

# 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更新招募说明书摘要

(2020年08月07日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2016 年 9 月 30 日中国证券监督管理委员会《关于准予嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》（证监许可[2016]2268 号）注册募集。本基金基金合同于 2017 年 6 月 29 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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 7 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 6 月 30 日（未经审计），特别事项注明除外。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本情况

|       |                                                                      |
|-------|----------------------------------------------------------------------|
| 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  | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他管理人员基本情况

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业务总监兼国际业务部总经理，兼任中诚国际资本有限公司总经理、中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长及法人代表。

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、商学院院长兼 MBA 教育中心主任。现任中央财经大学商学院教授。

经雷先生，董事、总经理，金融学、会计专业本科学历，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。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

高峰先生，硕士研究生，5 年证券从业经历，具有基金从业资格，北京大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任中国工商银行股份有限公司金融市场部外汇及衍生品交易员。2015 年加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，现任指数投资部基金经理。2019 年

4 月 2 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 4 月 2 日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、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 28 日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2019 年 9 月 28 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 9 月 28 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 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、2020 年 4 月 24 日至今任嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

刘珈吟女士，硕士研究生，11 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、2019 年 11 月 28 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联接基金基金经理、2020 年 4 月 22 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发起式联接基金基金经理。

## （2）历任基金经理

何如女士，管理时间为 2017 年 6 月 29 日至 2019 年 3 月 30 日；陈正宪先生，管理时间为 2017 年 6 月 29 日至 2019 年 9 月 28 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，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、上述人员之间均不存在近亲属关系

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2020 年 6 月 30 日，中国银行已托管 830 只证券投资基金，其中境内基金 783 只，QDII 基金 47 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 三、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  | 刘伟                                   |    |                 |

（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  | 钟俊杰                                 |    |                |

## 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<br>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<br>法定代表人: 易会满<br>联系人: 杨菲<br>传真: 010-66107914<br>客服电话: 95588<br>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  | 中国银行股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。   | 办公地址: 中国北京市复兴门内大街 1 号<br>法定代表人: 刘连舸<br>电话: (010)66596688<br>传真: (010)66594946<br>客服电话: 95566<br>网址: <a href="http://www.boc.cn">http://www.boc.cn</a>                                                                  |

|   |                                 |                                                                                                                                                                                                        |
|---|---------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3 | 上海银行股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。       | 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号<br>法定代表人: 金煜<br>联系人: 王笑<br>电话: 021-68475888<br>传真: 021-68476111<br>客服电话: 95594<br>网址: <a href="http://www.bosc.cn">http://www.bosc.cn</a>                                      |
| 4 | 东莞银行股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。       | 办公地址: 东莞市莞城区体育路 21 号<br>法定代表人: 廖玉林<br>联系人: 朱杰霞<br>电话: 0769-22111802<br>传真: 0769-23156406<br>客服电话: 956033<br>网址: <a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>                  |
| 5 | 四川天府银行股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。     | 办公地址: 四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97 号 26 栋<br>法定代表人: 邢敏<br>联系人: 樊海波<br>电话: 028-67676033<br>传真: 028-67676033<br>网址: <a href="http://www.tf.cn">http://www.tf.cn</a>                                                |
| 6 | 上海天天基金销售有限公司<br>注:只代销 C 份额。     | 办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座<br>法定代表人: 其实<br>联系人: 屠彦洋<br>电话: 95021<br>传真: (021) 64385308<br>客服电话: 400-1818-188<br>网址: <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a>                     |
| 7 | 上海好买基金销售有限公司<br>注:只代销 C 份额。     | 办公地址: 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼<br>法定代表人: 杨文斌<br>联系人: 张茹<br>电话: 021-20613999<br>传真: 021-68596916<br>客服电话: 4007009665<br>网址: <a href="https://www.howbuy.com/">https://www.howbuy.com/</a>              |
| 8 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司<br>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<br>法定代表人: 张跃伟<br>联系人: 单丙烨<br>电话: 021-20691869<br>传真: 021-20691861<br>客服电话: 400-089-1289<br>网址: <a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a> |

|    |                              |                                                                                                                                                                                               |
|----|------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 9  | 浙江同花顺基金销售有限公司<br>注:只代销 C 份额。 | 办公地址: 浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大厦<br>法定代表人: 吴强<br>联系人: 林海明<br>传真: 0571-86800423<br>客服电话: 4008-773-772<br>网址: <a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a>                             |
| 10 | 上海陆金所基金销售有限公司<br>注:只代销 A 份额。 | 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元<br>法定代表人: 胡学勤<br>联系人: 宁博宇<br>电话: 021-20665952<br>传真: 021-22066653<br>客服电话: 4008219031<br>网址: <a href="http://www.lufunds.com">http://www.lufunds.com</a> |
| 11 | 珠海盈米基金销售有限公司<br>注:只代销 C 份额。  | 办公地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491<br>法定代表人: 肖雯<br>联系人: 黄敏嫦<br>电话: 020-89629019<br>传真: 020-89629011<br>客服电话: 020-89629066<br>网址: <a href="http://www.yingmi.cn">http://www.yingmi.cn</a>         |
| 12 | 国泰君安证券股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。  | 办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号<br>法定代表人: 贺青<br>联系人: 黄博铭<br>电话: (021)38676666<br>传真: (021)38670666<br>客服电话: 95521<br>网址: <a href="http://www.gtja.com">http://www.gtja.com</a>                         |
| 13 | 华泰证券股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。    | 办公地址: 江苏省南京市江东中路 228 号<br>法定代表人: 周易<br>联系人: 庞晓芸<br>电话: 0755-82492193<br>传真: 0755-82492962(深圳)<br>客服电话: 95597<br>网址: <a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>               |
| 14 | 万联证券股份有限公司<br>注:只代销 A 份额。    | 办公地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼<br>法定代表人: 罗钦城<br>联系人: 甘蕾<br>电话: 020-38286026<br>客服电话: 95322<br>网址: <a href="http://www.wlzq.cn">http://www.wlzq.cn</a>                                |

|    |                           |                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 15 | 国金证券股份有限公司<br>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<br>成证大厦 16 楼<br>法定代表人: 冉云<br>联系人: 刘婧漪、贾鹏<br>电话: 028-86690057、028-86690058<br>传真: 028-86690126<br>客服电话: 95310<br>网址: <a href="http://www.gjzq.com.cn">http://www.gjzq.com.cn</a>                                               |
| 16 | 青岛银行股份有限公司                | 办公地址: 山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼<br>法定代表人: 郭少泉<br>联系人: 徐伟静<br>电话: 0532-68629925<br>传真: 0532-68629939<br>客服电话: 96588(青岛)、4006696588(全国)<br>网址: <a href="http://www.qdccb.com/">http://www.qdccb.com/</a>                                                      |
| 17 | 青岛农村商业银行股份有限公司            | 办公地址: 山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 1 号楼<br>法定代表人: 刘仲生<br>联系人: 李洪姣<br>电话: 0532-66957228<br>传真: 0532-85933730<br>客服电话: 400-11-96668<br>网址: <a href="http://www.qrcb.com.cn">http://www.qrcb.com.cn</a>                                                                |
| 18 | 诺亚正行基金销售有限公司              | 办公地址: 上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋<br>法定代表人: 汪静波<br>联系人: 张裕<br>电话: 021-38509735<br>传真: 021-38509777<br>客服电话: 400-821-5399<br>网址: <a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>                                                                 |
| 19 | 深圳众禄基金销售股份有限公司            | 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<br>法定代表人: 薛峰<br>联系人: 童彩平<br>电话: 0755-33227950<br>传真: 0755-33227951<br>客服电话: 4006-788-887<br>网址: <a href="http://www.jjmmw.com">http://www.jjmmw.com</a> ; <a href="https://www.zlfund.cn">https://www.zlfund.cn</a> |
| 20 | 嘉实财富管理有限公司                | 办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 5-6 层<br>法定代表人: 赵学军<br>联系人: 景琪<br>电话: 021-20289890                                                                                                                                                                         |

|    |                  |                                                                                                                                                                                            |
|----|------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | 传真：021-20280110<br>客服电话：400-021-8850<br>网址： <a href="http://www.harvestwm.cn">http://www.harvestwm.cn</a>                                                                                  |
| 21 | 南京苏宁基金销售有限公司     | 办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号<br>法定代表人：刘汉青<br>联系人：喻明明<br>电话：025-66996699-884131<br>传真：025-66008800-884131<br>客服电话：95177<br>网址： <a href="http://www.snjjin.com/">http://www.snjjin.com/</a>         |
| 22 | 浦领基金销售有限公司       | 办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08<br>法定代表人：聂婉君<br>联系人：李艳<br>电话：010-59497361<br>传真：010-64788016<br>客服电话：400-012-5899<br>网址： <a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>            |
| 23 | 通华财富(上海)基金销售有限公司 | 办公地址：上海市浦东新区新金桥路 28 号新金桥大厦 5 楼<br>法定代表人：马刚<br>联系人：褚志朋<br>电话：021-60818730<br>传真：021-60818187<br>客服电话：40066-95156<br>网址： <a href="http://www.tonghuafund.com">http://www.tonghuafund.com</a> |
| 24 | 北京恒天明泽基金销售有限公司   | 办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛中心 30 层<br>法定代表人：周斌<br>联系人：侯艳红<br>电话：010-53572363<br>传真：010-59313586<br>客服电话：400-8980-618<br>网址： <a href="http://www.chtfund.com/">http://www.chtfund.com/</a>     |
| 25 | 北京唐鼎耀华基金销售有限公司   | 办公地址：北京市朝阳区建外大街 19 号国际大厦 A 座 1503<br>法定代表人：张冠宇<br>联系人：王丽敏<br>电话：010-85932810<br>传真：010-59200800<br>网址： <a href="http://www.tdyhfund.com">http://www.tdyhfund.com</a>                       |
| 26 | 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<br>法定代表人：于龙                                                                                                                                             |

|    |                  |                                                                                                                                                                                                                        |
|----|------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | <p>联系人：吴鹏<br/> 电话：010-56075718<br/> 传真：010-67767615<br/> 客服电话：400-680-2123<br/> 网址：<a href="http://www.zhixin-inv.com">http://www.zhixin-inv.com</a></p>                                                               |
| 27 | 海银基金销售有限公司       | <p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼 402 室<br/> 法定代表人：巩巧丽<br/> 联系人：秦琮<br/> 电话：021-80134149<br/> 传真：021-80133413<br/> 客服电话：4008081016<br/> 网址：<a href="http://www.fundhaiyin.com">http://www.fundhaiyin.com</a></p>              |
| 28 | 上海基煜基金销售有限公司     | <p>办公地址：上海昆明路 518 号北美广场 A1002<br/> 法定代表人：王翔<br/> 联系人：蓝杰<br/> 电话：021-65370077<br/> 传真：021-55085991<br/> 客服电话：4008-205-369<br/> 网址：<a href="http://www.jiyufund.com.cn">http://www.jiyufund.com.cn</a></p>               |
| 29 | 奕丰基金销售有限公司       | <p>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<br/> 法定代表人：TEO WEE HOWE<br/> 联系人：叶健<br/> 电话：0755-89460500<br/> 传真：0755-21674453<br/> 网址：<a href="https://www.ifastps.com.cn/">https://www.ifastps.com.cn/</a></p> |
| 30 | 大连网金基金销售有限公司     | <p>办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2F<br/> 法定代表人：樊怀东<br/> 联系人：于舒<br/> 电话：0411-39027828<br/> 传真：0411-39027835<br/> 客服电话：4000-899-100<br/> 网址：<a href="http://www.yibaijin.com/">http://www.yibaijin.com/</a></p>                |
| 31 | 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<br/> 法定代表人：弭洪军<br/> 联系人：茅旦青<br/> 电话：021-33355392<br/> 传真：021-63353736<br/> 客服电话：400-876-5716<br/> 网址：<a href="http://www.cmiwm.com/">http://www.cmiwm.com/</a></p>                      |
| 32 | 万家财富基金销售(天津)有限   | <p>办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保</p>                                                                                                                                                                                        |

|    |                                 |                                                                                                                                                                                              |
|----|---------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 公司                              | 险大厦 A 座 5 层<br>法定代表人：李修辞<br>联系人：王芳芳<br>电话：010-59013842/18519215322<br>传真：010-59013828<br>网址： <a href="http://www.wanjiawealth.com">http://www.wanjiawealth.com</a>                           |
| 33 | 阳光人寿保险股份有限公司                    | 办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼<br>昆泰国际大厦<br>法定代表人：李科<br>联系人：王超<br>电话：010-59053660<br>传真：010-59053700<br>客服电话：95510<br>网址： <a href="http://life.sinosig.com/">http://life.sinosig.com/</a>        |
| 34 | 中国人寿保险股份有限公司                    | 办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号<br>法定代表人：王滨<br>联系人：赵文栋<br>电话：010-63632878<br>客服电话：95519<br>网址： <a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a>                                           |
| 35 | 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<br>法定代表人：王廷富<br>联系人：徐亚丹<br>电话：021-68882280<br>传真：021-68882281<br>客服电话：400-821-0203<br>网址： <a href="https://www.520fund.com.cn/">https://www.520fund.com.cn/</a>  |
| 36 | 民生证券股份有限公司                      | 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 16-18 层<br>法定代表人：冯鹤年<br>联系人：程博怡<br>电话：(010)59355807<br>传真：(010)56437013<br>客服电话：400-619-8888<br>网址： <a href="http://www.msza.com/">http://www.msza.com/</a> |
| 36 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司<br>注：只代销 A 份额。 | 办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号<br>华融大厦 27 层 2704<br>法定代表人：洪弘<br>联系人：文雯<br>电话：010-83363101<br>传真：010-83363072<br>客服电话：400-166-1188                                                                  |

|    |                  |                                                                                                                                                                                                   |
|----|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | 网址: 8.jrj.com.cn                                                                                                                                                                                  |
| 37 | 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<br>法定代表人: 葛新<br>联系人: 杨琳<br>电话: 010-61952702<br>传真: 010-61951007<br>客服电话: 95055<br>网址: <a href="http://www.baiyingfund.com">http://www.baiyingfund.com</a>       |
| 38 | 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<br>法定代表人: 祖国明<br>联系人: 韩爱彬<br>电话: 021-60897840<br>传真: 0571-26697013<br>客服电话: 400-0766-123<br>网址: <a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>       |
| 39 | 北京汇成基金销售有限公司     | 办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室<br>法定代表人: 王伟刚<br>联系人: 丁向坤<br>电话: 010-56282140<br>传真: 010-62680827<br>客服电话: 400-619-9059<br>网址: <a href="http://www.hcjijin.com/">http://www.hcjijin.com/</a>   |
| 40 | 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<br>联系人: 李唯<br>电话: 010-62676405<br>传真: 010-62676582<br>客服电话: 010-62675369<br>网址: <a href="http://www.xincai.com">http://www.xincai.com</a>                      |
| 41 | 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<br>法定代表人: 王廷富<br>联系人: 徐亚丹<br>电话: 021-68882280<br>传真: 021-68882281<br>客服电话: 400-821-0203<br>网址: <a href="https://www.520fund.com.cn/">https://www.520fund.com.cn/</a> |
| 42 | 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<br>法定代表人: 张旭<br>联系人: 汪莹                                                                                                                                   |

|    |               |                                                                                                                                                                                                                           |
|----|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |               | <p>电话：010-58160168</p> <p>传真：010-58160173</p> <p>客服电话：400-810-55919</p> <p>网址：<a href="http://www.fengfd.com/">http://www.fengfd.com/</a></p>                                                                             |
| 43 | 和耕传承基金销售有限公司  | <p>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</p> <p>法定代表人：李淑慧</p> <p>联系人：裴小龙</p> <p>电话：0371-85518395 4000-555-671</p> <p>传真：0371-85518397</p> <p>网址：HGCCPB.COM</p>                                                         |
| 44 | 北京肯特瑞基金销售有限公司 | <p>办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层</p> <p>法定代表人：王苏宁</p> <p>联系人：陈龙鑫</p> <p>电话：4000988511</p> <p>传真：010-89188000</p> <p>客服电话：95118</p> <p>网址：<a href="http://kenterui.jd.com">kenterui.jd.com</a></p>        |
| 45 | 北京蛋卷基金销售有限公司  | <p>办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层</p> <p>法定代表人：钟斐斐</p> <p>联系人：侯芳芳</p> <p>电话：010-61840688</p> <p>传真：010-61840699</p> <p>客服电话：400-159-9288</p> <p>网址：<a href="https://danjuanapp.com/">https://danjuanapp.com/</a></p> |
| 46 | 华瑞保险销售有限公司    | <p>办公地址：上海市浦东区向城路 288 号 8 楼</p> <p>法定代表人：路昊</p> <p>联系人：张爽爽</p> <p>电话：021-68595976</p> <p>传真：021-68595766</p> <p>客服电话：952303</p> <p>网址：<a href="http://www.huaruisales.com">http://www.huaruisales.com</a></p>             |

（二） 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 | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A         |

|       |                |
|-------|----------------|
|       | 层              |
| 法定代表人 | 经雷             |
| 联系人   | 彭鑫             |
| 电话    | (010) 65215588 |
| 传真    | (010) 65185678 |

（三）律师事务所和经办律师

|         |                              |     |                |
|---------|------------------------------|-----|----------------|
| 名称      | 上海源泰律师事务所                    |     |                |
| 住所、办公地址 | 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼 |     |                |
| 负责人     | 廖海                           | 联系人 | 范佳斐            |
| 电话      | (021) 51150298-827           | 传真  | (021) 51150398 |
| 经办律师    | 范佳斐、刘佳                       |     |                |

（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                                       |     |                |

## 四、基金的名称

本基金名称：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

## 五、基金的类型

本基金类型：ETF 联接基金、契约型开放式

## 六、基金的投资目标

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，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%。

## 七、基金的投资范围

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。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、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

## 八、基金的投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还将适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。

### ①股指期货投资策略

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。

### ②权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

### ③资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例证券的增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提下，以期获得长期稳定收益。

#### 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。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：富时中国 A50 指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%。

富时中国 A50 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、或富时中国 A50 指数编制机构变更或停止富时中国 A50 指数的编制及发布、或富时中国 A50 指数由其他指数替代、或富时中国 A50 指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致富时中国 A50 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）且在不损害持有人利益的前提下，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为嘉实富时中国 A50ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实富时中国 A50ETF 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富时中国 A50 指数及嘉实富时中国 A50ETF 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。

## 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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 6 月 30 日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

## 1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                    | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-----------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资                  | 195,903.00    | 0.48         |
|    | 其中：股票                 | 195,903.00    | 0.48         |
| 2  | 基金投资                  | 37,570,709.12 | 92.42        |
| 3  | 固定收益投资                | —             | —            |
|    | 其中：债券                 | —             | —            |
|    | 资产支持证券                | —             | —            |
| 4  | 贵金属投资                 | —             | —            |
| 5  | 金融衍生品投资               | —             | —            |
| 6  | 买入返售金融资产              | —             | —            |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | —             | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 2,326,324.66  | 5.72         |
| 8  | 其他资产                  | 560,985.95    | 1.38         |
| 9  | 合计                    | 40,653,922.73 | 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<br>（%） |
|----|------------------|-----------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 8,200.00  | 0.02             |
| B  | 采矿业              | 3,838.00  | 0.01             |
| C  | 制造业              | 72,220.00 | 0.18             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,788.00  | 0.01             |
| E  | 建筑业              | 2,862.00  | 0.01             |
| F  | 批发和零售业           | —         | —                |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —         | —                |
| H  | 住宿和餐饮业           | —         | —                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,452.00  | 0.00             |
| J  | 金融业              | 91,267.00 | 0.23             |
| K  | 房地产业             | 12,276.00 | 0.03             |
| L  | 租赁和商务服务业         | —         | —                |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —         | —                |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —         | —                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —         | —                |
| P  | 教育               | —         | —                |
| Q  | 卫生和社会工作          | —         | —                |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —         | —                |

|   |    |            |      |
|---|----|------------|------|
| S | 综合 | -          | -    |
|   | 合计 | 195,903.00 | 0.49 |

### 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<br>(股) | 公允价值<br>(元) | 占基金资产净值比<br>例 (%) |
|----|--------|-------|-----------|-------------|-------------------|
| 1  | 601318 | 中国平安  | 300       | 21,420.00   | 0.05              |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 100       | 17,112.00   | 0.04              |
| 3  | 600036 | 招商银行  | 400       | 13,488.00   | 0.03              |
| 4  | 000651 | 格力电器  | 200       | 11,314.00   | 0.03              |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药  | 100       | 9,230.00    | 0.02              |
| 6  | 002714 | 牧原股份  | 100       | 8,200.00    | 0.02              |
| 7  | 601166 | 兴业银行  | 500       | 7,890.00    | 0.02              |
| 8  | 000002 | 万 科 A | 300       | 7,842.00    | 0.02              |
| 9  | 600030 | 中信证券  | 300       | 7,233.00    | 0.02              |
| 10 | 600887 | 伊利股份  | 200       | 6,226.00    | 0.02              |

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 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

无。

### 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<br>(元)   | 占基金资产<br>净值<br>比例 (%) |
|----|---------------|------|--------|------------|---------------|-----------------------|
| 1  | 嘉实富时中国 A50ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 嘉实基金管理有限公司 | 37,570,709.12 | 94.25                 |

### 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   | 19,508.63  |
| 2  | 应收证券清算款 | 194,000.56 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 242.20     |
| 5  | 应收申购款   | 347,234.56 |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 560,985.95 |

### (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。

## 十二、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）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实富时中国 A50ETF 联接 A

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                                                           | 率①      | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |        |        |
|-----------------------------------------------------------|---------|-----------|------------|-------------------|--------|--------|
| 2017 年 6 月 29 日<br>（基金合<br>同生效<br>日）至<br>2017 年 12 月 31 日 | 9.95%   | 0.71%     | 14.85%     | 0.78%             | -4.90% | -0.07% |
| 2018 年                                                    | -19.37% | 1.36%     | -20.22%    | 1.37%             | 0.85%  | -0.01% |
| 2019 年                                                    | 41.26%  | 1.17%     | 36.38%     | 1.17%             | 4.88%  | 0.00%  |
| 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日                        | 1.49%   | 1.34%     | -2.72%     | 1.37%             | 4.21%  | -0.03% |

嘉实富时中国 A50ETF 联接 C

| 阶段                                                         | 净值增长<br>率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|------------------------------------------------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 2018 年 2 月 22 日<br>（C 类份<br>额成立<br>日）至<br>2018 年 12 月 31 日 | -20.19%    | 1.36%             | -21.13%            | 1.36%                     | 0.94% | 0.00%  |
| 2019 年                                                     | 40.58%     | 1.17%             | 36.38%             | 1.17%                     | 4.20% | 0.00%  |
| 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日                         | 1.28%      | 1.34%             | -2.72%             | 1.37%                     | 4.00% | -0.03% |

（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

### 嘉实富时中国 A50ETF 联接基金 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

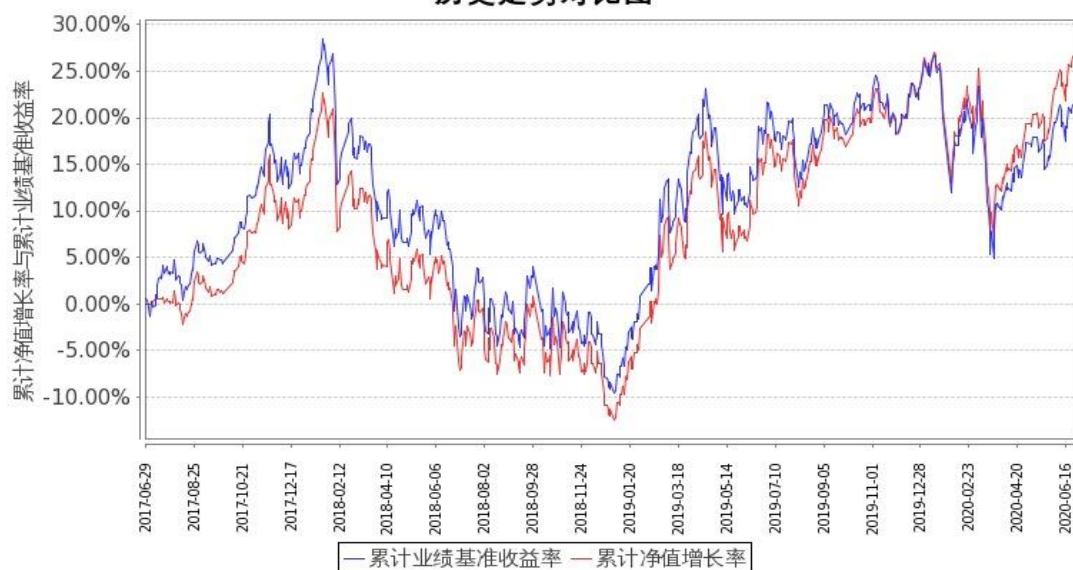


图 1：嘉实富时中国 A50ETF 联接基金 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2017 年 6 月 29 日至 2020 年 6 月 30 日)

### 嘉实富时中国 A50ETF 联接基金 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

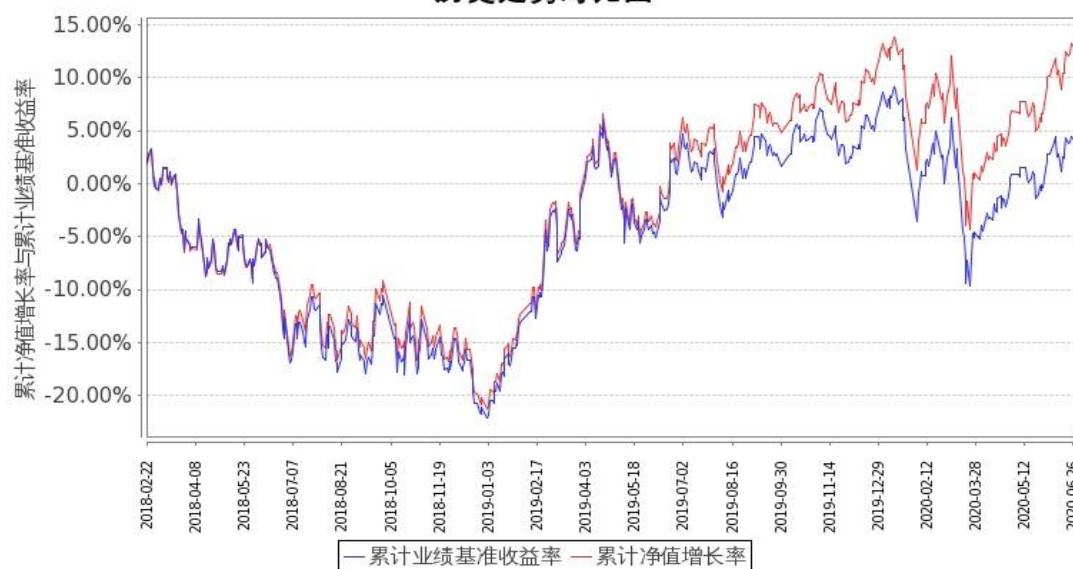


图 2：嘉实富时中国 A50ETF 联接基金 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 2 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 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（十二（二）投资范围和（五）投资限

制）的有关约定。

## 十三、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼或仲裁费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （9）基金的开户费用、账户维护费用；
- （10）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。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。基金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，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前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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。

##### （2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。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% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日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，经管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

### （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前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，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。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（10）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，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。

## （二）与基金销售有关的费用

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。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 类基金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 < 50 万元           | 1.2%           |
| 50 万元 ≤ M < 200 万元  | 0.8%           |
| 200 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.4%           |
| M ≥ 500 万元          | 按笔收取，每笔 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 类基金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 类基金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 类基金份额，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 类基金份额的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注：2014 年 9 月 2 日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自 2017 年 7 月 6 日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（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，本基金 A 类基金份额优惠后的费率见下表：

| 持有期限（T）   | 基金网上直销 后端申购优惠费率 |
|-----------|-----------------|
| 0<T<1 年   | 0.20%           |
| 1 年≤T<3 年 | 0.10%           |
| T≥3 年     | 0.00%           |

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。

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2、本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金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。

（1）本基金 A 类份额的赎回费用由 A 类基金份额持有人承担，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。除此之外的赎回费中不低于赎回费总额的 25% 的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下：

| 持有期限（M）       | 赎回费率  |
|---------------|-------|
| M<7 天         | 1.50% |
| 7 天≤M<365 天   | 0.5%  |
| 365 天≤M<730 天 | 0.25% |
| M≥730 天       | 0     |

（2）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（M） | 赎回费率 |
|---------|------|
| M<7 天   | 1.5% |
| M≥7 天   | 0    |

C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产。

基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金销售机构可以在不违反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，定期或不定期地开展基金促销活动。

### 3、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。

### （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；
- 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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

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

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关内容。
3. 在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关内容。
4. 在“五、相关服务机构”部分：更新相关销售机构的信息。
5. 在“八、基金份额的申购与赎回”部分：更新了基金转换的相关内容。
6. 在“九、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
7. 在“十、基金的业绩”部分：更新了基金业绩的相关数据。
8. 在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分：更新了对基金份额持有人服务的相关内容。
9. 在“二十二、其他应披露事项”部分：列示了相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司  
2020 年 08 月 07 日