过1亿元；2012年12月17日起，嘉实货币B单日单个基金账户单笔申购（或转入、定投）不超过1亿元；自2013年8月2日起，嘉实信用债券A、嘉实信用债券C单日单个基金账户单笔申购（或转入、定投）不超过100万元。。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

### （三）其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

（2）基金转换的原则：

①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金

管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

### （3）基金转换的程序

#### ①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时，帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### ②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

### （4）基金转换的数额限制

基金转换时，由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时，最低转出份额为1000份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

### （5）基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自T+2日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

### （6）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

### （7）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的转入申请：

（a）因不可抗力导致基金无法正常工作；

(b) 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(c) 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；

(d) 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转入的；

(e) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(f) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

(g) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(h) 基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人利益的其他情形；

(i) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的转出申请或者延缓支付转出款项：

(a) 因不可抗力的原因导致基金管理人不能支付转出款项；

(b) 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(c) 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；

(d) 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转出的；

(e) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(f) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(g) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(h) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③如发生基金合同、《招募说明书》或本公告中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准后在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

投资者到本基金代销机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各代销机构的规定为准。

---

---

## 十、定期定额投资计划

2013 年 5 月 13 日起基金管理人开始为投资人办理本基金基金份额的定期定额投资计划, 具体规则请参见基金管理人网站发布的相关公告。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额, 每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。



---

---

## 十一、基金的非交易过户、转托管、冻结和解冻

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

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，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

### （二）投资范围

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。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%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。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、中小企业私募债、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。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

### （三）投资策略

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。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上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

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。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

此外，为更好地实现投资目标，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。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。

本基金投资股指期货的，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。

本基金投资于股票期货、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

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以及调整决策。

### 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目标ETF的申购赎回清单分析、目标ETF流动性分析、标的指数成份证券相关信息的搜集与分析等，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) 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。

(4) 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。

(5) 组合监控与调整：基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征、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。

#### (四) 投资组合管理

##### 1、投资组合的建立

在基金建仓期，为避免有可能在二级市场造成的价格冲击，基金经理将主要采取一级市场申购的方式建立联接基金的初始投资组合。

##### 2、投资组合的日常管理

(1) 基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。

(2) 基金经理每日根据本基金申购赎回情况及已有现金滞留，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。

(3) 通常情况下，联接基金的投资组合主要体现为持有目标ETF基金份额；对于目标ETF暂停申购、停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的现金，基金经理将根据市场情况按照本基金的投资范围约定的其他投资品种进行投资。

##### 3、投资绩效评估

风险管理部门定期对本基金的运行情况和跟踪偏离进行量化评估并出具评估报告。基金经理根据评估报告分析投资操作、组合状况和跟踪误差来源等情况，并相应进行组合调整。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95% + 银行活期存款税后利率\*5%。

中证 500 指数由沪深 A 股市场中经营状况良好、价格无异常波动或市场操纵的 500 只股票组成，以调整股本为权数，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。

中证 500 指数是本基金目标 ETF 的标的指数。如果目标 ETF 变更标的指数、或中证 500 指数编制机构变更或停止中证 500 指数的编制及发布、或中证 500 指数由其他指数替代、或中证 500 指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中证 500 指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，变更本基金的业绩比较基准并及时公告。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。

### （六）风险收益特征

本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

### （七）投资禁止行为与限制

#### 1、禁止用本基金资产从事以下行为

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是本基金投资目标 ETF 或者法律法规、中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对本基金合同约定投资禁止行为进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述投资禁止行为，如适用于本基金，本基金可相应调整禁止行为。

## 2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(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%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金

所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(13) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入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 95%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值及目标 ETF 的 20%，本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；本基金所持有的股票市值、目标 ETF 和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 95%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；

(14) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%。

(15) 法律法规、基金合同规定的其他限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、股权分置改革中支付对价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 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

### （八）目标ETF发生相关变更情形时的处理

目标ETF出现下述情形之一的，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为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，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金《基金合同》中将去掉关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

(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；

(2) 目标ETF终止上市；

(3) 目标ETF基金合同终止；

(4) 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）。

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。

### （九）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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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 2013 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	3,344,387.16	3.66
	其中：股票	3,344,387.16	3.66



2	基金投资	81,293,178.93	88.91
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,203,497.59	5.69
7	其他资产	1,589,571.87	1.74
	合计	91,430,635.55	100.00

## 2. 报告期末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	739,584.00	0.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,258,184.76	2.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,335.00	0.05
E	建筑业	4,962.00	0.01
F	批发和零售业	13,650.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,522.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,162.00	0.10
J	金融业	8,847.00	0.01
K	房地产业	51,412.00	0.06
L	租赁和商务服务业	6,535.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	5,038.00	0.01
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	100,461.00	0.11
S	综合	7,694.40	0.01
	合计	3,344,387.16	3.72

**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**

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	000998	隆平高科	35,400	733,842.00	0.82
2	600198	大唐电信	35,700	462,672.00	0.52
3	000683	远兴能源	81,200	389,760.00	0.43
4	600654	飞乐股份	80,900	374,567.00	0.42
5	002252	上海莱士	15,300	321,300.00	0.36
6	600983	合肥三洋	22,181	220,922.76	0.25
7	600328	兰太实业	20,300	148,190.00	0.17
8	000719	大地传媒	7,200	69,192.00	0.08
9	002230	科大讯飞	400	18,480.00	0.02
10	600685	广船国际	1,600	15,744.00	0.02

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

报告期末，本基金未持有债券。

**5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

报告期末，本基金未持有债券。

**6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细**

报告期末，本基金未持有权证。

**8. 期末投资目标基金明细**

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实中证500ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	81,293,178.93	90.54

**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. 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	131,923.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,440.71
4	应收利息	1,308.05
5	应收申购款	1,278,830.08
6	其他应收款	174,069.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,589,571.87

### (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

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	000998	隆平高科	733,842.00	0.82	重大事项停牌
2	000683	远兴能源	389,760.00	0.43	重大事项停牌
3	600654	飞乐股份	374,567.00	0.42	重大事项停牌
4	002252	上海莱士	321,300.00	0.36	重大事项停牌
5	600983	合肥三洋	220,922.76	0.25	重大事项停牌
6	600328	兰太实业	148,190.00	0.17	重大事项停牌
7	000719	大地传媒	69,192.00	0.08	重大事项停牌

## 十三、基金的业绩

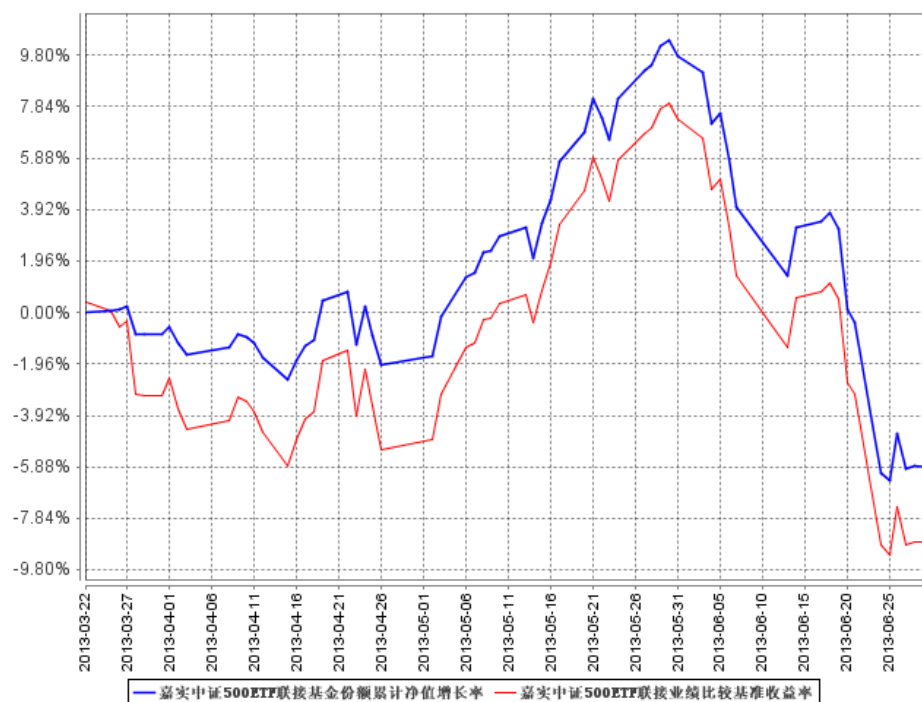
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 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	份额净值 增长率①	份额净值 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
2013年3月 22日（基金 合同生效日） 至 2013年6月 30日	-5.87%	1.26%	-8.75%	1.42%	2.88%	-0.16%

2.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

嘉实中证500ETF联接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



图：嘉实中证 500ETF 联接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

(2013 年 3 月 22 日至 2013 年 6 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日 2013 年 3 月 22 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 3 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“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

---

---

## 十四、基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十六、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （二）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （三）估值方法

#### 1、目标ETF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。

#### 2、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况

下，按成本估值。

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

7、中小企业私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

8、在任何情况下，基金管理人采用上述1-7项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人具有充足的理由认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基



金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
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；
3. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
4. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任

任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方。

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

### (八) 特殊情形的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金

---

资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十七、基金收益与分配

### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日基金份额净值自动转为基金份额；
3. 本基金收益每年最多分配 6 次，每基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每基金份额可供分配利润的 10%；
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
7. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

---

---

#### (五) 收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

## 十八、基金的费用与税收

### (一) 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. 基金资产的资金汇划费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
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. 基金的开户费用、账户维护费用；
9. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 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。在通常情况下，基金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 0.5% 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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，

经基金托管人复核后于次月首日起 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, 支付日期顺延。

## 2. 基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下, 基金托管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 0.1% 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

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用, 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。

### (四) 不列入基金费用的项目

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, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### (六) 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。



---

---

## 十九、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 二十、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### (一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

### (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

### (三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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登载于指定报刊和网站上。

### (四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

### (五) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2. 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。如相关法律法规另有规定的，从其规定。

### (六) 基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

### (七) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或

者年度报告。

5. 基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### (八) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时, 有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书, 予以公告, 并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案:

1. 基金份额持有人大会的召开及决议;
2. 终止基金合同;
3. 转换基金运作方式;
4. 更换基金管理人、基金托管人;
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
7. 基金募集期延长;
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚, 基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
14. 重大关联交易事项;
15. 基金收益分配事项;
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
18. 基金改聘会计师事务所;
19. 基金变更、增加或减少代销机构;
20. 基金更换注册登记机构;
21. 本基金开始办理申购、赎回;

22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 基金暂停接受申购、赎回申请；
26. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
27. 目标 ETF 变更；
28. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### (九)澄清公告

在本基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十)中国证监会规定的其他信息

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等。

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险,说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,基金管理人应在中国证监会指定媒体披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息,并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### (十一)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地,供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十一、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### （4）购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### （5）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### （二）本基金特有的风险

由于本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，因此目标 ETF 的特有风险也是本基金的特有风险。简要说明如下，具体情况可参见目标 ETF 招募说明书：

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理

和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(5) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

### 4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

### 5、其他投资于目标 ETF 的风险

包含目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、目标 ETF 退市风险及第三方机构服务的风险等等。

#### (三) 信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

#### （四）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### （五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### （六）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### （七）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （八）其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。



## 二十二、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

### (一) 基金合同的变更

1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2. 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3. 但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大不利变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### (三) 基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注

册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清

---

---

算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金合同内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(A) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法申请赎回其持有的基金份额；
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7. 监督基金管理人的投资运作；
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
9. 出席或者委派代表出席目标 ETF 份额持有人大会，对目标 ETF 份额持有人大会审议事项行使表决权，参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标 ETF 份额占本基金资产的比例折算；
10. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(B) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 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；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(C) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3. 发售基金份额；

4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5. 在符合有关法律法规、基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、收益分配等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8. 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券和参与转融通；

9. 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

10. 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

11. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

12. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

13. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

14. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

15. 依法召集基金份额持有人大会；

16. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(D) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，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；
2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7. 依法接受基金托管人的监督；
8. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
9. 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；
10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12. 编制季度、半年度和年度基金报告；
13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托

管人追偿；

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23. 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并通知基金托管人；

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (E) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6. 依法召集基金份额持有人大会；

7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；

8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (F) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 安全保管基金财产；

2. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6. 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 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；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（A）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人出席会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。



---

---

(B) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会决定修改基金合同的其他事项；
- (10) 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；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 尽管有前款的约定，但如出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 因相关法律法规、监管机关的监管规则、相关证券交易所或者登记结算机构业务规则等发生变动，且本基金须遵照执行的，本基金合同相应进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 基金管理人、相关证券交易所和注册登记机构在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(7) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(C) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(D) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 会议形式;

(4) 议事程序;

(5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;

(6) 代理投票的授权委托书证明的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

(7) 表决方式;

(8) 会务常设联系人姓名、电话;

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和书面表决方式, 并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人, 还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金托管人, 则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金份额持有人, 则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

(E) 基金份额持有人出席会议的方式

1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 在法律法规或监管机构允许的情况下, 经会议通知载明, 基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决, 或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(5) 会议的召开方式由召集人确定。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在表决截止日前发布至少 2 次相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和授权他人出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

6) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

## (F) 议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。现场开会可由召集人聘请公证机关现场监督。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码或企业法人营业执照号码(事业单位法人证书编号)、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)及其身份证号码或企业法人营业执照号码(事业单

位法人证书编号)等事项。

## (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (G) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效, 除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项, 应当依法报中国证监会核准或者备案, 并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时, 除非在计票时有充分的相反证据证明, 否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决, 表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## (H) 计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集, 则基金份额持有人大会的

主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

### (I) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

### (J) 本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面的联系

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。

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。

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。

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 份额持有人大会的,须先遵照本基金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 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 份额持有人大会。

(K)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

### (三) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算的方式

#### (A) 本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

1. 基金份额持有人大会决定终止的;
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
4. 中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定,行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。



## (B) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### （四）争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十四、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：嘉实基金基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元

法定代表人：安奎

成立时间：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】5号

注册资本：1.5亿元人民币

组织形式：有限责任公司（中外合资）

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：010-65215588

传真：010-65185678

联系人：付强

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；

从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（A）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。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%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。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、中小企业私募债、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。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

（B）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（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%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的

0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(9) 基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(10) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的5%，经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；因流通受限证券价格波动、基金规模变动、上市公司合并等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券并在流通受限期结束后卖出流通受限证券；

(11) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入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95%。其中，有价证券指股票、目标ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值及目标ETF的20%。本基金所持有的股票市值、目标ETF和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的95%。本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

(12) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、

交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、股权分置改革中支付对价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10个交易日内进行调整。

法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

(C) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性,并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生,如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易,基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生,只能进行事后结算,基金托管人不承担由此造成的损失,并向中国证监会报告。

(D) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金

托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人及时向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(E) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的

措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

(F) 基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助乙方的监督和核查。基金因投资中小企业私募债券导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。



(G) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金资产净值计算、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。

(H) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定, 应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函, 就基金托管人的疑义进行解释或举证, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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。

(I) 基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示, 基金管理人应在规定时间内答复并改正, 或就基金托管人的疑义进行解释或举证; 对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项, 基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(J) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反基金合同约定的, 应当立即通知基金管理人, 由此造成的损失由基金管理人承担。

(K) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金管理人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的, 基金托管人应报告中国证监会。

### (三) 基金管理人义务配合和协助基金托管人的业务核查

基金管理人应配合和协助基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通

知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产的保管

##### （A）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （B）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

2. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

(C) 基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

(D) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

(E) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场

债券回购主协议。

(F) 其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

(G) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

(H) 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

(五) 基金资产净值计算和会计复核

1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,经基金托管人复核,按规定公告。

2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本

基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的姓名或名称、持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的修改与终止

##### （A）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### （B）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十五、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 资料寄送

#### 1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易(除基金开户外其他交易类型)后的15个工作日内向基金份额持有人寄送开户确认书和交易对账单。

#### 2、基金份额持有人对账单

基金管理人在每年第1-3季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单,在每年第4季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单;每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者,敬请及时通过本公司网站,或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

### (二) 红利再投资

若基金份额持有人选择将基金收益以基金份额形式进行分配,该持有人当期分配所得的红利将按照除息日的基金份额净值自动转为本基金份额。红利再投资免收申购费用。

### (三) 定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划,投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### (四) 手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值短信服务。基金份额持有人可通过拨打客户服务电话400-600-8800(免长途话费)、(010) 85712266,也可通过基金管理人网站定制短信服务。

### （五）在线服务

通过本公司网站www.jsfund.cn，基金份额持有人还可获得如下服务：

#### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

#### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

#### 3、网上交易和电话交易服务

投资者可登录本基金管理人网站，通过直销网上交易办理认购/申购、赎回、转换、定期定额申购、定期定额赎回、定期定额转换、查询等业务。网上交易投资者开通电话交易后可以通过电话交易赎回、转换所持基金份额，持工行借记卡、建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、广发银行理财通卡、招行借记卡、中国民生银行借记卡、浦发银行东方卡等可以通过电话交易系统购买基金。具体参见相关公告。

### （六）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800(免长途话费)或(010) 85712266，传真：(010) 65182266。

#### 2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十六、其他应披露事项

自2013年2月7日首次披露本基金招募说明书至2013年9月22日，本基金的临时报告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于增加中信银行为嘉实中证 500ETF 联接基金代销机构的公告	2013 年 2 月 28 日	
2	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资	2013 年 3 月 23 日	

	资基金联接基金基金合同生效公告		
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行参加申购费率优惠活动的公告	2013 年 4 月 1 日	含本基金
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	2013 年 5 月 9 日	
5	嘉实基金管理有限公司关于增加杭州联合农村商业银行股份有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2013 年 6 月 20 日	含本基金
6	嘉实基金管理有限公司关于开通支付宝直销网上交易和电话交易业务的公告	2013 年 6 月 26 日	含本基金
7	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行参加申购费率优惠活动的公告	2013 年 7 月 4 日	含本基金
8	关于增加万银财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2013 年 8 月 16 日	含本基金
9	关于增加好买基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与好买基金费率优惠活动的公告	2013 年 8 月 16 日	含本基金
10	关于增加嘉实财富为嘉实旗下基金代销机构及参与嘉实财富费率优惠活动的公告	2013 年 8 月 19 日	含本基金
11	嘉实基金管理有限公司关于向开立农行对公账户的客户开通直销网上交易的公告	2013 年 8 月 31 日	含本基金
12	关于嘉实定制账户费率优惠以及新增定制账户“避风港”策略的公告	2013 年 9 月 12 日	
13	嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告	2013 年 9 月 13 日	含本基金
14	嘉实基金管理有限公司关于新增定制账户“避风港”策略的补充公告	2013 年 9 月 13 日	

## 二十七、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。



---

---

## 二十八、备查文件

1. 中国证监会核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
2. 《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合同》；
3. 《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

嘉实基金管理有限公司

2013年11月2日