

# 嘉实中创 400 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

(2020年04月24日更新)

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

## 重要提示

嘉实中创 400 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 1 月 6 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中创 400 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]13 号）和 2012 年 2 月 9 日《关于中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]52 号）的核准进行募集。本基金类型为契约型开放式。本基金基金合同于 2012 年 3 月 22 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

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。嘉实中创 400 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”）为中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“中创 400ETF”）的联接基金，主要通过投资于中创 400ETF 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创 400 指数及中创 400ETF 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 2020 年 4 月 3 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日（未经审计），特别事项注明除外。

## 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	24
六、基金的募集.....	55
七、基金合同的生效.....	58
八、基金份额的申购、赎回.....	59
九、基金转换.....	68
十、定期定额投资计划.....	73
十一、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	74
十二、基金的投资.....	75
十三、基金的业绩.....	85
十四、基金的融资、融券.....	88
十五、基金的财产.....	89
十六、基金资产估值.....	91
十七、基金收益与分配.....	95
十八、基金的费用与税收.....	97
十九、基金的会计与审计.....	99
二十、基金的信息披露.....	100
二十一、风险揭示.....	105
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	109
二十三、基金合同内容摘要.....	112
二十四、基金托管协议的内容摘要.....	125
二十五、对基金份额持有人的服务.....	137
二十六、其他应披露事项.....	139
二十七、招募说明书存放及查阅方式.....	140
二十八、备查文件.....	141

## 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》）、《公开募集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》）、《公开募集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〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规以及《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。

招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 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	《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新
基金合同或《基金合同》	《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创 400 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	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件及其不时修订
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》及有权机关对该法不时修订或更新的版本
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本
《运作办法》	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布，于 2004 年 7 月 1 日起实施并于 2014 年 7 月 7 日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订
《信息披露办法》	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本
《流动性风险管理规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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《嘉实中创 400 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	《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额发售公告》
基金产品资料概要	指《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接

	基金基金产品资料概要》及其更新（本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）
《业务规则》	《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	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基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等
基金注册登记机构	嘉实基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
基金合同当事人	受基金合同约束，根据基金合同享受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	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司

	以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
标的指数	深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司编制并发布的中创 400 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。本基金以中创 400 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中创 400ETF”）为目标 ETF
ETF 联接基金	将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，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，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标 ETF 的 ETF 联接基金
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
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
日/天	公历日
月	公历月
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	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	办理申购、赎回或其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额

	的行为
申购	在基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	在基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为
巨额赎回	在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金份额认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的行为
基金转换	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
基金利润	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
期末可供分配利润	期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数
收益分配基准日	即可供分配利润计算截至日，以该日日终的会计核算结果为基准计算基金的可供分配利润，评估收益分配条件
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本



	基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值，针对某一类基金份额，指计算日本类别基金份额的基金资产净值除以计算日该类别基金份额的基金份额总数
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
指定媒介	中国证监会指定的用以进行信息披露全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）
不可抗力	当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律及政策变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。
销售服务费	指从相应类别基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用。
基金份额类别	指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额

### 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	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。

##### 2、管理基金情况

截止 2020 年 3 月 31 日，基金管理人共管理 181 只开放式证券投资基金，具体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、嘉实优质企业混合、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）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先

成长混合、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）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、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、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹

三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动ETF联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF。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，基金管理人还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

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。

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

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

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

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

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

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

刘珈吟女士，硕士研究生，10 年证券从业经历，具有基金从业资格。2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。2016 年 3 月 24 日至今任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至今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、2016 年 3 月 24 日至今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、2016 年 3 月 24 日至今任嘉实深证基本面 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 3 月 24 日至今任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至今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 3 月 24 日至今任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 3 月 24 日至今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、2017 年 6 月 7 日至今任嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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 3 月 30 日至今任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 3 月 30 日至今任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 20 日至今任嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

李直先生，硕士研究生，5 年证券从业经历，具有基金从业资格。2014 年 7 月加入嘉实基金，从事指数基金投资研究工作。2017 年 12 月 26 日至今任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 12 月 26 日至今任嘉实深证基本面 120 交易型开放

式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 3 月 30 日至今任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 3 月 30 日至今任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 9 月 26 日至今任嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至今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、2019 年 9 月 28 日至今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、2019 年 9 月 28 日至今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、2019 年 9 月 28 日至今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、2019 年 9 月 28 日至今任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 11 月 1 日至今任嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 12 月 5 日至今任嘉实中证先进制造 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

#### （2）历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2012 年 3 月 22 日至 2014 年 5 月 9 日；何如女士，管理时间为 2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 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。

#### （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、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、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、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

- 8、办理与基金资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、保存基金资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）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，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，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- （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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、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）当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### 4、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(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) Smart Beta 及量化投资决策委员会由公司总经理、总监及资深基金经理组成，负责指导权益类基金资产的运作、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、督察长及部门总监组成，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工作流程、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资产的状况。

(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）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
成立时间：1984 年 1 月 1 日  
法定代表人：陈四清  
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十二次顺利通过评估组

织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

#### 1、内部风险控制目标

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

#### 2、内部风险控制组织结构

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

#### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取

了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

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

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

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

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

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

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

## 5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、

信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

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

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

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

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

## 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	北京市东城区建国门南大街 7 号北京万豪中心 D 座 12 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	黄娜		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	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		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	邵琦		

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元		
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	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层		
电话	0755-84362200	传真	(0755) 25870663
联系人	陈寒梦		

##### （5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 3101 室		
电话	(0532) 66777997	传真	(0532) 66777676
联系人	胡洪峰		

##### （6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室		
------	--------------------------------------	--	--



电话	(0571) 88061392	传真	(0571) 88021391
联系人	王振		

## (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 137 号信合广场 801A 单元		
电话	(0591) 88013670	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	徐莉莉		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心裙楼 103、203 单元		
电话	(020) 62305005	传真	(020) 62305005
联系人	周炜		

## 2、代销机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国工商银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人: 陈四清 联系人: 杨菲 传真: 010-66107914 客服电话: 95588 网址: <a href="http://www.icbc.com.cn">http://www.icbc.com.cn</a> , <a href="http://www.icbc-ltd.com">http://www.icbc-ltd.com</a>
2	中国农业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人: 周慕冰 电话: (010)85108227 传真: (010)85109219 客服电话: 95599 网址: <a href="http://www.abchina.com">http://www.abchina.com</a>
3	中国银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 中国北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人: 刘连舸 电话: (010)66596688 传真: (010)66594946

		<p>客服电话：95566</p> <p>网址：<a href="http://www.boc.cn">http://www.boc.cn</a></p>
4	交通银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号</p> <p>法定代表人：任德奇</p> <p>联系人：王菁</p> <p>电话：021-58781234</p> <p>传真：021-58408483</p> <p>客服电话：95559</p> <p>网址：<a href="http://www.bankcomm.com">http://www.bankcomm.com</a></p>
5	中信银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号</p> <p>法定代表人：李庆萍</p> <p>联系人：丰靖</p> <p>客服电话：95558</p> <p>网址：<a href="http://www.citicbank.com">http://www.citicbank.com</a></p>
6	上海浦东发展银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市中山东一路 12 号</p> <p>法定代表人：郑杨</p> <p>联系人：江逸舟、赵守良</p> <p>电话：(021)61618888</p> <p>传真：(021)63604199</p> <p>客服电话：95528</p> <p>网址：<a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a></p>
7	兴业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：福建省福州市湖东路 154 号</p> <p>法定代表人：陶以平（代）</p> <p>联系人：卞晷煜</p> <p>电话：(021) 52629999</p> <p>传真：(021) 62569070</p> <p>客服电话：95561</p> <p>网址：<a href="http://www.cib.com.cn">http://www.cib.com.cn</a></p>
8	中国民生银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦</p> <p>法定代表人：洪崎</p> <p>联系人：王志刚</p> <p>电话：(010)58560666</p> <p>客服电话：95568</p> <p>网址：<a href="http://www.cmbc.com.cn">http://www.cmbc.com.cn</a></p>
9	中国邮政储蓄银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市西城区金融大街 3 号</p> <p>法定代表人：张金良</p> <p>联系人：王硕</p> <p>传真：(010) 68858057</p> <p>客服电话：95580</p> <p>网址：<a href="http://www.psbc.com">http://www.psbc.com</a></p>
10	上海银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号</p> <p>法定代表人：金煜</p> <p>联系人：王笑</p>

		电话：021-68475888 传真：021-68476111 客服电话：95594 网址： <a href="http://www.bosc.cn">http://www.bosc.cn</a>
11	上海农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号 法定代表人：徐力 联系人：施传荣 电话：021-38523692 传真：021-50105124 客服电话：(021)962999 网址： <a href="http://www.srcb.com/">http://www.srcb.com/</a>
12	青岛银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 法定代表人：郭少泉 联系人：徐伟静 电话：0532-68629925 传真：0532-68629939 客服电话：96588(青岛)、4006696588(全国) 网址： <a href="http://www.qdccb.com/">http://www.qdccb.com/</a>
13	徽商银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座 法定代表人：李宏鸣 联系人：顾伟平 电话：0551-65898103 传真：0551-62667684 客服电话：4008896588 网址： <a href="http://www.hsbank.com.cn">http://www.hsbank.com.cn</a>
14	浙商银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号 法定代表人：沈仁康 联系人：唐燕 电话：(0571) 87659056 传真：(0571) 87659554 客服电话：95527 网址： <a href="http://www.czbank.com">http://www.czbank.com</a>
15	东莞银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号 法定代表人：卢国锋 联系人：朱杰霞 电话：0769-22111802 传真：0769-23156406 客服电话：956033 网址： <a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>
16	杭州银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：杭州市下城区庆春路 46 号 法定代表人：陈震山 联系人：严峻 电话：(0571)85108309

		传真：(0571)85108309 客服电话：400-888-8508 网址： <a href="http://www.hzbank.com.cn">http://www.hzbank.com.cn</a>
17	临商银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：山东省临沂市兰山区北京路 37 号 法定代表人：钱进 联系人：寇廷柱 电话：(0539)8304657 传真：(0539)8051127 客服电话：400-699-6588 网址： <a href="http://www.lsbchina.com">http://www.lsbchina.com</a>
18	温州银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：温州市车站大道 196 号 法定代表人：叶建清 联系人：林波 电话：(0577) 88990082 传真：(0577) 88995217 客服电话：(0577) 96699 网址： <a href="http://www.wzbank.cn/">http://www.wzbank.cn/</a>
19	汉口银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：湖北省武汉市江汉区建设大道 933 号 法定代表人：陈新民 联系人：黄惠琼 电话：027-82656224 传真：027-82656099 客服电话：027-96558（武汉）；4006096558（全国） 网址： <a href="http://www.hkbchina.com">http://www.hkbchina.com</a>
20	江苏银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：江苏省南京市中华路 26 号 法定代表人：夏平 联系人：张洪玮 电话：(025)58587036 传真：(025)58587820 客服电话：95319 网址： <a href="http://www.jsbchina.cn">http://www.jsbchina.cn</a>
21	深圳农村商业银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 法定代表人：李光安 联系人：常志勇 电话：0755-25188781 传真：0755-25188785 客服电话：961200(深圳) 网址： <a href="http://www.4001961200.com">http://www.4001961200.com</a>
22	乌鲁木齐银行股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号 法定代表人：任思宇 联系人：何佳 电话：(0991)8824667 传真：(0991)8824667

		<p>客服电话：(0991)96518</p> <p>网址：<a href="http://www.uccb.com.cn">http://www.uccb.com.cn</a></p>
23	烟台银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号</p> <p>法定代表人：吴明理</p> <p>联系人：王淑华</p> <p>电话：0535-6699660</p> <p>传真：0535-6699884</p> <p>客服电话：4008-311-777</p> <p>网址：<a href="http://www.yantaibank.net">http://www.yantaibank.net</a></p>
24	哈尔滨银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：黑龙江省哈尔滨市道里区尚志大街 160 号</p> <p>法定代表人：郭志文</p> <p>联系人：王超</p> <p>电话：0451-86779007</p> <p>传真：0451-86779218</p> <p>客服电话：95537</p> <p>网址：<a href="http://www.hrbb.com.cn">http://www.hrbb.com.cn</a></p>
25	浙江稠州商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：浙江省杭州市上城区望潮路 158 号稠银大厦</p> <p>法定代表人：金子军</p> <p>联系人：董晓岚、张予多</p> <p>电话：(0571)87117616</p> <p>传真：(0571)87117607</p> <p>客服电话：(0571)96527、4008096527</p> <p>网址：<a href="http://www.czcb.com.cn/">http://www.czcb.com.cn/</a></p>
26	天津银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：天津市河西区友谊路 10 号</p> <p>法定代表人：李宗唐</p> <p>联系人：杨森</p> <p>电话：(022) 28405330</p> <p>传真：(022) 28405631</p> <p>客服电话：4006-960296</p> <p>网址：<a href="http://www.bankoftianjin.com">http://www.bankoftianjin.com</a></p>
27	河北银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：河北省石家庄市平安北大街 28 号</p> <p>法定代表人：乔志强</p> <p>联系人：王娟</p> <p>电话：0311-88627587</p> <p>传真：0311-88627027</p> <p>客服电话：4006129999</p> <p>网址：<a href="http://www.hebbank.com">http://www.hebbank.com</a></p>
28	江苏江南农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号</p> <p>法定代表人：陆向阳</p> <p>联系人：包静</p> <p>电话：13951229068</p> <p>传真：0519-89995170</p>

		<p>客服电话：96005</p> <p>网址：<a href="http://www.jnbank.com.cn">http://www.jnbank.com.cn</a></p>
29	<p>江苏昆山农村商业银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：江苏省昆山市前进东路 828 号</p> <p>法定代表人：张哲清</p> <p>联系人：黄怡</p> <p>电话：0512-57379810</p> <p>传真：0512-57370750</p> <p>客服电话：0512-96079</p> <p>网址：<a href="http://www.ksrbc.cn">http://www.ksrbc.cn</a></p>
30	<p>吉林银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号</p> <p>法定代表人：张宝祥</p> <p>联系人：孟明</p> <p>电话：0431-84992680</p> <p>传真：0431-84992649</p> <p>客服电话：4008896666</p> <p>网址：<a href="http://www.jlbank.com.cn">http://www.jlbank.com.cn</a></p>
31	<p>苏州银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号</p> <p>法定代表人：王兰凤</p> <p>联系人：熊志强</p> <p>电话：0512-69868390</p> <p>传真：0512-69868370</p> <p>客服电话：0512-96067</p> <p>网址：<a href="http://www.suzhoubank.com">http://www.suzhoubank.com</a></p>
32	<p>杭州联合农村商业银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：浙江省杭州市上城区建国中路 99 号</p> <p>法定代表人：张海林</p> <p>联系人：胡莹</p> <p>电话：0571—87923324</p> <p>传真：0571—87923214</p> <p>客服电话：96592</p> <p>网址：<a href="https://www.urcb.com/">https://www.urcb.com/</a></p>
33	<p>威海市商业银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：山东省威海市宝泉路 9 号</p> <p>法定代表人：谭先国</p> <p>联系人：刘文静</p> <p>电话：0631-5211651</p> <p>传真：0631-5215726</p> <p>客服电话：4000096636</p> <p>网址：<a href="http://www.whccb.com/">http://www.whccb.com/</a></p>
34	<p>四川天府银行股份有限公司</p> <p>注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97 号 26 栋</p> <p>法定代表人：邢敏</p> <p>联系人：樊海波</p> <p>电话：028-67676033</p> <p>传真：028-67676033</p> <p>网址：<a href="http://www.tf.cn">http://www.tf.cn</a></p>

35	日照银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 中国山东省日照市烟台路 197 号 法定代表人: 王森 联系人: 孔颖 电话: 0633-8081590 传真: 0633-8081276 客服电话: 4006896588 网址: <a href="http://www.bankofrizhao.com.cn">http://www.bankofrizhao.com.cn</a>
36	福建海峡银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 福建省福州市台江区江滨中大道 358 号 海峡银行大厦 法定代表人: 俞敏 联系人: 吴白玫 电话: 0591-87838759 传真: 0591-87388016 客服电话: 4008939999 网址: <a href="http://www.fjhxbank.com">http://www.fjhxbank.com</a>
37	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 浙江省绍兴市柯桥区柯桥笛扬路 1363 号 法定代表人: 俞俊海 联系人: 孔张海 电话: 0575-84788101 传真: 0575-84788100 客服电话: 4008896596 网址: <a href="http://www.borf.cn/">http://www.borf.cn/</a>
38	浙江温州龙湾农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 温州市龙湾区永中街道永宁西路 555 号 法定代表人: 刘少云 联系人: 胡俊杰 电话: 0577-86923223 传真: 0577-86982650 客服电话: 4008296596 网址: <a href="http://www.lwrcb.com/">http://www.lwrcb.com/</a>
39	泉州银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 泉州市丰泽区云鹿路 3 号 法定代表人: 傅子能 联系人: 董培姗、王燕玲 电话: 0595-22551071 传真: 0595-22578871 客服电话: 4008896312 网址: <a href="http://www.qzccbank.com/">http://www.qzccbank.com/</a>
40	锦州银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市东城区建国门北大街 5 号 法定代表人: 张伟 联系人: 张华阳 电话: 0416-3220085 传真: 0416-3220017 客服电话: 400-6696178 网址: <a href="http://www.jinzhoubank.com">http://www.jinzhoubank.com</a>

41	华融湘江银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 湖南省长沙市湘府东路二段 208 号万境财智中心南栋 法定代表人: 张永宏 联系人: 杨舟 电话: 0731-89828900 客服电话: 0731-96599 网址: <a href="http://www.hrxjbank.com.cn/">http://www.hrxjbank.com.cn/</a>
42	浙江乐清农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 乐清市城南街道伯乐西路 99 号 法定代表人: 高剑飞 联系人: 金晓娇 电话: 0577-61566028 传真: 0577-61566063 客服电话: 4008896596 网址: <a href="http://www.yqbank.com/">http://www.yqbank.com/</a>
43	桂林银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 桂林市临桂区公园北路 8 号 法定代表人: 吴东 联系人: 周佩玲 传真: 0773-3851691 客服电话: 4008696299 网址: <a href="http://www.guilinbank.com.cn">http://www.guilinbank.com.cn</a>
44	浙江杭州余杭农村商业银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街 72 号 法定代表人: 来煜标 联系人: 蔡亮 电话: 0571-86209980 传真: 0571-86137150 客服电话: 96596/4008896596 网址: <a href="http://www.yhrbc.com/">http://www.yhrbc.com/</a>
45	天相投资顾问有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 西城区新街口外大街 28 号院 C 座 505 法定代表人: 林义相 联系人: 谭磊 电话: 010-66045182 传真: 010-66045518 客服电话: 010-66045678 网址: <a href="http://txsec.com">txsec.com</a>
46	和讯信息科技有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层 法定代表人: 王莉 联系人: 刘洋 传真: 8610-65884788 客服电话: 4009200022 网址: <a href="http://www.hexun.com/">http://www.hexun.com/</a>
47	上海长量基金销售投资顾问有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人: 张跃伟



		<p>联系人：单丙焯  电话：021-20691869  传真：021-20691861  客服电话：400-089-1289  网址：<a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a></p>
48	北京展恒基金销售股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市朝阳区安苑路 15 号邮电新闻大厦  法定代表人：闫振杰  联系人：李静如  电话：010-59601366-7024  客服电话：4008886661  网址：<a href="http://www.myfund.com">http://www.myfund.com</a></p>
49	上海利得基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  法定代表人：李兴春  联系人：曹怡晨  电话：021-50583533  传真：021-50583633  客服电话：400-921-7755  网址：<a href="http://www.leadfund.com.cn">http://www.leadfund.com.cn</a></p>
50	北京创金启富基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：中国北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A  法定代表人：梁蓉  联系人：魏素清  电话：010-66154828  传真：010-63583991  客服电话：400-6262-818  网址：<a href="http://www.5irich.com">http://www.5irich.com</a></p>
51	宜信普泽(北京)基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 15 层 1809  法定代表人：戎兵  联系人：魏晨  电话：010-52413385  传真：010-85894285  客服电话：400-6099-200  网址：<a href="http://www.yixinfund.com">http://www.yixinfund.com</a></p>
52	深圳腾元基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：深圳市福田区华富街道深南中路 4026 号田面城市大厦 18 层 b  法定代表人：曾革  联系人：鄢萌莎  电话：0755-33376922  传真：0755-33065516  客服电话：4006877899  网址：<a href="http://www.tenyuanfund.com">http://www.tenyuanfund.com</a></p>
53	北京恒天明泽基金销售有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛中心 30 层</p>

	注:只代销 A 份额。	法定代表人: 周斌 联系人: 侯艳红 电话: 010-53572363 传真: 010-59313586 客服电话: 400-8980-618 网址: <a href="http://www.chtfund.com/">http://www.chtfund.com/</a>
54	北京广源达信基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层 法定代表人: 齐剑辉 联系人: 王英俊 电话: 010-57298634 传真: 010-82055860 客服电话: 4006236060 网址: <a href="http://www.niuniufund.com">http://www.niuniufund.com</a>
55	上海大智慧基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元 法定代表人: 申健 联系人: 宋楠 电话: 021-20219988-37492 传真: 021-20219923 客服电话: 021-20292031 网址: <a href="https://www.wg.com.cn/">https://www.wg.com.cn/</a>
56	北京加和基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 C 座 709 室 法定代表人: 曲阳 联系人: 徐娜 电话: 010-68292940 传真: 010-68292941 客服电话: 010-68292745 网址: <a href="http://www.bzfunds.com">http://www.bzfunds.com</a>
57	济安财富(北京)基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层 法定代表人: 杨健 联系人: 李海燕 电话: 010-65309516 传真: 010-65330699 客服电话: 400-673-7010 网址: <a href="http://www.jianfortune.com">http://www.jianfortune.com</a>
58	上海联泰资产管理有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 楼 法定代表人: 燕斌 联系人: 兰敏 电话: 021-52822063 传真: 021-52975270

		<p>客服电话：400-166-6788</p> <p>网址：<a href="http://www.66zichan.com">http://www.66zichan.com</a></p>
59	上海汇付基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼</p> <p>法定代表人：金佶</p> <p>联系人：陈云卉</p> <p>电话：021-33323998</p> <p>传真：021-33323837</p> <p>客服电话：400-820-2819</p>
60	上海中正达广基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室</p> <p>法定代表人：黄欣</p> <p>联系人：戴珉微</p> <p>电话：021-33768132</p> <p>传真：021-33768132*802</p> <p>客服电话：400-6767-523</p> <p>网址：<a href="http://www.zzwealth.cn">http://www.zzwealth.cn</a></p>
61	北京虹点基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元</p> <p>法定代表人：郑毓栋</p> <p>联系人：姜颖</p> <p>电话：13522549431</p> <p>传真：010-65951887</p> <p>客服电话：400-068-1176</p> <p>网址：<a href="http://www.hongdianfund.com">http://www.hongdianfund.com</a></p>
62	上海陆金所基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元</p> <p>法定代表人：胡学勤</p> <p>联系人：宁博宇</p> <p>电话：021-20665952</p> <p>传真：021-22066653</p> <p>客服电话：4008219031</p> <p>网址：<a href="http://www.lufunds.com">http://www.lufunds.com</a></p>
63	大泰金石基金销售有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室</p> <p>法定代表人：袁顾明</p> <p>联系人：朱海涛</p> <p>电话：15921264785</p> <p>传真：021-20324199</p> <p>客服电话：400-928-2266</p> <p>网址：<a href="http://www.dtfortune.com/">http://www.dtfortune.com/</a></p>
64	中证金牛(北京)投资咨询有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层</p> <p>法定代表人：钱昊旻</p> <p>联系人：仲甜甜</p>

		电话：010-59336492 传真：010-59336510 客服电话：010-59336512 网址： <a href="http://www.jnlc.com">http://www.jnlc.com</a>
65	上海华夏财富投资管理有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 法定代表人：毛淮平 联系人：仲秋玥 电话：010-88066632 传真：010-88066214 客服电话：400-817-5666 网址： <a href="https://www.amcfortune.com/">https://www.amcfortune.com/</a>
66	国泰君安证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：上海市静安区南京西路 768 号 法定代表人：贺青 联系人：黄博明 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：4008888666 网址： <a href="http://www.gtja.com">http://www.gtja.com</a>
67	中信建投证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号 法定代表人：王常青 联系人：权唐 电话：(010) 65183880 传真：(010) 65182261 客服电话：400-8888-108 网址： <a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>
68	国信证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 法定代表人：何如 联系人：李颖 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 客服电话：95536 网址： <a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a>
69	招商证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 法定代表人：霍达 联系人：林生迎 电话：(0755)82943666 传真：(0755)82943636 客服电话：4008888111、95565 网址： <a href="http://www.cmschina.com">http://www.cmschina.com</a>
70	中国银河证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	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 法定代表人：陈共炎 联系人：辛国政

		电话：010-83574507 传真：010-83574807 客服电话：400-8888-888 网址： <a href="http://www.chinastock.com.cn">http://www.chinastock.com.cn</a>
71	申万宏源证券有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人：杨玉成 联系人：陈宇 电话：021-33388214 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址： <a href="http://www.swhysc.com">http://www.swhysc.com</a>
72	安信证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	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 法定代表人：黄炎勋 联系人：陈剑虹 电话：(0755) 82825551 传真：(0755) 82558355 客服电话：4008001001 网址： <a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a>
73	华泰证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号 法定代表人：张伟 联系人：庞晓芸 电话：0755-82492193 传真：0755-82492962(深圳) 客服电话：95597 网址： <a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>
74	中国中金财富证券有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务 中心 A 座 21 层 法定代表人：高涛 联系人：胡芷境 电话：0755-88320851 传真：0755-82026539 客服电话：400 600 8008 网址： <a href="http://www.china-invs.cn">http://www.china-invs.cn</a>
75	兴业证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	办公地址：福建省福州市湖东路 268 号 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 电话：021-38565547 客服电话：95562 网址： <a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a>
76	方正证券股份有限公司 注：只代销 A 份额。	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 法定代表人：施华 联系人：丁敏

		电话：(010)59355997 传真：(010)56437013 客服电话：95571 网址： <a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a>
77	长城证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号 能源大厦南塔楼 10-19 层 法定代表人：曹宏 联系人：金夏 电话：(021)62821733 传真：(0755)83515567 客服电话：4006666888、(0755)33680000 网址： <a href="http://www.cgws.com">http://www.cgws.com</a>
78	光大证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 法定代表人：刘秋明 联系人：刘晨、李芳芳 电话：(021) 22169999 传真：(021) 22169134 客服电话：4008888788、10108998 网址： <a href="http://www.ebscn.com">http://www.ebscn.com</a>
79	中信证券华南股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 法定代表人：胡伏云 联系人：梁微 电话：020-88836999 传真：020-88836984 客服电话：95396 网址： <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>
80	东北证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：长春市生态大街 6666 号 法定代表人：李福春 联系人：安岩岩 电话：(0431)85096517 传真：(0431)85096795 客服电话：95360 网址： <a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a>
81	华安证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 法定代表人：章宏韬 联系人：范超 电话：0551-65161821 传真：0551-65161672 客服电话：95318 网址： <a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a>
82	财富证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

		<p>法定代表人：刘宛晨  联系人：郭静  电话：(0731)84403347  传真：(0731)84403439  客服电话：95317  网址：<a href="http://www.cfzq.com">http://www.cfzq.com</a></p>
83	申万宏源西部证券有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦  法定代表人：李琦  联系人：王怀春  电话：0991-2307105  传真：0991-2301927  客服电话：4008-000-562  网址：<a href="http://www.swhysc.com/index.jsp">http://www.swhysc.com/index.jsp</a></p>
84	中泰证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：济南市市中区经七路 86 号  法定代表人：李玮  联系人：许曼华  电话：021-20315290  客服电话：95538  网址：<a href="http://www.zts.com.cn">http://www.zts.com.cn</a></p>
85	世纪证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层  法定代表人：姜昧军  联系人：王雯  电话：(0755) 83199599  传真：(0755) 83199545  客服电话：(0755) 83199511  网址：<a href="http://www.csco.com.cn">http://www.csco.com.cn</a></p>
86	第一创业证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 9、16-20 楼  法定代表人：刘学民  联系人：毛诗莉  电话：(0755)23838750  传真：(0755)25838701  客服电话：95358  网址：<a href="http://www.firstcapital.com.cn">http://www.firstcapital.com.cn</a></p>
87	中航证券有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：中国北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼中航资本大厦  法定代表人：王晓峰  联系人：戴蕾  电话：(0791) 86768681  传真：(0791) 86770178  客服电话：400-8866-567  网址：<a href="http://www.avicsec.com/">http://www.avicsec.com/</a></p>
88	华福证券有限责任公司	<p>办公地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼</p>

	注:只代销 A 份额。	3 层、4 层、5 层 法定代表人: 黄金琳 联系人: 张腾 电话: (0591) 87383623 传真: (0591) 87383610 客服电话: (0591) 96326 网址: <a href="http://www.hfzq.com.cn/">http://www.hfzq.com.cn/</a>
89	中国国际金融股份有限公司 注:只代销 A 份额。	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 法定代表人: 沈如军 联系人: 杨涵宇 电话: (010)65051166 传真: (010)85679203 客服电话: 400 910 1166 网址: <a href="http://www.cicc.com">http://www.cicc.com</a>
90	粤开证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层 法定代表人: 严亦斌 联系人: 彭莲 电话: 0755-83331195 客服电话: 95564 网址: <a href="http://www.ykzq.com/">http://www.ykzq.com/</a>
91	宏信证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 法定代表人: 吴玉明 联系人: 刘进海 电话: 028-86199278 传真: 028-86199382 客服电话: 4008366366 网址: <a href="http://www.hx818.com">http://www.hx818.com</a>
92	东海期货有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号、上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼 法定代表人: 陈太康 联系人: 李天雨 电话: 021-68757102 传真: 021-68757102 客服电话: 95531/4008888588 网址: <a href="http://www.qh168.com.cn/">http://www.qh168.com.cn/</a>
93	长江证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号 法定代表人: 李新华 联系人: 李良 电话: (027) 65799999 传真: (027) 85481900



		<p>客服电话：95579 或 4008-888-999</p> <p>网址：<a href="http://www.cjsc.com">http://www.cjsc.com</a></p>
94	西南证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦</p> <p>法定代表人：廖庆轩</p> <p>联系人：张煜</p> <p>电话：(023)63786141</p> <p>传真：(023)6378212</p> <p>客服电话：4008096096</p> <p>网址：<a href="http://www.swsc.com.cn">http://www.swsc.com.cn</a></p>
95	万联证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼 全层</p> <p>法定代表人：罗钦城</p> <p>联系人：甘蕾</p> <p>电话：020-38286026</p> <p>客服电话：95322</p> <p>网址：<a href="http://www.wlzq.com.cn">http://www.wlzq.com.cn</a></p>
96	民生证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生 金融中心 A 座 20 层</p> <p>法定代表人：冯鹤年</p> <p>联系人：程博怡</p> <p>电话：(010)59355807</p> <p>传真：(010)56437013</p> <p>客服电话：400-619-8888</p> <p>网址：<a href="http://www.msyz.com/">http://www.msyz.com/</a></p>
97	国元证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号</p> <p>法定代表人：俞仕新</p> <p>联系人：陈玲玲</p> <p>电话：(0551) 2246273</p> <p>传真：(0551) 2272100</p> <p>客服电话：95578</p> <p>网址：<a href="http://www.gyzq.com.cn">http://www.gyzq.com.cn</a></p>
98	渤海证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大 厦 A 座</p> <p>法定代表人：安志勇</p> <p>联系人：蔡霆</p> <p>电话：(022)28451991</p> <p>传真：(022)28451892</p> <p>客服电话：4006515988</p> <p>网址：<a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a></p>
99	山西证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸 易中心东塔楼</p> <p>法定代表人：侯巍</p> <p>联系人：郭熠</p> <p>电话：(0351) 8686659</p>

		传真：(0351) 8686619 客服电话：400-666-1618 网址： <a href="http://www.sxzq.com">http://www.sxzq.com</a>
100	东吴证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人：范力 联系人：方晓丹 电话：(0512)65581136 传真：(0512)65588021 客服电话：95330 网址： <a href="http://www.dwzq.com.cn">http://www.dwzq.com.cn</a>
101	信达证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	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：肖林 联系人：尹旭航 电话：(010)63081493 传真：(010)63081344 客服电话：95321 网址： <a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>
102	南京证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：江苏省南京市江东中路 389 号 法定代表人：李剑锋 联系人：王万君 电话：(025)58519523 传真：(025)83369725 客服电话：95386 网址： <a href="http://www.njzq.com.cn">http://www.njzq.com.cn</a>
103	上海证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼 法定代表人：李俊杰 联系人：邵珍珍 电话：(021)53686888 传真：(021)53686100-7008 客服电话：(021)962518、4008918918 网址： <a href="http://www.shzq.com">http://www.shzq.com</a>
104	新时代证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	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：叶顺德 联系人：田芳芳 电话：(010)83561146 客服电话：95399 网址： <a href="http://www.xsdzq.cn">http://www.xsdzq.cn</a>
105	大同证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：(0351) 4130322 传真：(0351) 4130322

		<p>客服电话：4007121212</p> <p>网址：<a href="http://dtsbc.com.cn/">http://dtsbc.com.cn/</a></p>
106	国联证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：无锡市金融一街 8 号</p> <p>法定代表人：姚志勇</p> <p>联系人：祁昊</p> <p>电话：0510-82831662</p> <p>传真：0510-82830162</p> <p>客服电话：95570</p> <p>网址：<a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a></p>
107	浙商证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：浙江省杭州市五星路 201 号</p> <p>法定代表人：吴承根</p> <p>联系人：许嘉行</p> <p>电话：(0571) 87901912</p> <p>传真：(0571) 87901913</p> <p>客服电话：(0571) 967777</p> <p>网址：<a href="http://www.stocke.com.cn">http://www.stocke.com.cn</a></p>
108	平安证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号 平安金融中心 B 座第 22-25 层</p> <p>法定代表人：何之江</p> <p>联系人：周一涵</p> <p>电话：021-38637436</p> <p>传真：021-58991896</p> <p>客服电话：95511—8</p> <p>网址：<a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a></p>
109	东莞证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼</p> <p>法定代表人：陈照星</p> <p>联系人：李荣</p> <p>电话：(0769)22115712</p> <p>传真：(0769)22115712</p> <p>客服电话：95328</p> <p>网址：<a href="http://www.dgzq.com.cn">http://www.dgzq.com.cn</a></p>
110	中原证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号</p> <p>法定代表人：菅明军</p> <p>联系人：程月艳、李盼盼</p> <p>电话：0371--69099882</p> <p>传真：0371--65585899</p> <p>客服电话：95377</p> <p>网址：<a href="http://www.ccnew.com">http://www.ccnew.com</a></p>
111	国都证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	<p>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</p> <p>法定代表人：翁振杰(代)</p> <p>联系人：黄静</p>

		电话：(010)84183389 传真：(010)84183311 客服电话：400-818-8118 网址： <a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a>
112	东海证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	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：钱俊文 联系人：王一彦 电话：(021)20333333 传真：(021)50498825 客服电话：95531;400-8888-588 网址： <a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a>
113	中银国际证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39、40、41 层、北京市西城区西单北大街 110 号 7 层 法定代表人：宁敏 联系人：王炜哲 传真：(021)50372474 客服电话：4006208888 网址： <a href="http://www.bocichina.com">http://www.bocichina.com</a>
114	恒泰证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼 法定代表人：庞介民 联系人：熊丽 电话：(0471) 4972675 客服电话：4001966188 网址： <a href="http://www.cnht.com.cn">http://www.cnht.com.cn</a>
115	国盛证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号 法定代表人：徐丽峰 联系人：占文驰 电话：(0791)86283372 传真：(0791)86281305 客服电话：4008222111 网址： <a href="http://www.gsstock.com">http://www.gsstock.com</a>
116	金元证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼 法定代表人：王作义 联系人：马贤清 电话：(0755)83025022 传真：(0755)83025625 客服电话：400-8888-228 网址： <a href="http://www.jyzq.cn">http://www.jyzq.cn</a>
117	德邦证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼 法定代表人：金华龙

		<p>联系人：刘熠  电话：(021) 68761616  传真：(021) 68767981  客服电话：4008888128  网址：<a href="http://www.tebon.com.cn">http://www.tebon.com.cn</a></p>
118	<p>华龙证券股份有限公司  注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼  法定代表人：李晓安  联系人：范坤  电话：(0931) 4890208  传真：(0931) 4890628  客服电话：95368  网址：<a href="http://www.hlzq.com">http://www.hlzq.com</a></p>
119	<p>华鑫证券有限责任公司  注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房  法定代表人：俞洋  联系人：杨莉娟  电话：021-54967552  传真：021-54967032  客服电话：  021-32109999;029-68918888;4001099918  网址：<a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a></p>
120	<p>瑞银证券有限责任公司  注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12、15 层  法定代表人：钱于军  联系人：牟冲  电话：(010) 58328112  传真：(010)58328748  客服电话：400-887-8827  网址：<a href="http://www.ubssecurities.com">http://www.ubssecurities.com</a></p>
121	<p>中山证券有限责任公司  注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层  法定代表人：林炳城  联系人：罗艺琳  电话：0755-82943755  传真：0755-82960582  客服电话：95329  网址：<a href="http://www.zszq.com.cn">http://www.zszq.com.cn</a></p>
122	<p>江海证券有限公司  注:只代销 A 份额。</p>	<p>办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号  法定代表人：赵洪波  联系人：周俊  电话：0451-85863726  传真：0451-82337279  客服电话：956007</p>

		网址： <a href="http://www.jhzq.com.cn/">http://www.jhzq.com.cn/</a>
123	国金证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 成证大厦 16 楼 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪、贾鹏 电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126 客服电话：95310 网址： <a href="http://www.gjzq.com.cn">http://www.gjzq.com.cn</a>
124	华宝证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 法定代表人：刘加海 联系人：夏元 电话：(021) 68777222 传真：(021) 68777822 客服电话：4008209898 网址： <a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a>
125	长城国瑞证券有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大 厦 20 楼 法定代表人：王勇 联系人：布前 电话：(010) 68085771 传真：(010) 68086282 客服电话：400-0099-886 网址： <a href="https://www.gwgsc.com/">https://www.gwgsc.com/</a>
126	爱建证券有限责任公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼 (陆家嘴商务广场) 法定代表人：祝健 联系人：姚盛盛 电话：(021) 32229888 传真：021-68728703 客服电话：4001962502 网址： <a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>
127	华融证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国 人寿保险大厦 16 层 法定代表人：张海文 联系人：李慧灵 电话：010-85556100 传真：010-85556088 客服电话：400-898-4999 网址： <a href="http://www.hrsec.com.cn">http://www.hrsec.com.cn</a>
128	天风证券股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利 广场 A 座 37 楼 法定代表人：余磊

		<p>联系人：岑妹妹  电话：027-87617017  传真：027-87618863  客服电话：4008005000  网址：<a href="http://www.tfzq.com">http://www.tfzq.com</a></p>
129	包商银行股份有限公司	<p>办公地址：内蒙古自治区包头市青山区钢铁大街 6 号  法定代表人：周学东  联系人：张晶  电话：0472-5189165  传真：010-84596546  客服电话：95352  网址：<a href="http://www.bsb.com.cn">http://www.bsb.com.cn</a></p>
130	青岛农村商业银行股份有限公司	<p>办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 1 号楼  法定代表人：刘仲生  联系人：李洪姣  电话：0532-66957228  传真：0532-85933730  客服电话：400-11-96668  网址：<a href="http://www.qrcb.com.cn">http://www.qrcb.com.cn</a></p>
131	诺亚正行基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋  法定代表人：汪静波  联系人：张裕  电话：021-38509735  传真：021-38509777  客服电话：400-821-5399  网址：<a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a></p>
132	深圳众禄基金销售股份有限公司	<p>办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801  法定代表人：薛峰  联系人：童彩平  电话：0755-33227950  传真：0755-33227951  客服电话：4006-788-887  网址：<a href="http://www.jjmmw.com">http://www.jjmmw.com</a>;<a href="https://www.zlfund.cn">https://www.zlfund.cn</a></p>
133	上海天天基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座  法定代表人：其实  联系人：屠彦洋  电话：95021  传真：(021) 64385308  客服电话：400-1818-188  网址：<a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a></p>
134	上海好买基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼</p>

		<p>法定代表人：杨文斌  联系人：张茹  电话：021-20613999  传真：021-68596916  客服电话：4007009665  网址：<a href="https://www.howbuy.com/">https://www.howbuy.com/</a></p>
135	浙江同花顺基金销售有限公司	<p>办公地址：浙江省杭州市西湖区古荡街道  法定代表人：吴强  联系人：林海明  传真：0571-86800423  客服电话：4008-773-772  网址：<a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a></p>
136	嘉实财富管理有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期 53 楼  法定代表人：赵学军  联系人：景琪  电话：021-20289890  传真：021-20280110  客服电话：400-021-8850  网址：<a href="http://www.harvestwm.cn">http://www.harvestwm.cn</a></p>
137	南京苏宁基金销售有限公司	<p>办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号  法定代表人：刘汉青  联系人：喻明明  电话：025-66996699-884131  传真：025-66008800-884131  客服电话：95177  网址：<a href="http://www.snjjjin.com/">http://www.snjjjin.com/</a></p>
138	浦领基金销售有限公司	<p>办公地址：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：李艳  电话：010-59497361  传真：010-64788016  客服电话：400-012-5899  网址：<a href="http://www.wy-fund.com">http://www.wy-fund.com</a></p>
139	通华财富(上海)基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区新金桥路 28 号新金桥大厦 5 楼  法定代表人：马刚  联系人：褚志朋  电话：021-60818730  传真：021-60818187  客服电话：40066-95156  网址：<a href="http://www.tonghuafund.com">http://www.tonghuafund.com</a></p>
140	北京唐鼎耀华基金销售有限公	<p>办公地址：北京市朝阳区建外大街 19 号国际大厦</p>



	司	A 座 1503 法定代表人：张冠宇 联系人：王丽敏 电话：010-85932810 传真：010-59200800 网址： <a href="http://www.tdyhfund.com">http://www.tdyhfund.com</a>
141	北京植信基金销售有限公司	办公地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67 法定代表人：于龙 联系人：吴鹏 电话：010-56075718 传真：010-67767615 客服电话：400-680-2123 网址： <a href="http://www.zhixin-inv.com">http://www.zhixin-inv.com</a>
142	海银基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号陆家嘴金融服务广场 16 楼 法定代表人：刘惠 联系人：秦琼 电话：021-80134149 传真：021-80133413 客服电话：4008081016 网址： <a href="http://www.fundhaiyin.com">http://www.fundhaiyin.com</a>
143	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海昆明路 518 号北美广场 A1002 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：4008-205-369 网址： <a href="http://www.jiyufund.com.cn">http://www.jiyufund.com.cn</a>
144	珠海盈米基金销售有限公司	办公地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 法定代表人：肖雯 联系人：黄敏嫦 电话：020-89629019 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址： <a href="http://www.yingmi.cn">http://www.yingmi.cn</a>
145	奕丰基金销售有限公司	办公地址：深圳市南山区蛇口街道后海滨路与海德三道交汇处航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人：TAN YIK KUAN 联系人：叶健 电话：0755-89460500 传真：0755-21674453 网址： <a href="https://www.ifastps.com.cn/">https://www.ifastps.com.cn/</a>
146	大连网金基金销售有限公司	办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2F

		<p>法定代表人：樊怀东  联系人：于舒  电话：0411-39027828  传真：0411-39027835  客服电话：4000-899-100  网址：<a href="http://www.yibaijin.com/">http://www.yibaijin.com/</a></p>
147	中民财富基金销售(上海)有限公司	<p>办公地址：上海市黄浦区老太平弄 88 号 A、B 单元  法定代表人：弭洪军  联系人：茅旦青  电话：021-33355392  传真：021-63353736  客服电话：400-876-5716  网址：<a href="http://www.cmiwm.com/">http://www.cmiwm.com/</a></p>
148	万家财富基金销售(天津)有限公司	<p>办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层  法定代表人：李修辞  联系人：王芳芳  电话：010-59013842/18519215322  传真：010-59013828  网址：<a href="http://www.wanjiawealth.com">http://www.wanjiawealth.com</a></p>
149	阳光人寿保险股份有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦  法定代表人：李科  联系人：王超  电话：010-59053660  传真：010-59053700  客服电话：95510  网址：<a href="http://life.sinosig.com/">http://life.sinosig.com/</a></p>
150	中国人寿保险股份有限公司	<p>办公地址：北京市西城区金融大街 16 号  法定代表人：王滨  联系人：赵文栋  电话：010-63632878  客服电话：95519  网址：<a href="http://www.e-chinalife.com">http://www.e-chinalife.com</a></p>
151	广发证券股份有限公司	<p>办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦  法定代表人：孙树明  联系人：陈姗姗  电话：(020) 66338888  传真：(020) 87555305  客服电话：95575 或致电各地营业网点  网址：<a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
152	中信证券股份有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大</p>

		厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人: 张佑君 联系人: 郑慧 电话: 010-60838888 客服电话: 95558 网址: <a href="http://www.citics.com">http://www.citics.com</a>
153	中信证券(山东)有限责任公司	办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层 法定代表人: 姜晓林 联系人: 焦刚 电话: (0531) 89606166 传真: (0532) 85022605 客服电话: 95548 网址: <a href="http://www.zxwt.com.cn">http://www.zxwt.com.cn</a>
154	中信期货有限公司	办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1303-1305 室、14 层 法定代表人: 张皓 联系人: 刘宏莹 电话: 010-60833754 传真: 021-60819988 客服电话: 400-990-8826 网址: <a href="http://www.citicsf.com">http://www.citicsf.com</a>
155	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006 法定代表人:马勇 联系人:文雯 电话:010-83363101 传真:010-83363072 客服电话:400-118-1166 网址: <a href="http://www.xinlande.com.cn">http://www.xinlande.com.cn</a>
156	上海挖财基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 上海浦东杨高南路 799 号 3 号楼 5 楼 法定代表人:冷飞 联系人:孙琦 电话:021-50810687 传真:021-58300279 客服电话:021-50810673 网址: <a href="http://www.wacaijijin.com">http://www.wacaijijin.com</a>
157	北京汇成基金销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室 法定代表人:王伟刚 联系人:丁向坤 电话:010-56282140 传真:010-62680827 客服电话:400-619-9059

		网址: <a href="http://www.hcjijin.com/">http://www.hcjijin.com/</a>
158	南京途牛金融信息服务有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:南京市玄武区玄武大道 699-32 号 法定代表人:宋时琳 联系人:王旋 电话:025-86853960 025-86853969 传真:025-86853969 网址: <a href="http://www.tuniufu.com">http://www.tuniufu.com</a>
159	华瑞保险销售有限公司 (注:只代销 A 份额。)	办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层 法定代表人:路昊 联系人:张爽爽 电话:021-68595976 传真:021-68595766 客服电话:952303 网址: <a href="http://www.huaruisales.com">http://www.huaruisales.com</a>
160	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址:北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101 法定代表人:葛新 联系人:杨琳 电话:010-61952702 传真:010-61951007 客服电话:95055 网址: <a href="http://www.baiyingfund.com">http://www.baiyingfund.com</a>
161	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 12 楼 法定代表人:祖国明 联系人:韩爱彬 电话:021-60897840 传真:0571-26697013 客服电话:4000-766-123 网址: <a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>
162	北京新浪仓石基金销售有限公司	办公地址:北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室 联系人:李唯 电话:010-62676405 传真:010-62676582 客服电话:010-62675369 网址: <a href="http://www.xincai.com">http://www.xincai.com</a>
163	上海万得基金销售有限公司	办公地址:中国(上海)浦东新区福山路 33 号 9 楼 法定代表人:王廷富 联系人:徐亚丹 电话:021-68882280 传真:021-68882281

		客服电话:400-821-0203 网址: <a href="https://www.520fund.com.cn/">https://www.520fund.com.cn/</a>
164	凤凰金信(银川)基金销售有限公司	办公地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路 142 号 14 层办公房 法定代表人:程刚 联系人:张旭 电话:010-58160168 传真:010-58160173 客服电话:400-810-55919 网址: <a href="http://www.fengfd.com/">http://www.fengfd.com/</a>
165	和耕传承基金销售有限公司	办公地址:郑州市郑东新区东风东路康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间 法定代表人:李淑慧 联系人:裴小龙 电话:0371-85518395 4000-555-671 传真:0371-85518397 网址:HGCCPB.COM
166	北京肯特瑞基金销售有限公司	办公地址:北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06 法定代表人:江卉 联系人:江卉 电话:4000988511 传真:010-89188000 客服电话:010-89188462 网址: <a href="http://fund.jd.com">http://fund.jd.com</a>
167	北京蛋卷基金销售有限公司	办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人:钟斐斐 联系人:侯芳芳 电话:010-61840688 传真:010-61840699 客服电话:400-159-9288 网址: <a href="http://www.ncfjj.com">http://www.ncfjj.com</a>

## (二) 基金注册登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	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
联系人	彭鑫
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678

## (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 楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
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	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	周祎
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

## 六、基金的募集

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1月6日《关于核准中创400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]13号）核准募集。

### （一）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

### （二）基金存续期

不定期。

### （三）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赎清单的要求，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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。

### （四）基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象、募集目标

1. 募集期：2012年2月20日至2012年3月16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募集。

3. 募集对象：

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及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。

4. 募集规模上限

本基金不设募集规模上限。

#### （五）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<100万元	1.0%
100万元≤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）净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；

（2）认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；

（3）认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 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。



#### 4、基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为A 类基金份额；投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不能相互转换。

在不违反法律法规、基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售或调整基金份额分类办法及规则等，不需召开基金份额持有人大会审议，但调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。

#### 5、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）基金合同的生效

本基金基金合同自 2012 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，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 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个人投资者、机构投资者及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。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其它相关公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类基金份额变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （三）申购、赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

申购和赎回的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为深圳证券交易所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基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

自 2012 年 4 月 23 日起开始办理本基金的日常申购和赎回业务。

### （四）申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与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、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，份额确认日期在前的基金份额先赎回，份额确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### （五）申购、赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### 3、申购与赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申购、赎回申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据《业务规则》，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

##### 4、申购与赎回申请的款项支付

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，申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

#### （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 1 元，追加申购单笔最低限额为人民币 1 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，追加申购单笔最低限额为人民币 1 元。但若有代销机构特别约定首次申购单笔及追加单笔最低限额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。。

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。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。

## 2. 申请赎回基金的份额

投资者单笔赎回不得少于 1 份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 1 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 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。但若有代销机构特别约定单笔赎回最低份额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。3. 基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份数的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告并报中国证监会

1、本基金 C 类基金份额不收取申购费，A 类基金份额收取申购费。A 类基金份额申购费用由申购该类份额的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。投资者申购 A 类基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资者在一天之内如果有多笔 A 类基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金 A 类份额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 < 100 万元	1.2%
100 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

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金 A 类份额业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金 A 类份额的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金 A 类份额，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6% 执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6% 时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金 A 类份额的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

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。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金 A 类份额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 A 类份额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 < 7 天	1.50%
7 天 ≤ M < 365 天	0.50%
365 天 ≤ M < 730 天	0.25%
M ≥ 730 天	0

本基金 C 类基金份额赎回费率最高不高于 1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示：

持有期限	赎回费率
M < 7 天	1.5%
M ≥ 7 天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，对除此之外的投资者收取的赎回费中不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

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》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

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、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额，以申请当日该类基金份额的基金份额净值为基准计算。

（1）本基金 A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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/申购当日的A类基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净认购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日的A类基金份额净值

（2）本基金C类基金份额申购份额的计算方式如下：

例1：某投资者投资100,000元申购A类基金份额，其对应申购费率为1.20%，假设申购当日A类基金份额净值为1.6280元，则其可得到的申购份额计算如下：

净申购金额=100,000/（1+1.20%）=98,814.23元

申购费用=100,000-98,814.23=1185.77元

申购份额=98,814.23/1.6280=60,696.70份

即投资者投资100,000元申购A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.6280元，则可得到60,696.70份A类基金份额。

例2：某投资者投资100,000元申购C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.6280元，则其可得到的申购份额计算如下：

申购份额=100,000/1.6280=61,425.06份

即投资者投资100,000元申购C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.6280元，则可得到61,425.06份C类基金份额。

## 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日的该类别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日该类别基金份额净值

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3：假定A类份额的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，其中该类别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4
赎回份额（份，A）	10,000	10,000	10,000	10,000
基金份额净值（元，B）	1.1000	1.1000	1.3000	1.4000
持有时间	5天	100天	366天	731天
适用赎回费率（C）	1.50%	0.5%	0.25%	0%
赎回总额（元，D=A×B）	11,000	11,000	13,000	14,000
赎回费（E=C×D）	165	55	32.5	0
赎回金额（F=D-E）	10835	10,945	12,967.5	14,000

例4：假定C类份额的两笔赎回申请的赎回份额均为10,000份，但持有时间长短不同，其中该类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
赎回份额（份，A）	10,000	10,000
基金份额净值（元，B）	1.1000	1.3000
持有时间	5天	55天
适用赎回费率（C）	1.5%	0%
赎回总额（元，D=A×B）	11,000	13,000
赎回费（E=C×D）	165	0
赎回金额（F=D-E）	10,835	13,000

### 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日该类别基金资产净值/T 日发行在外的该类别基金份额总数。

T 日的每一类别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该类别基金资产净值除以计算日发行在外的该类别基金份额总数，每一类别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》的有关规定在指定媒介公告。

#### （十）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受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者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，如出现单个基金份额持有人超过前一日基金总份额 30%的赎回申请（“大额赎回申请人”）的，基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期

赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒介及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向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。同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；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，并应当在指定媒介公告。

#### （十一）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易所在交易时间临时停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （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）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （6）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （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；
- （9）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

#### （10）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述暂停申购情形（第（8）项除外）时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告并报中国证监会备案。

#### （十二）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- （1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

- （2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）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；
- （5）所投资的目标 ETF 暂停赎回，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的；
- （6）发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值的情况；
- （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）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- （9）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告并报中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定媒介公告。投资者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，并依照有关规定在指定媒介上公告。

### （十三）重新开放申购或赎回的公告

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介和基金管理人网站上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值；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。

## 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

基金转换的开始办理时间：自 2012 年 4 月 23 日起。

### （二）适用基金转换的基金范围

本基金在代销机构与嘉实基金管理有限公司直销渠道上开放办理基金转换业务。与本基金开通转换业务的本基金管理人旗下的基金包括：嘉实中证 500ETF 联接 A、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券 A/B、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实对冲套利定期混合、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实快线货币 A、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、嘉实事件驱动股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接 A、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实研究增强混合、嘉实成长增强混合、嘉实创新成长混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实智能汽车股票、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实文体娱乐股票 A、嘉实文体娱乐股票 C、嘉实优势成长混合、嘉实物流产业股票 A、嘉实物流产业股票 C、嘉实稳祥纯债债券 C、嘉实稳宏债券 A、嘉实稳宏债券 C、嘉实农业产业股票、嘉实新能源新材料股票 A、嘉实新能源新材料股票 C、嘉实增益宝货币、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实沪港深回报混合、嘉实富时中国 A50ETF 联接 A、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳华纯债债券、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合 A、嘉实新添辉定期混合 C、嘉实润和量化定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实富时中国 A50ETF 联接 C、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票 A、嘉实医药健康股票 C、嘉实新添康定期混合 A、嘉实新添康定期混合 C、嘉实核心优势股票、嘉实资源精选股票 A、嘉实资源精选股票 C、嘉实金融精选股票 A、嘉实金融精选股票 C、嘉实新添荣定期混合 A、嘉实新添荣定期混合 C、嘉实深证基本面 120ETF 联接 C、嘉实中证金融地产 ETF 联接 C、嘉实致盈债券、嘉实互融精选股票、嘉实消费精选股票 A、嘉实消费精选股票 C、嘉实中短债债券 A、嘉实中短债债券 C、嘉实互通精选股票、嘉实致享纯债债券、嘉实新添元定期混合 A、嘉实新添元定期混合 C、嘉实中债 1-3 政金债指数 A、嘉实中债 1-3 政金债指数 C、嘉实长青竞争优势股票 A、嘉实长青竞争优势股票 C、嘉实汇达中短债债券 A、嘉实汇达中短债债券 C、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接 A、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接 C、嘉实央企创新驱动 ETF 联接 A、嘉实央企创新驱动 ETF 联接 C、嘉实新兴科技 100 ETF 联接 A、嘉实新兴科技 100 ETF 联接 C、嘉实价值成长混合、

嘉实中债 3-5 年国开债指数 A、嘉实中债 3-5 年国开债指数 C、嘉实中证 500 指数增强 A、嘉实中证 500 指数增强 C、嘉实稳固收益债券 A、嘉实成长收益混合 A、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、嘉实货币 A、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合 A、嘉实多元债券 A、嘉实多元债券 B、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券 C、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接 A、嘉实信用债券 A、嘉实信用债券 C、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实纯债债券 C、嘉实中证 500ETF 联接 C、嘉实货币 B、嘉实优质企业混合、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A、嘉实基本面 50 指数 (LOF) A、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C、嘉实惠泽混合 (LOF)。

### （三）基金转换费用

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

#### 1、通过代销机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

#### 2、通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从 0 申购费用基金向非 0 申购费用基金转换时，每次按照非 0 申购费用基金申购费用收取申购补差费；非 0 申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

#### 3、通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

（1）若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

（2）若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

#### 4、基金转换份额的计算方式

基金转换采取未知价法，以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下：

转出基金金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率

转出基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转出基金申购费率÷(1+转出基金申购费率)

转入基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转入基金申购费率÷(1+转入基金申购费率)

申购补差费用=MAX（0，转入基金申购费用-转出基金申购费用）

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

转出基金有赎回费用的,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转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

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:嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币 A、嘉实新消费股票、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实稳祥纯债债券 C、嘉实增益宝货币、嘉实稳华纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实中短债债券 A、嘉实中短债债券 C、嘉实汇达中短债债券 A、嘉实汇达中短债债券 C、嘉实债券、嘉实货币 A、嘉实超短债债券、嘉实价值优势混合、嘉实信用债券 A、嘉实信用债券 C、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实纯债债券 A、嘉实纯债债券 C、嘉实货币 B、嘉实中证中期企业债指数(LOF) A、嘉实中证中期企业债指数(LOF) C 有单日单个基金账户账户的累计申购(转入)限制,嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购和转入业务,具体请见考嘉实基金网站刊载的相关公告。定期开放类基金在封闭期内无法转换。

#### (四)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可交易的当日,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中国证监会指定媒介公告。

### （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 1 份基金份额。但若有代销机构特别约定最低转出份额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。

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，并于开始实施前在指定媒介公告。

### （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：

- （i）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （ii）证券交易场所交易时间临时停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （iii）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；
- （iv）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；
- （v）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(vi) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

(vii) 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；

(viii) 基金管理人认为接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

(ix) 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金转入申请的措施；

(x) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他可暂停转入的情形。

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：

(i) 因不可抗力导致基金管理人无法支付转出款项；

(ii) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(iii) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(iv) 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；

(v) 所投资的目标 ETF 暂停赎回，且基金管理人认为有必要暂停本基金转出的；

(vi) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(vii) 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；

(viii) 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付转出款项或暂停接受基金转出申请的措施；

(ix) 法律法规规定或经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再在中国证监会指定媒介上公告。

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

自 2012 年 4 月 23 日起开始办理本基金的定期定额投资业务。

## 十一、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

（一）非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”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”是指司法机关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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和基金合同规定的持有本基金份额的投资者的条件。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。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

（二）本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的有关规定。

如果基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构出现系统性能限制或出于其他合理原因，可以暂停转托管业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

（三）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的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

## 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%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（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、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金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资理念

本基金遵循指数化投资理念，通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股等，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。

### （四）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，在正常市场情况下，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。

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、中期报告、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。

## （五）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。

## （六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中创 400 指数收益率\*95% + 银行活期存款税后利率\*5%。

中创 400 指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前 6 个月的平均流通市值的比重和平均成交金额的比重按 2：1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名在位于 101-500 名的股票。

中创 400 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、或中创 400 指数编制机构变更或停止中创 400 指数的编制及发布、或中创 400 指数由其他指数替代、或中创 400 指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中创 400 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。

## （七） 风险收益特征

本基金为中创 400ETF 的联接基金，主要通过投资于中创 400ETF 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创 400 指数及中创 400ETF 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。

## （八） 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，但是法律法规或是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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）依照有关法律、行政法规有关法律法规规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

### 2、基金投资组合比例限制

- （1）本基金投资于中创 400ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）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）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- （4）基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；
- （5）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；
- （6）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%；

（7）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%；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%；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%；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%；

（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）本基金从事股票指数期货投资时，遵循相关法律法规的规定：

（a）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%；

（b）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%；

（c）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的 20%；

（d）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（e）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%；

（f）本基金投资股指期货的，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（11）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（12）法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### （九）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、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等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，以达到标准，上述第（8）、（10）、（11）项除外。。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

#### （十）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。

#### （十一）基金投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月17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12月31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	972,875.15	0.79
	其中：股票	972,875.15	0.79
2	基金投资	114,982,790.75	93.31
3	固定收益投资	1,900.00	0.00
	其中：债券	1,900.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	6,486,489.77	5.26
8	其他资产	780,712.77	0.63
9	合计	123,224,768.44	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	9,670.00	0.01
B	采矿业	7,869.00	0.01
C	制造业	704,485.96	0.58
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	1,434.00	0.00
E	建筑业	12,349.40	0.01
F	批发和零售业	23,749.60	0.02
G	交通运输、仓储和邮 政业	4,640.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	147,317.44	0.12
J	金融业	16,664.65	0.01
K	房地产业	4,573.00	0.00
L	租赁和商务服务业	12,003.50	0.01
M	科学研究和技术服务 业	8,760.60	0.01
N	水利、环境和公共设 施管理业	9,085.00	0.01
O	居民服务、修理和其 他服务业	-	-
P	教育	1,533.00	0.00
Q	卫生和社会工作	4,426.00	0.00

R	文化、体育和娱乐业	4,314.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	972,875.15	0.80

### 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	002821	凯莱英	100	12,950.00	0.01
2	300747	锐科激光	100	11,780.00	0.01
3	300450	先导智能	195	8,763.30	0.01
4	300223	北京君正	100	8,715.00	0.01
5	300618	寒锐钴业	100	8,239.00	0.01
6	002384	东山精密	350	8,102.50	0.01
7	300226	上海钢联	100	7,780.00	0.01
8	002353	杰瑞股份	200	7,392.00	0.01
9	300529	健帆生物	100	7,184.00	0.01
10	002396	星网锐捷	200	7,112.00	0.01

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,900.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,900.00	0.00

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	128085	鸿达转债	5	500.00	0.00
1	128092	唐人转债	5	500.00	0.00
3	128084	木森转债	4	400.00	0.00
4	128089	麦米转债	3	300.00	0.00
5	123036	先导转债	2	200.00	0.00

### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

## 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 9. 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实中创 400ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	114,982,790.75	93.99

## 10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

## 11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 12. 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	7,163.51
2	应收证券清算款	714,907.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,436.78
5	应收申购款	57,205.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	780,712.77

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

### 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。

#### （一）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

##### 嘉实中创 400ETF 联接 A

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
2012 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日	-9.14%	1.25%	-13.45%	1.39%	4.31%	-0.14%
2013 年	38.86%	1.50%	39.86%	1.53%	-1.00%	-0.03%
2014 年	20.40%	1.31%	22.24%	1.33%	-1.84%	-0.02%
2015 年	56.42%	2.63%	76.68%	2.69%	-20.26%	-0.06%
2016 年	-20.57%	1.95%	-20.42%	1.97%	-0.15%	-0.02%
2017 年	-12.00%	0.91%	-10.53%	0.92%	-1.47%	-0.01%
2018 年	-33.94%	1.48%	-34.07%	1.48%	0.13%	0.00%
2019 年	30.54%	1.53%	30.86%	1.54%	-0.32%	-0.01%

##### 嘉实中创 400ETF 联接 C

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
自基金合同生效日 至 2018 年 12 月 31 日	-33.14%	1.50%	-33.37%	1.51%	0.23%	-0.01%
2019 年	30.00%	1.53%	30.86%	1.54%	-0.86%	-0.01%

（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

**嘉实中创400ETF联接A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**

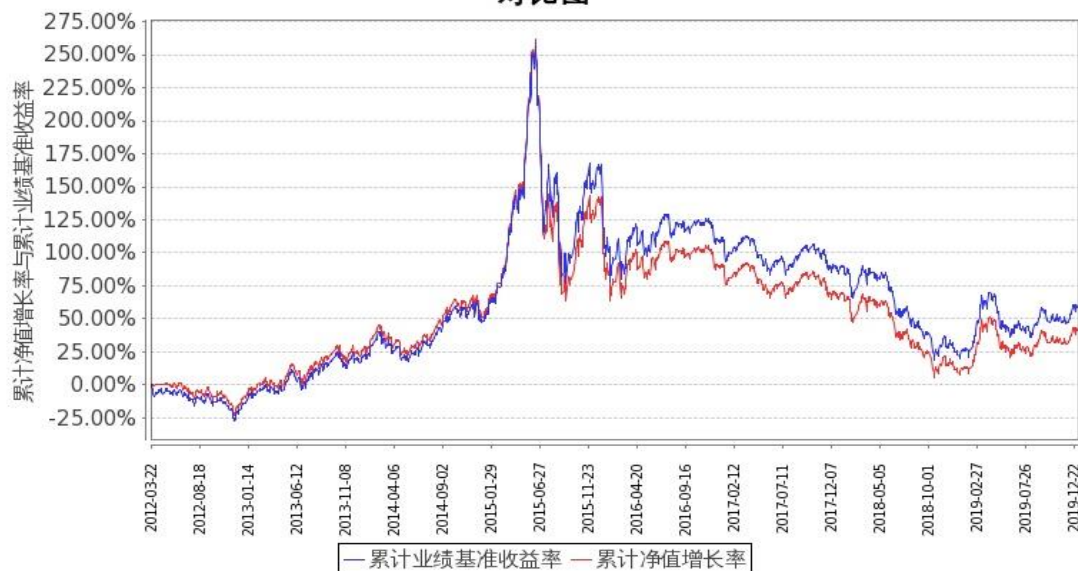


图 1：嘉实中创 400ETF 联接 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
（2012 年 3 月 22 日至 2019 年 12 月 31 日）

**嘉实中创400ETF联接C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**

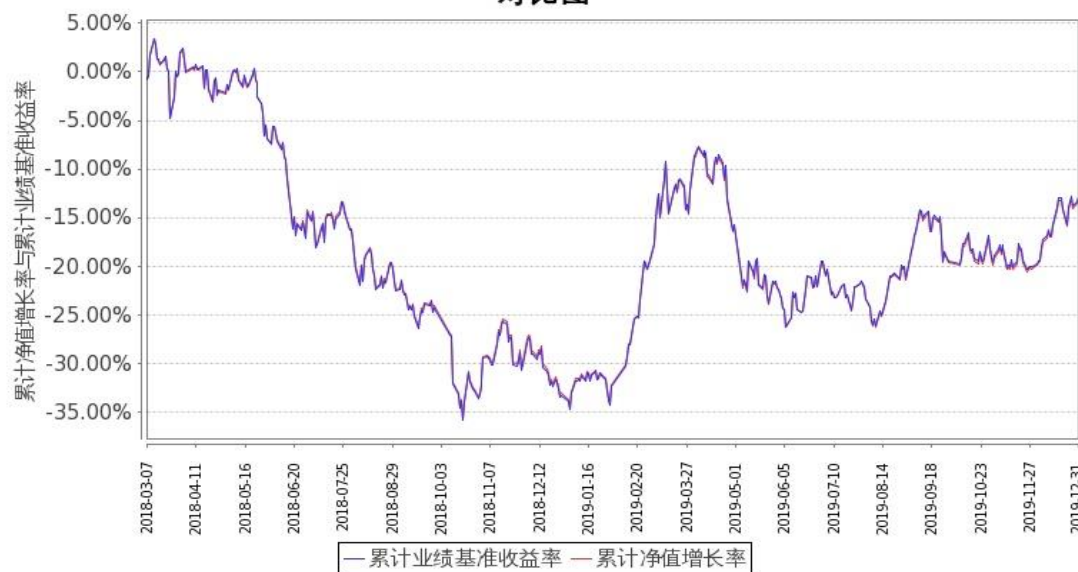


图 2：嘉实中创 400ETF 联接 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
（2018 年 3 月 7 日至 2019 年 12 月 31 日）

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“第十一部分二、投资范围和六、投资限制（一）投资组合限制”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有关法律法规和政策规定进行融资、融券。



## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### （二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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）基金财产的保管及处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

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）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的各类基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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工作日。

### （三）估值对象

基金所依法拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）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 估值日基金份额的净值估值。

#### 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、因持有股票而享有的配股权，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。

5、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。

6、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。

7、股指期货以估值日的结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

8、如有确凿证据表明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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以约定形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，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。

#### （六）暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他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；

3、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；

4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；

5、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认和估值错误的处理

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。当任一类别基金份额的估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过该类别基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

#### 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、或代理销售机构、或投资者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的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

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无法预见、无法避免、无法抗拒，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者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承担；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，则该当事人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）差错的责任方对可能导致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，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）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的交易数据的，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；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### （八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，分红资金将按除息日相应类别的基金份额净值转成相应类别的基金份额。投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的每份该类基金份额净值减去每份该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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至日）的时间不超过 15 个工作日。

### （六）收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别基金份额。

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、基金的销售服务费；
- 4、因基金的证券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）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的基金托管费

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 为前一日的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。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

本条第（一）款第 4 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十九、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、基金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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、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。基金管理人应在更换会计师事务所后需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。
- 3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

## 二十、基金的信息披露

（一）本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。

（二）信息披露义务人

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及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，依照《信息披露办法》的有关规定将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等进行披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）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销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）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。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在相应网站上。

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人

应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(2) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

(4) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日，下同）在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

## 4、基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

## 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）《基金合同》终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长；
- （9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- （11）基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

(12) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

(13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

(14) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(15) 基金收益分配事项；

(16) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17) 任一类别基金份额净值计价错误达该类别基金份额净值百分之零点五；

(18) 本基金开始办理申购、赎回；

(19) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(20) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(21) 本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

(22) 变更目标 ETF；

(23) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(24) 基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

## 9、基金份额持有人大会决议

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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

## 10、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 11、中国证监会规定的其他信息

##### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

##### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

##### （八）本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。



## 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。

#### 1、本基金的申购、赎回安排

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介上公告。

## 2、拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股，经考察中创 400 指数的成份股数量、日均成交量以及日均成交金额，该指数及目标 ETF 将具有充足的流动性可满足本基金投资的要求；本基金在组合构建过程中，将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式，如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。因此，本基金拟投资市场及资产的流动性良好。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

## 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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。

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可能采用以下流动性风险管理措施，以控制因巨额赎回可能产生的流动性风险：

（1）部分延期赎回，并对当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 30%的单个赎回申请人部分延期办理；

（2）暂停赎回；

（3）中国证监会认定的其他措施。

## 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

（1）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（3）本基金对持续持有期少于 7 日的投资人，收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资人赎回基金份额时收取。

#### （五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人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、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止基金合同；
- （10）法律法规规定的或基金合同明确约定应当由基金份额持有人大会审议决定的基金合同变更事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （5）对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或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （6）基金管理人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）除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议应按照届时有效的法律法规报中国证监会核准或备案，自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和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）基金资产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

（四）清算费用

清算费用是指基金资产清算组在进行基金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小组优先从基金财产中支付。

（五）基金剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金资产清算账册及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

1、基金份额持有人的权利与义务

（1）基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金资产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金资产；
- 3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开或自行召集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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 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、基金合同规定的其他权利。

（2）基金份额持有人的义务

- 1) 遵守《基金合同》；
- 2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- 3) 在其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《基金合同》当事人合法权益的活动；
- 5) 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、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；



- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获取《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12) 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；
- 13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- 14) 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；
- 15) 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；
- 16) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### (2) 基金管理人的义务

- 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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 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、谨慎勤勉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基金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,不得利用基金财产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) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

11) 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;

12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、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,不向他人泄露;

13) 按《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基金收益;

14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15) 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;

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

18) 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;

19) 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;

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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22) 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实施其他法律行为;

23) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

24) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

25) 建立并保管基金份额持有人名册，根据托管协议的约定定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

#### (1) 基金托管人的权利

1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 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；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### (2) 基金托管人的义务

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，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) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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和证券账户，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；

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或经有权机关要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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；

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12) 建立并保管基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14) 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；

15) 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；

16) 按照法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 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；

18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

1、当出现或需要决定下列事由之一的，基金管理人，或基金托管人，或单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算）基金份额的基金份额持有人有权按照《基金合同》的约定提议召集或自行召集基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(11) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会

(12) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 基于修改后的法律法规、深圳证券交易所或者注册登记机构修改或更新的相关业务规则的要求，或基于中国证监会的相关规定，必须对《基金合同》进行修改；

(5) 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；

(6) 对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(7) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、召集方式：

(1) 除法律法规规定或《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；

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

(3) 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，应当由基金托管人自行召集。

(4) 单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，单独或合计代表基金份额 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。

(5) 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，单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

(6) 基金份额持有人大会召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 4、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) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托文件的内容要求（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；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行书面表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票效力。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式、或法律法规和监管机关允许的其他方式召开。会议的召开方式由会议召集人确定。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托文件委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具书面表决意见或授权他人出具书面表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4）上述第 3）项中直接出具书面表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（3）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。

## 6、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

议事内容为本部分第一条“召开事由”第 1 款所述事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于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。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明出席会议的基金份额持有人姓名或名称、身份证明文件名称及号码、持有或代表有表决权的基金份额、代理人的姓名及其身份证明文件名称及号码、其他事项等。。

### 2) 通讯开会



在通讯开会的情况下，应由召集人提前 40 日公布提案，在会议通知规定的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 7、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会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）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，否则提交了符合会议通知规定的投资者身份证明文件的投资者即视为有效出席的投资者；符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出席会议的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

## 8、计票

### （1）现场开会

1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证, 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的, 不影响计票的效力。

#### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集, 则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒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。

#### 9、生效与公告

基金份额持有人大会的决议, 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。

基金份额持有人大会决议应自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定, 由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。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。

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的决议。

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。

#### 10、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。

11、法律法规或监管机关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

1、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

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。

2、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

（4）基金财产清算程序：

1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3）对基金财产进行估值和变现；

4）制作清算报告；

5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

7）对基金财产进行分配。

（4）清算费用

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

（5）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（6）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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小组进行公告。

（7）基金资产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《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

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《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：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 53 层 09-11 单元

法定代表人：赵学军

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：胡勇钦

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：赵会军

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 349,321,234,600 元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金

受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（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、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金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

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%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

- a、本基金投资于中创 400ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；
- b、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- c、本基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

d、基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

e、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

f、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%；

g、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%；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%；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%；

h、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；

i、一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 3%；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；因流通受限证券价格波动、基金规模变动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或在流通受限期结束后卖出流通受限证券。经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

j、本基金从事股票指数期货投资时，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%；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的 20%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；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%；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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

k、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

l、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，基金管理人在履行适当程序后，按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

### 3) 法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、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等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，上述第 h、k、l 项除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

### 4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或提供担保；
- 3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向基金管理人、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债券；
- 6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，按照调整后的规定执行。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管



理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更，并自回函之日其按照变更后的名单对基金关联投资限制进行监督。

如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。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并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《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。

1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担赔偿责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担赔偿责任。

3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手名单中列明的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失由基

金资产承担，但基金管理人应采取积极措施向交易对手追讨；在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人向基金托管人提供银行间市场交易的交易对手名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。基金管理人向基金托管人提供银行间市场交易的交易对手名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行。本基金投资于核心存款银行名单中列明的银行中的银行存款，由于存款银行信用风险引起的损失，基金管理人不承担赔偿责任，但基金管理人应采取措施向责任方追讨；本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金管理人向基金托管人提供核心存款银行的名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应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。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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）基金管理人应对基金托管人的业务核查

基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于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、无故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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，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，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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

#### 1、基金资产保管的原则

- （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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- （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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，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托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

## 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的嘉实基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。同时，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

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事宜。

## 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，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其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

## 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，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出借和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。

#### 5、债券托管账户的开立和管理

（1）《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或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。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

#### （五）基金资产净值计算和会计复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，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，按照基金管理人对外公布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。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，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，按照基金管理人对外公布。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。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。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和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

##### 1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，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。

##### 2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有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。

##### 3、基金资产的清算

基金管理人和基金托管人应按照基金合同及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。



## 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/发送

#### 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或邮件发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

投资者可与中国银行等代销机构就本基金申请开办“定期定额投资计划”约定每期固定申购金额。

### （四）在线服务

通过本公司网站 [www.jsfund.cn](http://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

#### 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。具体参见相关公告。

#### （五）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

以下信息披露事项已通过指定报刊和指定网站（含基金管理人网站）公开披露。

序号	临时报告名称	披露时间	备注
1	关于增加青岛农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	2019 年 3 月 26 日	含本基金
2	关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告	2019 年 3 月 30 日	含本基金
3	关于增加海银基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	2019 年 7 月 23 日	含本基金
4	关于增加日照银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	2019 年 7 月 26 日	含本基金
5	关于嘉实中创 400ETF 联接 C 开通转换业务的公告	2019 年 8 月 23 日	含本基金
6	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	2020 年 1 月 14 日	含本基金

## 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创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2. 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3. 《嘉实中创 400 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  
2020 年 04 月 24 日