

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020年1月23日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国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（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 2 月 6 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书更新与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节，并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	经雷
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、

总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至 2017 年 12 月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017 年 12 月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

韩家乐先生，董事，1990 年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990 年 2 月至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

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

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加入德意志银行以来，曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008 年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004 年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012 年 12 月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

雷霆先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998 年到 2008 年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008 年到 2013 年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013 年 10 月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018 年 3 月起任公司总经理。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999 年 7 月至 2003 年 10 月就职于首钢集团，2003 年 10 月至 2008 年 6 月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008 年 7 月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

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

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981 年 6 月至 1996 年 10 月任职于中办警卫局。1996 年 11 月至 1998 年 7 月于中国银行海外行管理部任副处长。1998 年 7 月至 1999 年 3 月任博时基金管理公司总经理助理。1999 年 3 月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2、基金经理

（1）现任基金经理

何如女士，硕士研究生，13 年证券从业经历，具有基金从业资格，加拿大籍。曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 20 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2015 年 8 月 6 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 14 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 5 月 23 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 8 月 8 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，14 年证券从业经历，具有基金从业资格，中国台湾籍。曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。2016 年 1 月 5 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 6 月 7 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 15 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016 年 3 月 24 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理、2019 年 1 月 14 日至今任嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）基金经理、2019 年 5 月 23 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 8 月 8 日至今任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

（2）历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2013 年 2 月 6 日至 2016 年 1 月 5 日。

3、Smart Beta 及量化投资决策委员会

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

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、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：田国立

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

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。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。

2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、

公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产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、战略客户部，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。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、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、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务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 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（二）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。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产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。

（三）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“新一代托管应用监督子系统”，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。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）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）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，如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、实物申购赎回代办券商

序号	代销机构名称	代销机构信息
1.	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号 法人代表：王常青

		<p>电话：(010) 65183880 传真：(010) 65182261 联系人：权唐 客服电话：400-8888-108 网址：http://www.csc108.com</p>
2.	国信证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：广东省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 法人代表：何如 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 联系人：李颖 客服电话：95536 网址：http://www.guosen.com.cn</p>
3.	招商证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层 法人代表：霍达 电话：(0755)82943666 传真：(0755)82943636 联系人：林生迎 客服电话：4008888111、95565 网址：http://www.cmschina.com</p>
4.	中信证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法人代表：张佑君 电话：010-60838888 联系人：郑慧 客服电话：95558 网址：http://www.cs.ecitic.com</p>
5.	中国银河证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层 法人代表：陈共炎 电话：010-83574507 传真：010-83574807 联系人：辛国政 客服电话：400-8888-888 网址：http://www.chinastock.com.cn</p>
6.	海通证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号</p>

		<p>法人代表：周杰 电话：(021)23219000 传真：(021)23219100 联系人：金芸、李笑鸣 客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址：http://www.htsec.com</p>
7.	申万宏源证券有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 法人代表：李梅 电话：021-33388214 传真：021-33388224 联系人：陈宇 客服电话：95523 或 4008895523 网址：http://www.swhysc.com</p>
8.	安信证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 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 法人代表：王连志 电话：(0755) 82825551 传真：(0755) 82558355 联系人：陈剑虹 客服电话：4008001001 网址：http://www.essence.com.cn</p>
9.	华泰证券股份有限公司	<p>注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号 办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号 法人代表：周易 电话：0755-82492193 传真：0755-82492962(深圳) 联系人：庞晓芸 客服电话：95597 网址：http://www.htsc.com.cn</p>
10.	中信证券(山东)有限责任公司	<p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 法人代表：姜晓林 电话：(0531) 89606166 传真：(0532) 85022605 联系人：焦刚 客服电话：95548 网址：http://sd.citics.com/</p>
11.	兴业证券股份有限公司	<p>注册地址：福建省福州市湖东路 268 号 办公地址：福建省福州市湖东路 268 号 法人代表：杨华辉 电话：021-38565547</p>

		<p>联系人：乔琳雪 客服电话：95562 网址：http://www.xyzq.com.cn</p>
12.	方正证券股份有限公司	<p>注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 法人代表：施华 电话：(010)59355997 传真：(010)56437013 联系人：丁敏 客服电话：95571 网址：http://www.foundersc.com</p>
13.	长城证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法人代表：曹宏 电话：(021)62821733 传真：(0755)83515567 联系人：金夏 客服电话：4006666888、(0755)33680000 网址：http://www.cgws.com</p>
14.	光大证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号 办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 法人代表：周健男 电话：(021) 22169999 传真：(021) 22169134 联系人：刘晨、李芳芳 客服电话：4008888788、10108998 网址：http://www.ebscn.com</p>
15.	申万宏源西部证券有限公司	<p>注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法人代表：李琦 电话：0991-2307105 传真：0991-2301927 联系人：王怀春 客服电话：4008-000-562 网址：www.hysec.com</p>
16.	中泰证券股份有限公司	<p>注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 办公地址：济南市市中区经七路 86 号 法人代表：李玮</p>

		<p>电话: 021-20315290 联系人: 许曼华 客服电话: 95538 网址: http://www.zts.com.cn/</p>
17.	中国国际金融股份有限公司	<p>注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 法人代表: 丁学东 电话: (010)65051166 传真: (010)85679203 联系人: 杨涵宇 客服电话: 400 910 1166 网址: http://www.cicc.com.cn</p>
18.	宏信证券有限责任公司	<p>注册地址: 成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼 办公地址: 成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 法人代表: 吴玉明 电话: 028-86199278 传真: 028-86199382 联系人: 刘进海 客服电话: 4008366366 网址: http://www.hx818.com</p>
19.	新时代证券股份有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法人代表: 叶顺德 电话: (010)83561146 联系人: 田芳芳 客服电话: 95399 网址: http://www.xsdzq.cn</p>
20.	国盛证券有限责任公司	<p>注册地址: 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 法人代表: 徐丽峰 电话: (0791)86283372 传真: (0791)86281305 联系人: 占文驰 客服电话: 4008222111 网址: www.gsyzq.com</p>

2、二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

（二） 登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
 住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
 法定代表人：金颖
 联系人：刘玉生
 电话：（010）66213961
 传真：（010）59378907

（三） 律师事务所和经办律师

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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	周祎
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

四、基金名称

本基金名称：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、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。

八、基金的投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原

因)导致无法获得足够数量的股票时, 或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时, 基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合, 以达到跟踪标的指数的目的。

本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品, 如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货后, 基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况, 包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等, 并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、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

投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策; 基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行, 避免重大风险的发生。

(1) 研究: 指数投资研究小组依托公司整体研究平台, 整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作, 撰写研究报告, 作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策: 投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告, 定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议, 决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议, 每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建: 根据标的指数相关信息, 结合内部指数投资研究, 基金经理主要以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下, 基金经理将采取适当指数投资的方法, 以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行：中央交易部门负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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

九、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：中证 500 指数。

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。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其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。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 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	2,393,149,056.37	98.06
	其中：股票	2,393,149,056.37	98.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	17,000,000.00	0.70
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	21,613,251.17	0.89
8	其他资产	8,835,722.97	0.36
9	合计	2,440,598,030.51	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	26,505,764.00	1.09
B	采矿业	76,651,302.50	3.14
C	制造业	1,338,546,886.95	54.88
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应 业	76,011,036.43	3.12
E	建筑业	42,546,149.09	1.74
F	批发和零售业	130,844,358.63	5.36
G	交通运输、仓储和 邮政业	80,920,465.27	3.32
H	住宿和餐饮业	9,215,234.40	0.38
I	信息传输、软件和	229,682,024.58	9.42

	信息技术服务业		
J	金融业	107,505,314.39	4.41
K	房地产业	111,156,293.08	4.56
L	租赁和商务服务业	32,915,597.28	1.35
M	科学研究和技术服务业	3,339,099.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	21,294,593.08	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,078,668.40	0.33
Q	卫生和社会工作	14,621,455.32	0.60
R	文化、体育和娱乐业	49,935,852.60	2.05
S	综合	32,720,836.18	1.34
	合计	2,392,490,931.18	98.09

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.01
C	制造业	176,907.28	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	636,918.83	0.03

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	982,750	15,822,275.00	0.65
2	000860	顺鑫农业	324,991	15,160,830.15	0.62
3	600872	中炬高新	348,952	14,945,614.16	0.61
4	002157	正邦科技	742,300	12,366,718.00	0.51
5	002049	紫光国微	265,900	11,728,849.00	0.48
6	300253	卫宁健康	812,363	11,519,307.34	0.47
7	600201	生物股份	725,810	11,387,958.90	0.47
8	000066	中国长城	1,102,705	11,335,807.40	0.46
9	002195	二三四五	2,889,440	11,239,921.60	0.46
10	600739	辽宁成大	765,900	11,136,186.00	0.46

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00

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序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序的前十名资产支持证券

投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1909	IC1909	47	45,247,840.00	1,183,840.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,183,840.00
股指期货投资本期收益（元）					-3,126,899.81
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,312,920.00

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2018 年 7 月 20 日，江西正邦科技股份有限公司发布关于公司下属分子公司收到《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》的公告，公告披露江西正邦科技股份有限公

司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司因环保不达标收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕180506 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0608 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0608 号）以及江西正邦科技股份有限公司子公司的其他处罚决定，受处罚金额累计为 205 万元。

本基金投资于“正邦科技（002157）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，正邦科技为标的指数的成份股，本基金投资于“正邦科技”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,450,028.11
2	应收证券清算款	3,377,936.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,758.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,835,722.97

（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

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.00	新股流通受限

十二、基金业绩

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

（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）-2013 年 12 月 31 日	7.58%	1.41%	8.76%	1.45%	-1.18%	-0.04%
2014 年	38.49%	1.23%	39.01%	1.24%	-0.52%	-0.01%
2015 年	40.06%	2.81%	43.12%	2.82%	-3.06%	-0.01%
2016 年	-15.27%	1.85%	-17.78%	1.90%	2.51%	-0.05%
2017 年	1.87%	0.92%	-0.20%	0.93%	2.07%	-0.01%
2018 年	-32.24%	1.51%	-33.32%	1.51%	1.08%	0.00%
2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日	19.27%	1.79%	18.77%	1.79%	0.50%	0.00%

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

嘉实中证500ETF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 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 2 月 6 日至 2019 年 6 月 30 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 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“第十四部分(二)投资范围和(七)投资限制”的有关约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费；
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. 基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；

10. 基金的上市费和年费；

11. 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；

12. 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) 基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。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

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

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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. 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，计费区间不足一季度的，以一季度计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

（四）与基金销售有关的费用

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（五）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。

（六）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。

（七）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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分：本次更新招募说明书更新的主要内容。
- 2、在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关内容。
- 3、在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关内容。
- 4、在“五、相关服务机构”部分：更新相关直销机构、会计师事务所的信息。

5、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节。

嘉实基金管理有限公司
2020 年 1 月 23 日