

# 嘉实新兴市场债券型证券投资基金更新招募说明书

(2023年01月18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

嘉实新兴市场债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2013 年 9 月 4 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]1154 号）和 2013 年 10 月 10 日《关于嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]860 号）的核准公开发售，本基金基金合同于 2013 年 11 月 26 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

根据本基金基金合同约定，嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金分级运作期为 2 年，并在分级运作期满后转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金。2015 年 11 月 26 日，嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金。

本招募说明书是对原《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金主要投资于以新兴市场债券为代表的全球证券市场，基金净值会因为所投资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，同时承担基金投资中出现的各类风险：一是境外投资风险，包括境外市场风险、新兴市场国家风险和政府管制风险、政治风险、汇率风险、法律风险、税收风险、会计核算风险等；二是本基金

特有风险，包括投资标的风险、衍生品风险、流动性风险、交易结算风险、利率风险等；三是其他风险，包括管理风险、操作风险和技术风险、顺延或暂停赎回风险以及不可抗力风险等。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。本基金为债券型基金，主要投资于新兴市场的各类债券，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

投资者认购或申购基金份额时应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.000 美元或 1.000 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.000 美元或 1.000 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.000 美元或 1.000 元，从而遭受损失的风险。

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。

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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定及相关公告，本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容，并对基金管理人信息一并更新，涉及“基金管理人”“基金的费用与税收”等章节。

## 目录

|                                 |     |
|---------------------------------|-----|
| 一、绪言.....                       | 4   |
| 二、释义.....                       | 5   |
| 三、风险揭示.....                     | 11  |
| 四、基金的投资.....                    | 18  |
| 五、基金的业绩.....                    | 30  |
| 六、基金管理人.....                    | 34  |
| 七、基金的分级.....                    | 43  |
| 八、基金的募集.....                    | 49  |
| 九、基金合同的生效.....                  | 53  |
| 十、基金份额折算.....                   | 54  |
| 十一、基金份额的申购、赎回.....              | 55  |
| 十二、基金份额分级运作终止后的基金份额转换.....      | 72  |
| 十三、基金的费用与税收.....                | 74  |
| 十四、基金的财产.....                   | 77  |
| 十五、基金资产估值.....                  | 78  |
| 十六、基金的收益与分配.....                | 84  |
| 十七、基金的会计与审计.....                | 86  |
| 十八、基金的信息披露.....                 | 87  |
| 十九、基金合并、基金合同的变更、终止与基金资产的清算..... | 93  |
| 二十、基金托管人.....                   | 97  |
| 二十一、境外托管人.....                  | 101 |
| 二十二、相关服务机构.....                 | 103 |
| 二十三、基金合同内容摘要.....               | 127 |
| 二十四、基金托管协议的内容摘要.....            | 141 |
| 二十五、对基金份额持有人的服务.....            | 158 |
| 二十六、其他应披露事项.....                | 160 |
| 二十七、招募说明书存放及查阅方式.....           | 161 |
| 二十八、备查文件.....                   | 162 |

## 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》”）、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号<招募说明书的内容与格式>》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》（以下简称《通知》）等有关法律法规以及《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指嘉实新兴市场债券型证券投资基金，在基金份额分级运作终止并转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，亦指嘉实新兴市场债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实新兴市场债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《嘉实新兴市场债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指2012年11月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《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
- 14、《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
- 15、《试行办法》：指中国证监会2007年6月18日颁布、同年7月5日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

- 16、《通知》：指中国证监会2007年6月18日公布的《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订
- 17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 19、外管局：指国家外汇管理局或其分支机构
- 20、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 21、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 22、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 23、合格境外机构投资者：指相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 24、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 25、基金份额持有人：指根据基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 26、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。
- 27、销售机构：指嘉实基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
- 28、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 29、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 30、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 31、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 32、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 33、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

34、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

39、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日为本基金的开放日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外，其中主要投资市场在招募说明书中载明和更新。

40、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

41、《业务规则》：指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是由基金管理人制定并不时修订，规范基金管理人所管理的、由基金管理人担任登记机构的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

45、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

46、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

47、基金份额分级：指自基金合同生效之日起2年内，本基金的基金份额划分为嘉实新兴市场A、嘉实新兴市场B两级份额

48、嘉实新兴市场A：指嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金之嘉实新兴市场A份额（也称为美元份额）。嘉实新兴市场A以美元计价并进行认购、申购、赎回。在嘉实新兴市场A的开放日，接受本级份额的申购与赎回

49、嘉实新兴市场B：指嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金之嘉实新兴市场B份额（也称为人民币份额）。嘉实新兴市场B以人民币计价并进行认购、申购、赎回。嘉实新兴市场B自基金合同生效之日起2年内封闭运作，即自基金合同生效之日起至2年后对应日止（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）

50、嘉实新兴市场 A 的开放日：指自基金合同生效之日起 2 年内每满 6 个月之日（但不包括自基金合同生效之日后满 2 年的对应日），如该日为非工作日，则为该日之前的最近一个工作日。如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放日为不可抗力或其他情形消除之日的下一个工作日

51、嘉实新兴市场 A 的基金份额折算：指在嘉实新兴市场 A 开放日，嘉实新兴市场 A 的基金份额净值调整为 1.000 美元，其基金份额数按折算比例相应增加或减少的行为。因本基金的估值日为 T+1 日，嘉实新兴市场 A 的基金份额折算以嘉实新兴市场 A 开放日为基准，在嘉实新兴市场 A 开放日的下一个工作日进行

52、美元利率参照银行：指中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司及中国建设银行股份有限公司

53、嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率：嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率为“同期美元利率参照银行公布的一年期美元定期存款利率的平均值+浮动利差”。基金管理人根据市场情况，在基金份额发售之日前及每一个开放日前公告接下来 6 个月的浮动利差的利差值。利差的取值范围从 1%（含）到 2%（含）”。在基金合同生效日，基金管理人将根据届时美元利率参照银行公布并执行的一年期美元定期存款利率和在基金份额发售之日前公告的利差值设定并公告嘉实新兴市场 A 份额的首次约定年收益率，该收益率即为嘉实新兴市场 A 基金合同生效后最初 6 个月的年收益率，适用于基金合同生效日（含）到第 1 个开放日（含）的时间段；在嘉实新兴市场 A 份额的每个开放日，基金管理人将根据该日美元利率参照银行公布并执行的一年期美元定期存款利率及利差值重新设定并公告嘉实新兴市场 A 的年收益率，该收益率即为嘉实新兴市场 A 接下来 6 个月的年收益率，适用于该开放日（不含）到下个开放日（含）的时间段；在嘉实新兴市场 A 的最后 1 个开放日，基金管理人将根据该日美元利率参照银行公布并执行的一年期美元定期存款利率及利差值重新设定并公告嘉实新兴市场 A 的年收益率，该收益率适用于该开放日（不含）到本基金分级运作届满日（含）的时间段。根据约定年收益率所计算的嘉实新兴市场 A 份额持有人的可得收益仅为对嘉实新兴市场 A 份额持有人可得收益的估计，并不代表嘉实新兴市场 A 份额持有人的实际可得收益。基金管理人并不承诺或保证嘉实新兴市场 A 份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，嘉实新兴市场 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定可得收益的风险甚至损失本金的风险。如果今后相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的美元利率参照基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更美元利率参照基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会

54、嘉实新兴市场 B 的封闭期：指自基金合同生效之日起至分级运作届满日之间的期间



55、分级运作期：指自基金合同生效之日起至满 2 年的对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）止的期间

56、分级运作届满日：指自基金合同生效之日后满 2 年的对应日。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日

57、嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额：本基金依据基金合同约定和基金管理人的公告转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，根据申购费、销售服务费收取方式及计价和销售币种的不同将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行申购，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额（也称为人民币份额）

58、嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额：本基金依据基金合同约定和基金管理人的公告转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，根据申购费、销售服务费收取方式及计价和销售币种的不同将基金份额分为不同的类别。以美元计价并进行申购，从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，对于持有期限不少于 30 日的本类别基金份额的赎回亦不收取赎回费，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额，称为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额（也成为美元份额）

59、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

60、巨额赎回：指本基金分级运作期内，在嘉实新兴市场 A 的单个开放日，经过申购与赎回申请的成交确认后，嘉实新兴市场 A 的净赎回份额超过本基金前一日嘉实新兴市场 A 总份额的 10%时的情形；也指本基金依据基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，本基金单个开放日，本基金某类基金份额的净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日该类基金份额总数的 10%

61、基准货币：指基金资产估值的记账本位币。本基金的基准货币为人民币

62、人民币：指中国法定货币

63、美元：指美国法定货币及法定货币单位

64、元：如无特指，指人民币元

65、汇率：如无特指，指中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价

66、基金利润：指基金利息收入、投资收益、汇兑损益、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

67、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

70、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

71、基金份额参考净值：指本基金分级运作期内，基金管理人在计算基金资产净值、基金份额净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值，其中，嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值计算日不包括嘉实新兴市场 A 的开放日和分级运作届满日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

72、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的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）等媒介

73、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

74、中国：指中华人民共和国（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）

75、基金产品资料概要：指《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、风险揭示

风险管理是基金管理中相当重要的一环，由于基金在其资产运作和内部组织管理等多方面均可能蕴含风险，因此，基金管理人将在总结、借鉴本公司旗下已有的封闭式基金和开放式基金风险管理成熟经验基础上，针对本基金特点，建立相应的风险管理体系，保证本基金在有效控制风险的同时，为基金持有人谋取长期稳定回报。

#### （一） 境外投资风险

##### 1、境外市场风险

境外市场风险是指本基金主要投资于具有良好流动性的境外相关金融工具，证券价格可能会因为国际政治环境、宏观与微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险。此外，境外证券市场可能由于对于负面的特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反应较境内证券市场有诸多不同。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

##### 2、新兴市场国家风险和政府管制风险

本基金主要投资于新兴市场国家和地区市场，相比于发达国家，新兴市场国家或地区的经济结构和政治体制相对不够稳定，对市场的管制程度和具体措施较境内市场有所不同，可能通过该国的财政、货币、产业等方面的政策进行管制，由此导致市场波动而影响基金收益。

##### 3、政治风险

基金所投资的国家因政治局势变化(如罢工、暴动、战争等)或法令的变动,可能导致市场的较大波动,从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。此外,基金所投资的国家可能会不时采取某些管制措施,如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化以及征收高额税收等,从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

##### 4、汇率风险

本基金以美元和人民币募集，主要投资于新兴市场国家或地区的政府、机构和企业发行的以美元或离岸人民币计价的固定收益证券，外币相对于人民币的汇率变化可能会影响本基金的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。

在本基金的分级运作期内，嘉实新兴市场 A 以美元募集和计价，根据基金合同的规定获取约定收益，因此在一般情况下不会面临汇率风险；嘉实新兴市场 B 以人民币募集和计价，获得本基金在扣除嘉实新兴市场 A 的约定收益后的全部剩余收益，如本基金收益不足以支付嘉实新兴市场 A 的约定收益及本金，则以嘉实新兴市场 B 的本金弥补，因此嘉实新兴市场 B 需承担全部基金资产所面临的汇率风险。

本基金分级运作届满并按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，以人民币计价并接受申购、赎回的 A1 类份额和以美元计价并接受申购、赎回的 C2 类份额将共同承担基金资产所面临的汇率风险。

#### 5、法律风险

由于各个国家适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为在部分国家受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能。

#### 6、税务风险

税务风险是指本基金投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响；各国、地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项都可能对本基金造成影响。

#### 7、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误。由于不同国家对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定存在一定差异，可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差，从而给本基金投资带来潜在风险。同时基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，可能由于客观原因与非主观故意造成行为过失，从而对基金收益造成影响。

### （二） 本基金特有风险

#### 1、投资标的风险

本基金投资组合中债券类资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于新兴市场债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。因此本基金的投资有可能面临以下债券投资风险：

##### （1）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险是债券投资所面临的主要风险，息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平。

##### （2）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。

##### （3）信用风险

信用风险是指债券或其他金融产品发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额进行到期支付的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券及金融产品的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级变化或市场对某一信用等级水平下预期收益率的变化都会迅速地改变债券及金融产品的价格，从而影响到基金资产价值。

#### 2、衍生品风险

### （1）衍生品市场风险

本基金管理中为规避系统性风险、单支证券风险和汇率风险将使用股指期货和期权、股票期货、期权和权证，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融衍生工具。因此，各种金融衍生品的价格波动将直接影响本基金资产的价值。

### （2）衍生品模型风险

本基金在组合避险和汇率风险规避时采用套期保值方式，将计算组合套期保值比例以调整金融衍生品的头寸。由于资本市场的剧烈波动，或不可抗力，按模型结果调整衍生品的持仓比例或难以实现套期保值的目标，将给本基金的收益带来影响。

### （3）交易对手风险

交易对手风险指柜台衍生品交易中交易对手不履约的风险。本基金会通过控制交易对手方的最低信用用品评级、任一交易对手方的市值计价敞口限制等策略减小本基金交易对手风险暴露。

## 3、流动性风险

市场流动性风险是指由于市场深度不够或者其他原因，导致投资机构不能在不影响市场价格的情况下买入或卖出证券。由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的要求。但是在市场下跌时可能会出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额赎回申请，则基金资产的仓位调整或变现困难，成本很高，基金面临流动性风险，可能影响基金份额净值。同时，由于本基金涉及跨境交易，其赎回到账期通常要比现有开放式基金更长的时间。

### （1）分级运作届满日后基金的申购、赎回时间安排

#### 1）转型前

投资人在嘉实新兴市场 A 的开放日办理嘉实新兴市场 A 份额的申购和赎回，具体办理时间为开放日上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日的交易时间，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）转型后

上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日为本基金的开放日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外。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、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日的交易时间，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。

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、行业及资产的流动性风险评估

### ①投资市场的流动性风险

本基金投资于政府债券、政府支持债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券、房地产信托凭证（REITs）、公募基金（包括ETF）、货币市场工具、结构性投资产品、利率互换、信用违约互换、债券期货、货币远期或期货合约、外汇互换等。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。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。

### ②投资行业的流动性风险

宏观信用环境变化，影响同一发债人的违约概率，影响不同发债人间的违约相关度，影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率，影响不同信用等级发债人的违约概率。同时，不同行业对宏观经济的相关性差异显著，不同行业的潜在违约率差异显著。本基金借助“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究平台，基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究，运用定性定量模型，在自下而上的个债精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

### ③投资资产的流动性风险

本基金绝大部分基金资产投资于 7 个工作日可变现资产，包括可在银行间市场正常交易的债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

## （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

### 1）转型前

若本基金单个开放日内的嘉实新兴市场 A 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）超过前一日的嘉实新兴市场 A 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延期支付赎回款项；
- ②中国证监会认定的其他措施。

## 2) 转型后

若本基金单个开放日内本基金某类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）超过上一开放日该类基金份额总数的 10%，即认为该类基金份额发生了巨额赎回。

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上一开放日该类基金总份额 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本基金分级运作期内，若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延期支付赎回款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、赎回——（二）嘉实新兴市场 A 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。

本基金分级运作届满日后，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、赎回——（三）分级运作届满日后本基金的申购与赎回”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。

## 4、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

## 5、嘉实新兴市场 A 的本金风险

基金管理人承诺也不保证嘉实新兴市场 A 的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实新兴市场 A 的基金份额持有人也可能损失本金。

#### 6、嘉实新兴市场 B 的杠杆性风险

本基金在扣除嘉实新兴市场 A 的约定收益后的全部剩余收益归嘉实新兴市场 B 享有，亏损以嘉实新兴市场 B 的资产净值为限由嘉实新兴市场 B 承担。嘉实新兴市场 B 具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般债券型基金更高的风险特征，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实新兴市场 B 的基金份额持有人可能遭受全部的投资损失。

#### 7、非开放日不能赎回的风险

在本基金分及运作期内，嘉实新兴市场 A 自《基金合同》生效之日起届满 6 个月、12 个月和 18 个月开放，嘉实新兴市场 B 封闭运作，且不上市交易。在本基金的非开放日，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。

#### 8、利率风险

嘉实新兴市场 A 份额的约定收益率为“同期美元利率参照银行公布的一年期美元定期存款利率的平均值+浮动利差[1% - 2%（含）]”。因此，嘉实新兴市场 A 的约定收益率有可能会根据同期美元利率参照银行公布的一年期美元定期存款利率的平均值下调，从而会出现利率风险。嘉实新兴市场 B 的资产非配份额也有可能因嘉实新兴市场 A 约定收益率的上调而减少，从而出现利率风险。

#### 9、基金份额分级运作终止后基金份额转换风险

本基金分级运作届满日，本基金嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 分级运作终止，本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金。在基金份额转换前，基金份额持有人可选择将其持有的嘉实新兴市场 A 份额赎回、或是转入嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额。投资者不选择的，其持有的嘉实新兴市场 A 份额将被默认为转入嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险。在基金份额转换时，所有嘉实新兴市场 B 份额将转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额。在基金份额转换后，嘉实新兴市场 B 将不再内含杠杆机制，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

#### 10、基金的收益分配

本基金分级运作期内，本基金不进行收益分配。对于嘉实新兴市场 A，在嘉实新兴市场 A 的开放日基金管理人将根据《基金合同》的约定对嘉实新兴市场 A 实施基金份额折算。嘉实新兴市场 A 进行基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过赎回折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者可能须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额赎回的

价格波动风险。



### 11、份额配比变化风险

本基金经汇率折算后的嘉实新兴市场A与嘉实新兴市场B之比原则上不超过6:4，由于嘉实新兴市场A、嘉实新兴市场B将独立发售，两级份额在基金募集设立时的具体份额配比可能低于6:4；本基金成立后，由于嘉实新兴市场A每次开放后的基金份额余额是不确定的，在嘉实新兴市场A每次开放结束后，嘉实新兴市场A、嘉实新兴市场B的份额配比可能发生变化，从而出现份额配比变化风险。

### （三）其他风险

#### 1、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。例如资产配置、类属配置因市场原因可能无法达到预期收益目标；也可能表现在个券的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

#### 2、操作风险和技术风险

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原因可能引致风险，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人、境外投资顾问、基金托管人、境外托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 3、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

#### 4、不可抗力风险

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、代理机构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份额持有人利益受损。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围包括政府债券、政府支持债券、公司债券（包括公司发行的金融债券）、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券、房地产信托凭证（REITs）、公募基金（包括ETF）、货币市场工具、结构性投资产品、利率互换、信用违约互换、债券期货、货币远期或期货合约、外汇互换等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中债券类资产占基金资产的比例不低于80%；投资于新兴市场债券的比例不低于非现金基金资产的80%。现金和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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

“新兴市场债券”指新兴市场国家或地区的政府发行的债券、总部登记注册在新兴市场国家或地区或主要业务收入/资产在新兴市场国家或地区的机构、企业等发行的债券，主要包括离岸人民币债券及中国、香港美元债券部分亚洲及其他新兴市场国家或地区政府、金融机构及公司发行的以美元或本币计价的固定收益证券。

“新兴市场国家或地区”所指的国家或地区主要包括：中国、韩国、台湾、香港、新加坡、印度、土耳其、泰国、马来西亚、印度尼西亚、以色列、菲律宾、中东地区、南非、埃及、摩洛哥、俄罗斯、捷克、波兰、匈牙利、巴西、墨西哥、智利、哥伦比亚、秘鲁等国家或地区。本基金主要投资于与中国证监会签署备忘录的新兴市场国家或地区的证券。

### （三）投资策略

本基金在控制基金组合风险的基础上，追求实现良好收益率的目标。

#### 1、资产配置策略

本基金通过研究全球新兴市场经济运行趋势，深入分析不同国家和地区财政及货币政策对经济运行的影响，结合对中长期利率走势、通货膨胀及各类债券的收益率、波动性的预期，自上而下地决定债券组合久期，对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。

## 2、债券投资策略

### （1）久期策略

本基金将通过积极主动地预测市场利率的变动趋势，相应调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的，主要投资策略包括战略性久期配置和短期策略性久期调整：

在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态及陡峭度，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合的战略性久期配置。

短期策略性久期调整主要通过对市场短期趋势、资金流动、经济数据发布等因素所引起的市场利率、价格波动的研究来调整投资组合久期。预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

### （2）信用债券投资策略

本基金通过承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注个别债券的选择和行业配置两方面。在定性与定量分析结合的基础上，通过“自上而下”与“自下而上”相结合的分析策略，在信用类固定收益金融工具中进行个债的精选，结合适度分散的行业配置策略，构造和优化组合。

通过采用“嘉实信用分析系统”的信用评级和信用分析，包括宏观信用环境分析、行业趋势分析、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、债务契约分析、特殊事项风险分析等，依靠嘉实信用分析团队及嘉实中央研究平台的其他资源，深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况，严格遵守嘉实信用分析流程，执行嘉实信用投资纪律。

#### 1）个别债券选择

本基金依据“嘉实信用分析系统”的研究成果，执行“嘉实投资备选库流程”，生成或更新买入信用债券备选库，强化投资纪律，保护组合质量。

本基金主要从信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、信用评级、收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）、剩余期限、久期、凸性、流动性（发行总量、流通量、上市时间）等指标，结合组合管理层面的要求，决定是否将个债纳入组合及其投资数量。

#### 2）行业配置

宏观信用环境变化，影响同一发债人的违约概率，影响不同发债人间的违约相关度，影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率，影响不同信用等级发债人的违约概率。同时，不同行业对宏观经济的相关性差异显著，不同行业的潜在违约率差异显著。

本基金借助“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究平台，基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面的研究，运用定性定量模型，在自下而上的个债精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

### 3）信用风险控制措施

本基金实施谨慎的信用评估和 market 分析、个债和行业层面的分散化投资策略，当发债企业的基本面情况出现恶化时，运用“尽早出售（first sale, best sale）”策略，控制投资风险。

本基金使用各信用级别持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要偿债指标范围等描述性统计指标，还运用 VaR、Credit Metrics、Credit Portfolio Views 等模型，估计组合在给定置信水平和事件期限内可能遭受的最大损失，以便有效评估和控制组合信用风险暴露。

### 4）高收益债投资策略

高收益债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。高收益债收益率由基准收益率与信用利差叠加组成，信用风险表现在信用利差的变化上；信用利差主要受两方面影响，一是系统性信用风险，即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是非系统性信用风险，即该信用债本身的信用变化。

本基金运用深刻的基本面研究，力求前瞻性判断经济周期，在经济周期的复苏初期保持适当增加的高收益债配置比例，在经济周期的过热期保持适当降低高收益债配置比例。

### （3）货币投资策略

本基金通过分析亚洲及全球主要新兴市场因经济基本面、技术侧面和市场行为等因素对中长期汇率变动进行预测，深入研究并跟踪影响不同国家或地区汇率的驱动因素（包括宏观经济形势、财政及货币政策、资金流动等）发现投资价值。

### （4）其它债券投资策略

#### 1）期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，通过嘉实债券组合优化数量模型，确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

#### 2）骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于

相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的将是债券价格的走高，而这一期间债券的涨幅将会高于其他期间，这样就可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。

### 3) 息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

### 3、房地产投资信托投资策略

本基金将少量选择拥有优质房地产资产、良好管理能力和稳健资产负债表的房地产投资信托进行投资，在扩大分红收益和资本增长的同时注意分散风险。

本基金基于定性和定量估值因素对投资范围进行评级，以推动基金对单支证券选择。根据投研团队对于当地市场的前景和单支证券的盈利能力和风险分析，决定买入和卖出证券。在做出买卖证券的决策前，需要对各个地区的房地产市场进行深入研究，并遵守系统的风险管理方案，寻求具备价值升值潜力、能提供长期优厚回报的证券。

### 4、衍生工具投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用衍生工具，控制下跌风险，对冲汇率风险，实现保值和锁定收益。

为对冲汇率风险，本基金将投资于外汇远期合约、外汇期货、外汇期权、外汇互换协议、利率期权等金融工具。投资流程如下：基金经理提交投资衍生品的建议报告，其中应包括宏观分析、市场分析、决策依据（结合定量部门计算的组合beta值）、采用的具体合约种类、数量、到期日、合约的流动性分析等。

风险控制部门根据报告计算相应的指标，包括在险价值分析、情景分析、压力测试等，并对基金经理的投资建议表示意见。投资决策委员会根据内部流程进行最终决策。在投资策略实施后，基金经理根据市场状况和组合仓位情况做出期货合约的平仓或加仓决定，同时报投资决策委员会批准。

风险控制部门每日须对组合头寸和保证金情况进行监控，以确保流动性足够以及符合基金合同规定的投资限制，发现问题立即向投资决策委员会报告。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新招募说明书中公告。

### 5、组合风险控制措施

“嘉实下行风险波动模型”，从组合层面以及个券层面分别度量组合潜在的下行风险，根据宏观环境以及证券市场表现，设置一定的阈值，将组合可能的下行波动控制在较小范围内。在组合层面，本基金使用下方波动率、CVAR（条件在险价值）等指标，结合情景分析和压力测试的方法，评价组合在未来一段时间发生下行波动的可能性及幅度。在个券层面，对债券等固定收益类资产，本基金将通过凸度分析法，将债券的凸度与宏观环境相联系，

当预期未来进入加息通道、债券市场收益率水平持续上移时，本基金根据期限结构和类属配置目标，通过凸性分析选择波动特性最优的债券，从而降低组合可能面临的下行风险。

## 6、投资决策

### （1）决策依据

- 1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- 2）宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况。
- 3）分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### （2）决策程序

- 1）投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
- 2）相关研究部门或岗位根据嘉实中央研究平台、嘉实信用分析系统等流程规定，进行分析，提出分析报告。
- 3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
- 4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
- 5）合规管理部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

## （四）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定；
- （2）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，在基金托管账户的存款可以不受上述限制；
- （3）本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

（5）本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量；同一机构境内外上市的总股本将合并计算，同时全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券将一并计算，并假设对持有的股本权证行使转换；

（6）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%；前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

（7）本基金持有任何一只境外基金不得超过基金资产净值的 10%，持有货币市场基金可以不受上述限制；

（8）同一境内机构投资者管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

（9）本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

① 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

② 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

③ 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

a) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

b) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

c) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%；

d) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品；

基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告；

（10）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

② 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%；

③ 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

④ 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

- a) 现金；
- b) 存款证明；
- c) 商业票据；
- d) 政府债券；
- e) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；

⑤ 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

⑥ 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

（11）本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

① 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

② 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

③ 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

④ 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

（12）基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

（13）本基金如果参与境内逆回购交易，还应当遵守：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。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定或设定其他本基金须遵循的比例限制的，从其规定。



因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（13）项规定外，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门调整上述限制的，基金管理人有权按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）购买不动产；
- （2）购买房地产抵押按揭；
- （3）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （4）购买实物商品；
- （5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金、集合计划资产净值的 10%；
- （6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （7）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （8）从事证券承销业务；
- （9）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （10）从事承担无限责任的投资；
- （11）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （12）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；
- （13）不公平对待不同客户或不同投资组合；
- （14）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；
- （15）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

上述禁止行为的设定依据为基金合同生效时法律法规及监管机关的要求，如果法律法规或监管机关对上述组合限制、禁止行为进行调整的，基金管理人将按照调整后的规定执行。

## （五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：同期人民币一年期定期存款利率+1%

如果今后相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## （六） 风险收益特征

本基金为债券型基金，主要投资于新兴市场的各类债券，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## （七） 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的规定进行融资融券。

（八） 在不违反法律法规规定的情况下，本基金可与基金管理人管理的其他投资组合以公平的市场价格进行相互交易。

## （九） 基金投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月19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2022年3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（人民币元）       | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资    | —              | —            |
|    | 其中：普通股  | —              | —            |
|    | 优先股     | —              | —            |
|    | 存托凭证    | —              | —            |
|    | 房地产信托凭证 | —              | —            |
| 2  | 基金投资    | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资  | 198,397,556.57 | 89.60        |
|    | 其中：债券   | 198,397,556.57 | 89.60        |
|    | 资产支持证券  | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资 | —              | —            |
|    | 其中：远期   | —              | —            |
|    | 期货      | —              | —            |
|    | 期权      | —              | —            |
|    | 权证      | —              | —            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 5 | 买入返售金融资产          | —              | —      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —      |
| 6 | 货币市场工具            | —              | —      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 19,266,089.86  | 8.70   |
| 8 | 其他资产              | 3,767,762.82   | 1.70   |
| 9 | 合计                | 221,431,409.25 | 100.00 |

## 2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

无。

## 3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

## 4. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### (1) 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及存托凭证投资明细

无。

## 5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

| 债券信用等级 | 公允价值（人民币元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| AAA    | 1,219,727.85  | 0.55         |
| AA-    | —             | —            |
| A+     | —             | —            |
| A      | 2,935,368.00  | 1.33         |
| A-     | 22,739,770.22 | 10.32        |
| BBB+   | 3,050,976.92  | 1.38         |
| BBB    | 24,059,460.78 | 10.92        |
| BBB-   | 49,895,823.74 | 22.64        |
| BB+    | 22,010,122.65 | 9.99         |
| BB     | 8,120,918.61  | 3.68         |
| BB-    | 30,245,620.72 | 13.72        |
| B+     | 9,425,589.63  | 4.28         |
| B      | 13,107,876.11 | 5.95         |
| B-     | 1,291,179.83  | 0.59         |
| CCC+   | 4,379,790.71  | 1.99         |
| CCC    | 2,203,889.12  | 1.00         |
| CCC-   | 3,093,821.05  | 1.40         |
| D      | 617,620.63    | 0.28         |

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信

用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

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

| 序号 | 债券代码         | 债券名称                     | 数量           | 公允价值（人民币元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1  | XS2412586450 | SNBAB 2.342<br>01/19/27  | 6,348,200.00 | 6,119,499.75 | 2.78         |
| 2  | XS2389983524 | SFHOLD 3 1/8<br>11/17/31 | 6,348,200.00 | 5,891,840.22 | 2.67         |
| 3  | XS2150023575 | EQPTRC 5 7/8<br>05/18/30 | 5,078,560.00 | 5,754,134.75 | 2.61         |
| 4  | USV4605MAA63 | INCLN 4 1/2<br>04/18/27  | 5,713,380.00 | 5,315,928.72 | 2.41         |
| 5  | USY5257YAJ65 | LENOVO 3.421<br>11/02/30 | 5,078,560.00 | 4,759,672.84 | 2.16         |

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码；2. 数量列示债券面值，以外币计价的债券面值按照期末中国人民银行公布的人民币兑外币汇率中间价折算为人民币。

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

无。

## 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

## 9. 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基金投资明细

无。

## 10. 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### (2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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（人民币元）     |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 119,543.14   |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,505,407.68 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 142,812.00   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 3,767,762.82 |

**(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。

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## 五、基金的业绩

### 转型前

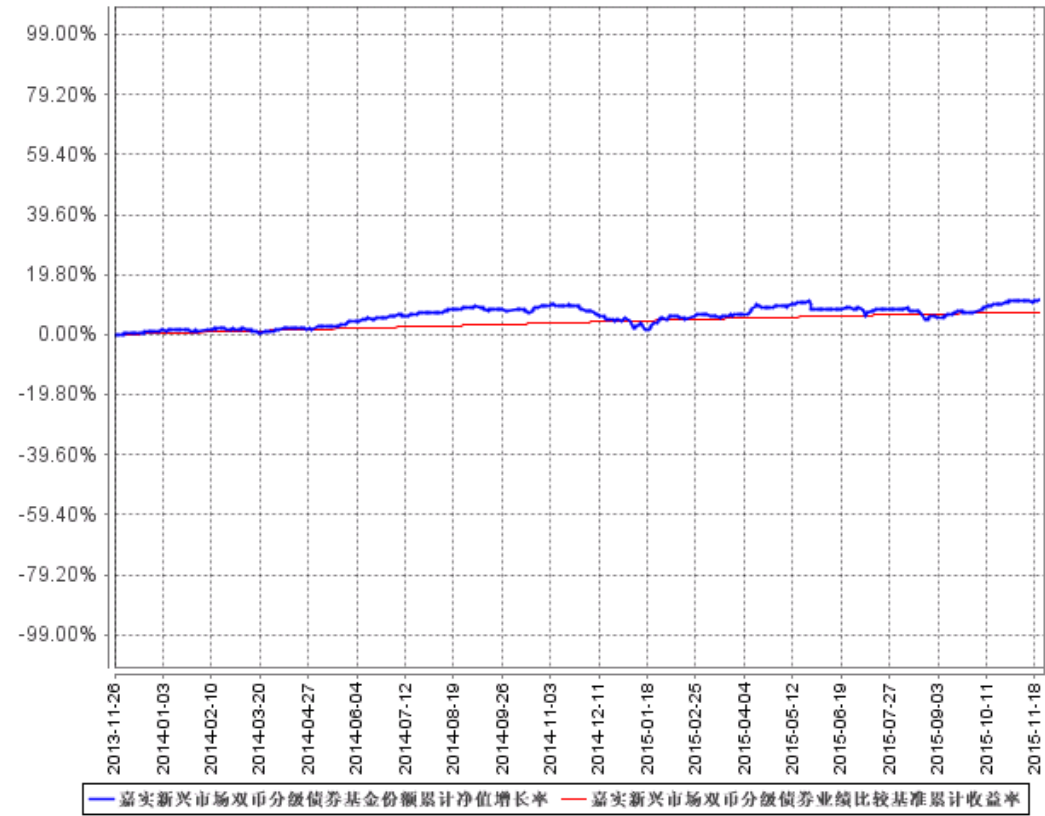
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### （一） 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                                               | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|--------------------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 2013 年 11 月 26 日<br>（合同生效日）至<br>2013 年 12 月 31 日 | 1.03%  | 0.08%     | 0.40%      | 0.01%         | 0.63% | 0.07% |
| 2014 年度                                          | 4.17%  | 0.20%     | 4.05%      | 0.01%         | 0.12% | 0.19% |
| 2015 年 1 月 1 日至<br>11 月 26 日                     | 10.53% | 0.46%     | 2.92%      | 0.01%         | 7.61% | 0.45% |

#### （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

嘉实新兴市场双币分级债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实新兴市场双币分级债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013 年 11 月 26 日至 2015 年 11 月 26 日（分级运作届满日））

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“第十五部分（二）投资范围和（四）投资限制”的有关约定。

转型后

（三） 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

嘉实新兴市场 A1

| 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   |
|-------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 2015 年 11 月 27 日至 | 1.50%  | 0.11%     | 0.25%      | 0.01%         | 1.25% | 0.10% |

|                      |        |       |       |       |         |       |
|----------------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 2015年12月31日          |        |       |       |       |         |       |
| 2016年                | 12.91% | 0.19% | 2.54% | 0.01% | 10.37%  | 0.18% |
| 2017年                | 2.79%  | 0.20% | 2.53% | 0.01% | 0.26%   | 0.19% |
| 2018年                | 1.95%  | 0.26% | 2.53% | 0.01% | -0.58%  | 0.25% |
| 2019年                | 13.66% | 0.19% | 2.53% | 0.01% | 11.13%  | 0.18% |
| 2020年                | -4.25% | 0.60% | 2.51% | 0.01% | -6.76%  | 0.59% |
| 2021年                | -5.81% | 0.31% | 2.50% | 0.01% | -8.31%  | 0.30% |
| 2022年1月1日至2022年3月31日 | -9.91% | 0.43% | 0.61% | 0.01% | -10.52% | 0.42% |

## 嘉实新兴市场 C2

| 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   |
|-------------------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 2015年11月27日至2015年12月31日 | -0.30% | 0.10%     | 0.25%      | 0.01%         | -0.55%  | 0.09% |
| 2016年                   | 5.22%  | 0.15%     | 2.54%      | 0.01%         | 2.68%   | 0.14% |
| 2017年                   | 8.58%  | 0.10%     | 2.53%      | 0.01%         | 6.05%   | 0.09% |
| 2018年                   | -3.42% | 0.13%     | 2.53%      | 0.01%         | -5.95%  | 0.12% |
| 2019年                   | 11.18% | 0.13%     | 2.53%      | 0.01%         | 8.65%   | 0.12% |
| 2020年                   | 1.80%  | 0.59%     | 2.51%      | 0.01%         | -0.71%  | 0.58% |
| 2021年                   | -4.10% | 0.23%     | 2.50%      | 0.01%         | -6.60%  | 0.22% |
| 2022年1月1日至2022年3月31日    | -9.55% | 0.45%     | 0.61%      | 0.01%         | -10.16% | 0.44% |

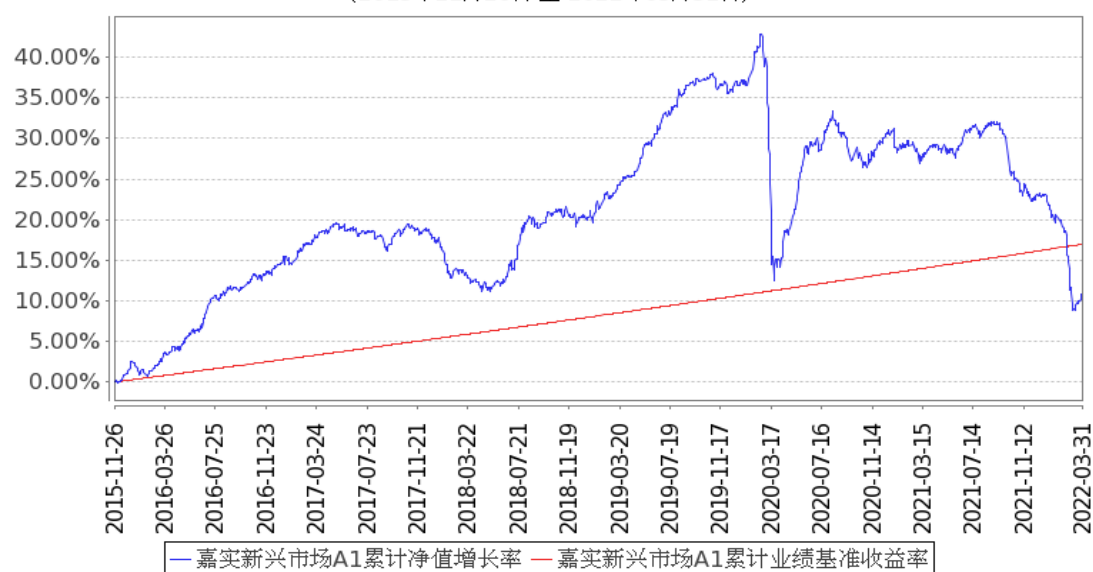
该时间区间历任基金经理

关子宏先生，管理时间为2015年11月26日至2022年12月10日；国歌女士，管理时间为2020年1月3日至2021年1月21日。

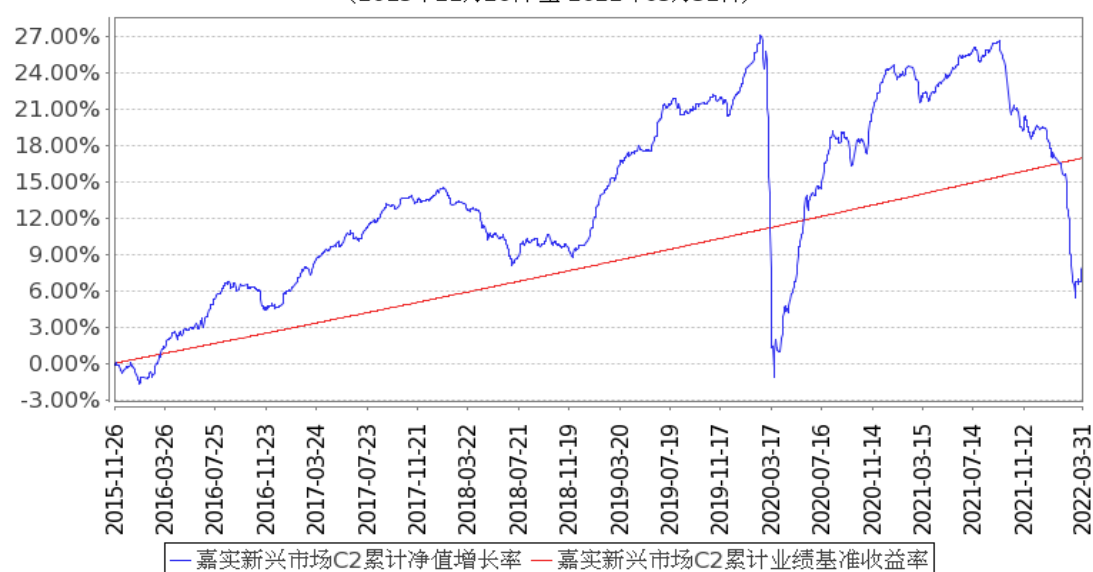
（四）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



**嘉实新兴市场A1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**  
(2015年11月26日至2022年03月31日)



**嘉实新兴市场C2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**  
(2015年11月26日至2022年03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6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 六、基金管理人

### （一）基金管理人基本情况

|       |                                                                    |
|-------|--------------------------------------------------------------------|
| 名称    | 嘉实基金管理有限公司                                                         |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A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和特定资产管理业务等资格。

### （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

赵学军先生，党委书记，董事长，北京大学国民经济学专业毕业，博士。2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，2000年10月至2017年11月任公司党委书记、董事、总经理，2017年11月至今任公司党委书记、董事长。在加入嘉实基金之前，曾任大成基金管理有限公司副总经理，并曾在期货公司、商品交易所、进出口公司担任主要管理职位。

安国勇先生，联席董事长，博士研究生，中共党员。曾任职于招商银行北京分行，中国民航总局金飞民航经济发展中心总经理助理兼证券业务部经理，北京城市铁路股份有限公司总经理，北京市轨道交通建设管理有限公司副总经理，北京市保障性住房建设投资中心副总经理，中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁。现任中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。

尤彦媚女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任职于吉林省产品质量监督检验所，曾任吉林省信托投资有限责任公司总经理助理。2005年5月起任职于中诚信托有限责任公司，现任中诚信托有限责任公司业务总监兼财富管理中心总经理。

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。

Holger Wilhelm Naumann 先生，董事，德国籍。曾任 DWS Investment GmbH 子公司管理、业务发展、业务区域控制欧洲负责人，DWS 资产管理（德国）管委会成员、COO，DWS 资产管理（欧洲）COO，RREEF Management GmbH RREEF 德国负责人，DWS 全球 COO，德意志资产管理全球 COO，DWS 管理委员会成员、亚太区负责人，现任 DWS Investments Hong Kong Limited 董事会主席、亚太区负责人。

韩家乐先生，董事，清华大学经济管理学院工业企业管理专业，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；2004年至今任陕西秦明电子（集团）有限公司董事长；2013年至今任麦克传感器股份有限公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国 Fordham University 经济学博士。并购公会创始会长，金融博物馆理事长。曾长期担任中欧国际工商学院和长江商学院的客座教授。2004年主持创建了全联并购公会；2005年担任经济合作与发展组织（OECD）投资委员会专家委员，2007年起担任上海证券交易所公司治理专家委员会成员；2010年创建了系列金融博物馆，在北京、上海、天津、宁波、苏州、成都、沈阳、郑州和井冈山有十处不同主题的分馆，也参与香港金融博物馆的创建。

汤欣先生，独立董事，法学博士，清华大学法学院教授、博士生导师，清华大学商法研究中心副主任、清华大学全球私募股权研究院副院长，《清华法学》副主编。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，现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员、深圳证券交易所法律咨询委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会主任委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员。

王瑞华先生，独立董事，博士，注册会计师（非执业）。现任中央财经大学粤港澳大湾区研究院执行院长，会计学教授、博士生导师。曾任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任，担任全国工商管理专业学位研究生教育指导委员会委员、中国管理现代化研究会理事、中国上市公司协会独立董事委员会委员。

经雷先生，董事，总经理，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1994年6月至2008年5月任 AIG Global Investment Corp 高级投资分析

师、副总裁；2008年5月至2013年9月任友邦中国区资产管理中心首席投资总监、副总裁。2013年10月加入嘉实基金管理有限公司，2013年10月至2018年3月任公司首席投资官（固收/机构），2018年3月至今任公司总经理。

沈树忠先生，监事长，正高级会计师，管理学硕士。曾任中国糖业酒类集团公司财务部科员、财务部副经理、审计部经理、财务部经理、财务总监、副总经理、常务副总经理（主持工作）、法定代表人；兼任北京华堂商场有限公司董事、中日合资成都伊藤洋华堂商场有限公司副董事长、酒鬼酒股份有限公司董事。现任中诚信托有限责任公司财务总监。

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。

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、基金运营部总监，现任财务部总监。

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006年9月至2010年7月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010年7月至2011年1月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011年1月至2013年11月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管，2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，现任合规管理部稽核组执行总监。

杨竞霜先生，副总经理、首席信息官，博士研究生，美国籍。曾任日本恒星股份有限公司软件工程师，高盛集团核心策略部副总裁，瑞银集团信息技术部董事总经理，瑞信集团信息技术部董事总经理，北京大数据研究院常务副院长。2020年1月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司副总经理、首席信息官。

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、首席风险官及投资总监

张敏女士，首席风险官，博士研究生。曾任德邦证券有限责任公司投资经理助理。2010年3月加入嘉实基金管理有限公司，曾任风险管理部副总监、风险管理部总监。

归凯先生，成长风格投资总监，硕士研究生。曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监。

胡涛先生，平衡风格投资总监，MBA。曾任北京证券投资银行部经理，中金公司股票研究经理，长盛基金研究员，友邦华泰基金基金经理助理，泰达宏利基金专户投资部副总经理、研究部研究主管、基金经理等职务。2014 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任 GARP 策略组投资总监。

洪流先生，平衡风格投资总监，硕士研究生。曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。

张金涛先生，价值风格投资总监，硕士研究生。曾任中金公司研究部能源组组长，润晖投资高级副总裁负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任海外研究组组长、策略组投资总监。

胡永青先生，投资总监（固收+），硕士研究生。曾任天安保险固定收益组合经理，信诚基金投资经理，国泰基金固定收益部总监助理、基金经理。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。

赵国英女士，投资总监（纯债），硕士研究生。曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司。

### 3、基金经理

#### （1）现任基金经理

韩同利先生，硕士研究生，22 年证券从业经历，CFA，具有基金从业资格，中国香港籍。曾任中国银行总行和香港分行交易员、组合投资经理，PIMCO 美国基金经理，交银国际资产管理有限公司固定收益主管，复星集团固定收益首席投资官、保险集团副总裁、复星国际资产管理公司 CEO，深蓝全球资产管理有限公司首席投资官。2021 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司多策略解决方案战队负责人，多策略（Total Return Strategy）CIO。2022 年 6 月 23 日至今任嘉实多利收益债券型证券投资基金基金经理、2022 年 9 月 22 日至今任嘉实稳福混合型证券投资基金基金经理、2022 年 10 月 11 日至今任嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金基金经理、2022 年 12 月 10 日至今任嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金经理。

张琴女士，硕士研究生，15年证券从业经历，具有基金从业资格，中国香港籍。曾任职于摩根大通、苏格兰皇家银行、东方汇理证券（亚洲）股票研究部，覆盖科技、电信、中小盘等行业。2014年6月至2022年7月任瑞士百达资产管理公司绝对收益部资深投资经理。2022年8月加入嘉实基金管理有限公司多策略解决方案战队。2022年12月29日至今任嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金经理。

## （2）历任基金经理

关子宏先生，管理时间为2015年11月26日至2022年12月10日；国歌女士，管理时间为2020年1月3日至2021年1月21日。

## 4、海外投资决策委员会

海外投资决策委员会的成员包括：嘉实国际投资总监关子宏先生，资深基金经理蒋一茜女士、廖嘉恒先生，ETF投资主管宋绍聪先生，风险管理经理余梦潇女士，交易员林柯先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## （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、计算并公告基金净值信息，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）违反规定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，但是法律法规或监管机关另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （6）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；
- （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。

上述禁止行为的设定依据为本基金的基金合同生效时法律法规及监管机关的要求，如果法律法规或监管机关对上述禁止行为进行调整的，基金管理人有权按照调整后的规定执行。

#### 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、合规管理和风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

## 2、内部控制的原则

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

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

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

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

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

## 3、内部控制组织体系

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

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

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及部门总监组成，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）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和 workflow、组织纪律。合规管理部门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控检查工作。

（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）公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门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、业务的合法合规性进行监控核查，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。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

#### 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。

## 七、基金的分级

### （一）基金份额分级

本基金分级运作期内，基金份额划分为嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 两级份额，所募集的基金资产合并运作。

#### 1、基金份额配比

嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的份额配比原则上不超过 6:4（本基金募集设立时，募集资金中以美元募集的嘉实新兴市场 A 的份额应以募集期最后一日的汇率折算为等值的人民币份额以确定募集是否符合基金份额配比要求）。

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A 的开放日开放申购、赎回，嘉实新兴市场 B 封闭运作。在嘉实新兴市场 A 的开放日，本基金以嘉实新兴市场 B 的份额余额为基准，以经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 与嘉实新兴市场 B 之比不超过 6:4 为原则，对嘉实新兴市场 A 的有效申购申请进行确认。在嘉实新兴市场 A 的每个开放日，基金管理人将对嘉实新兴市场 A 进行基金份额折算，嘉实新兴市场 A 的基金份额净值调整为 1.000 美元，基金份额持有人持有的嘉实新兴市场 A 份额数按折算比例相应增减。因此，在嘉实新兴市场 A 的单个开放日，如果嘉实新兴市场 A 未发生赎回或者发生的净赎回份额极小，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 在该开放日后的份额配比可能出现大于 6:4 的情形；如嘉实新兴市场 A 发生的净赎回份额较多，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 在该开放日后的份额配比可能会出现小于 6:4 的情形。份额配比的具体控制措施详见发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

#### 1、嘉实新兴市场 A 的运作

##### （1）约定年收益率

嘉实新兴市场 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其约定年收益率将在本基金的募集期及每个开放日前设定并按照《信息披露办法》有关规定及基金合同的约定进行相关公告。

计算公式为：

嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率=同期美元利率参照银行公布的一年期美元定期存款利率的平均值+浮动利差

嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率为“同期美元利率参照银行公布的一年期美元定期存款利率的平均值+浮动利差”。基金管理人根据市场情况，在基金份额发售之日前及每一个开放日前公告接下来 6 个月的浮动利差的利差值。利差的取值范围从 1%(含)到 2%(含)。

在基金合同生效日，基金管理人将根据届时美元利率参照银行最新公布并执行的一年期美元定期存款利率和在基金份额发售之日前公告的利差值设定并公告嘉实新兴市场 A 份额的首次约定年收益率，该收益率即为嘉实新兴市场 A 基金合同生效后最初 6 个月的年收益率，适用于基金合同生效日（含）到第 1 个开放日（含）的时间段；在嘉实新兴市场 A 份额的每个开放日（最后 1 个开放日除外），基金管理人将根据该日美元利率参照银行最新公布并执行的一年期美元定期存款利率及利差值重新设定并公告嘉实新兴市场 A 的年收益率，该收益率即为嘉实新兴市场 A 接下来 6 个月的年收益率，适用于该开放日（不含）到下个开放日（含）的时间段；在嘉实新兴市场 A 的最后 1 个开放日，基金管理人将根据该日美元利率参照银行最新公布并执行的一年期美元定期存款利率及利差值重新设定并公告嘉实新兴市场 A 的年收益率，该收益率适用于该开放日（不含）到基金合同生效后 2 年期届满日（含）的时间段。

本基金嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率的计算，保留到小数点后 1 位，小数点后第 2 位四舍五入。

嘉实新兴市场 A 份额的基金份额净值以基金合同生效日或开放日嘉实新兴市场 A 折算后的 1.000 美元为基准采用约定年收益率单利进行计算。

根据约定年收益率所计算的嘉实新兴市场 A 份额持有人的可得收益仅为对嘉实新兴市场 A 份额持有人可得收益的估计，并不代表嘉实新兴市场 A 份额持有人的实际可得收益。基金管理人并不承诺或保证嘉实新兴市场 A 份额持有人的该等收益，如在本基金资产出现极端损失情况下，嘉实新兴市场 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定年收益的风险甚至损失本金的风险。

例 1：在本基金基金合同生效日，如果工行、中行、农行和建行公布的一年期美元定期存款利率分别为 0.75%、0.80%、0.80% 和 0.80%，则美元利率参照银行一年期美元定存利率的平均值为 0.8%，假设在基金份额发售之前公告的利差值为 1.7%，则嘉实新兴市场 A 的年收益率为：

$$\text{嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率} = 0.8\% + 1.7\% = 2.5\%$$

## （2）嘉实新兴市场 A 的开放日

嘉实新兴市场 A 的开放日指本基金分级运作期内每满 6 个月之日（但不包括自基金合同生效之日起至 2 年后对应日），如该日为非工作日，则为该日之前的最近一个工作日。如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

### （3）规模限制

本基金分级运作期内，经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 的份额余额原则上不得超过 3/2 倍嘉实新兴市场 B 的份额余额。具体规模限制及其控制措施见基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

### （4）基金份额折算

在嘉实新兴市场 A 开放日，基金管理人将对嘉实新兴市场 A 进行基金份额折算，嘉实新兴市场 A 的基金份额净值调整为 1.000 美元，基金份额持有人持有的嘉实新兴市场 A 份额数按折算比例相应增减。因本基金的估值日为 T+1 日，嘉实新兴市场 A 的基金份额折算以嘉实新兴市场 A 开放日为基准，在嘉实新兴市场 A 开放日的下一个工作日进行。

嘉实新兴市场 A 的基金份额折算基准日为开放日。

嘉实新兴市场 A 的基金份额折算具体见本基金基金合同第七部分以及基金管理人届时发布的相关公告。

## 3、嘉实新兴市场 B 的运作

（1）在自本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。嘉实新兴市场 B 的封闭期为自基金合同生效之日起满 2 年的对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

（2）本基金在扣除嘉实新兴市场 A 的约定收益后的全部剩余收益归嘉实新兴市场 B 享有，如本基金收益不足以支付嘉实新兴市场 A 的约定收益及本金，则以嘉实新兴市场 B 的本金弥补。极端情形下，若嘉实新兴市场 B 的本金不足以支付嘉实新兴市场 A 的本金或约定收益时，嘉实新兴市场 A 的本金亦可能受损。在存在上述亏损的情形下，嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 以其各自的资产净值为限承担亏损。

## 4、基金份额发售

嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 将通过销售机构的销售网点分别进行公开发售。

## 5、基金份额净值计算

本基金基金合同生效后，在嘉实新兴市场 A 的开放日计算嘉实新兴市场 A 的基金份额净值；在分级运作届满日分别计算嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额净值。

（1）自本基金基金合同生效之日起，设  $T_A$  为自嘉实新兴市场 A 份额自基金合同生效日或上一开放日次日至 T 日的运作天数， $NV_T$ （人民币）为 T 日闭市后的基金资产净值， $RS_A$  为 T 日嘉实新兴市场 A 份额的份额余额， $RS_B$  为 T 日嘉实新兴市场 B 份额的份额余额，R 为在嘉实新兴市场 A 份额为基金合同生效日或上一次开放日设定的嘉实新兴市场 A 份额的

约定年收益率，D 为运作当年的实际天数，即指基金合同生效日或嘉实新兴市场 A 份额上一次开放日所在年度的实际天数， $E_T$  为 T 日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）。嘉实新兴市场 A 的基金份额净值计算

1) 若 T 日闭市后，本基金基金资产净值大于或等于“1.000 美元乘以 T 日嘉实新兴市场 A 份额的份额余额加上 T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）之和”并以当日汇率折算为本基金基准货币的金额，则 T 日嘉实新兴市场 A 份额的基金份额净值  $NAV_{AT}$ （美元）计算公式如下：

$$NAV_{AT}(\text{美元}) = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_A}{D} \times R \right)$$

“T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）”计算公式如下：

$$T \text{ 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）} = RS_A \times 1.000 \times \frac{T_A}{D} \times R$$

2) 若 T 日闭市后，本基金基金资产净值小于“1.000 美元乘以 T 日嘉实新兴市场 A 份额余额加上 T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）之和”并以当日汇率折算为本基金基准货币的金额，则：

$$NAV_{AT}(\text{美元}) = \frac{NV_T(\text{人民币})}{RS_A \times E_T}$$

(2) 嘉实新兴市场 B 的基金份额净值计算

嘉实新兴市场 B 份额封闭期届满日(T 日)，嘉实新兴市场 B 份额的基金份额净值  $NAV_{BT}$ （人民币）计算公式如下：

$$NAV_{BT}(\text{人民币}) = \max \left\{ \frac{NV_T(\text{人民币}) - NAV_{AT}(\text{美元}) \times RS_A \times E_T}{RS_B}, 0 \right\}$$

嘉实新兴市场 A 份额、嘉实新兴市场 B 份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T 日的嘉实新兴市场 A 份额和嘉实新兴市场 B 份额的基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

例 2：本基金《基金合同》生效后 6 个月嘉实新兴市场 A 的开放日，设自基金合同生效日期的运作天数为 184 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的份额余额分别为 4 亿份和 15 亿份，嘉实新兴市场 A 基金合同生效日设定的嘉实新兴市场 A 的年收益率为 2.5%，T 日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）为 6.1528。

若基金资产净值为 45 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额净值计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额净值= $1.00 \times (1 + 184/365 \times 2.5\%) = 1.013$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额净值= $(45 - 4 \times 1.013 \times 6.1528) / 15 = 1.338$  元

若基金资产净值为 35 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额净值计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额净值= $1.00 \times (1 + 184/365 \times 2.5\%) = 1.013$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额净值= $(35 - 4 \times 1.013 \times 6.1528) / 15 = 0.671$  元

若基金资产净值为 20 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额净值计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额净值= $20 / (4 \times 6.1528) = 0.813$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额净值=0 元

#### 6、嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值计算

本基金分级运作期内，基金管理人在计算基金资产净值、基金份额净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值，其中，嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值计算日不包括嘉实新兴市场 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

本基金基金合同生效之日起，设  $T_A$  为自嘉实新兴市场 A 份额自基金合同生效日或上一次开放日次日至 T 日的运作天数， $NV_T$ （人民币）为 T 日闭市后的基金资产净值， $RS_A$  为 T 日嘉实新兴市场 A 份额的份额余额， $RS_B$  为 T 日嘉实新兴市场 B 份额的份额余额， $R$  为在嘉实新兴市场 A 份额为基金合同生效日或上一次开放日设定的嘉实新兴市场 A 份额的约定年收益率， $D$  为运作当年的实际天数，即指基金合同生效日或嘉实新兴市场 A 份额上一次开放日所在年度的实际天数， $E_T$  为 T 日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）。

##### （1）嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值计算

1）若 T 日闭市后，本基金基金资产净值大于或等于“1.000 美元乘以 T 日嘉实新兴市场 A 份额的份额余额加上 T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）之和”并以当日汇率折算为本基金基准货币的金额，则 T 日嘉实新兴市场 A 份额的基金份额参考净值  $Ref\_NAV_{AT}$ （美元）计算公式如下：

$$Ref\_NAV_{AT}(\text{美元}) = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_A}{D} \times R \right)$$

“T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）”计算公式如下：

$$T \text{ 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）} = RS_A \times 1.000 \times \frac{T_A}{D} \times R$$

2) 若 T 日闭市后，本基金基金资产净值小于“1.000 美元乘以 T 日嘉实新兴市场 A 份额余额加上 T 日全部嘉实新兴市场 A 份额约定收益（美元）之和”并以当日汇率折算为本基金基准货币的金额，则：

$$Ref\_NAV_{AT}(\text{美元}) = \frac{NV_T(\text{人民币})}{RS_A \times E_T}$$

(2) 嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值计算

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 B 份额的基金份额参考净值  $Ref\_NAV_{BT}$ （人民币）计算公式如下：

$$Ref\_NAV_{BT}(\text{人民币}) = \max \left\{ \frac{NV_T(\text{人民币}) - Ref\_NAV_{AT}(\text{美元}) \times RS_A \times E_T}{RS_B}, 0 \right\}$$

上式中，在嘉实新兴市场 A 非开放日， $Ref\_NAV_{AT}$ （美元）为嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值；在嘉实新兴市场 A 的开放日， $Ref\_NAV_{AT}$ （美元）= $NAV_{AT}$ （美元）为嘉实新兴市场 A 的基金份额净值。

嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

例 3：本基金分级运作期内，设自嘉实新兴市场 A 上一次开放日起的运作天数为 58 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的份额余额分别为 4 亿份和 15 亿份，嘉实新兴市场 A 基金合同生效日设定的嘉实新兴市场 A 的年收益率为 2.8%，T 日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）为 6.1000。

若基金资产净值为 45 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额净值计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值 =  $1.00 \times (1 + 58/365 \times 2.8\%) = 1.004$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值 =  $(45 - 4 \times 1.004 \times 6.1000) / 15 = 1.367$  元

若基金资产净值为 35 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值 =  $1.00 \times (1 + 58/365 \times 2.8\%) = 1.004$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值 =  $(35 - 4 \times 1.004 \times 6.1000) / 15 = 0.700$  元

若基金资产净值为 20 亿元，则嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值



计算如下：

嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值= $20/(4 \times 6.1000)=0.820$  美元

嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值= 0 元

## 二、分级运作届满时的基金份额转换

分级运作届满，基金管理人按照基金合同约定将本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的不同类别份额，并办理基金的申购与赎回业务。本基金基金合同生效后 2 年期届满时基金的运作方式见基金合同第九部分及基金管理人届时发布的相关公告。

# 八、基金的募集

## （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《试行办法》、《通知》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会2013年9月4日《关于核准嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]1154号）核准募集。

## （二）基金运作方式和类型

契约型。

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A 自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次（分级运作届满日除外），嘉实新兴市场 B 封闭运作；本基金基金合同生效后 2 年期届满，基金管理人将终止本基金分级运作方式，转为正常情形下每个交易日开放申购、赎回的债券型证券投资基金，具体方案由基金管理人在分级运作届满日前公告说明。

## （三）基金存续期

不定期。

## （四）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

1、募集期限：2013年10月18日到2013年11月18日

2、募集方式及场所

嘉实新兴市场A和嘉实新兴市场B分别通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售

机构的具体销售城市名单、销售机构联系方式以及发售方案以基金份额发售公告为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》。

投资者可参与嘉实新兴市场A份额或嘉实新兴市场B份额中的某一级份额的认购，也可同时参与嘉实新兴市场A份额或嘉实新兴市场B份额的认购。在基金募集期内，投资人可分别对嘉实新兴市场A份额、嘉实新兴市场B份额进行多次认购，认购申请一经受理不得撤销。

基金发售结束后，基金管理人将以嘉实新兴市场B 最终发售规模为基准，以经汇率折算后的嘉实新兴市场A与嘉实新兴市场B之比不超过6:4为原则，对嘉实新兴市场A的有效认购申请进行确认。其中，每份嘉实新兴市场A份额按照基金募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率折算成嘉实新兴市场B的份额进行比较。

本基金发售规模的具体控制措施见基金份额发售公告。

### 3、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许以人民币、美元购买证券投资基金相应币种份额的其他投资人。

### 4、募集规模上限

本基金将按照中国证监会和外管局核准的境外投资额度（美元额度需折算为人民币）设定基金募集期内的募集规模上限，具体办法参见本基金份额发售公告。

若募集期内认购申请金额全部确认后本基金募集规模小于或达到上述募集规模上限，则所有的认购申请予以确认；否则，本基金管理人将采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制。

同时，基金管理人可根据实际募集情况向外管局申请追加额度，若获得外管局批准的追加额度，则募集期内本基金最终募集规模将以外管局批准的额度（折合相应人民币）为准。

基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

## （四）基金的认购

1、本基金嘉实新兴市场A不收取认购费，嘉实新兴市场B的认购费率按照认购金额递减，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。

认购本基金嘉实新兴市场B份额认购费率见下表：

| 认购金额（含认购费）    | 认购费率          |
|---------------|---------------|
| M<100万元       | 0.60%         |
| 100万元≤M<300万元 | 0.40%         |
| 300万元≤M<500万元 | 0.20%         |
| M≥500万元       | 按笔收取，1,000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

本基金嘉实新兴市场A、嘉实新兴市场B两类基金份额的有效认购款项在募集期间产生的利息将各自折算为相应级别的基金份额归相应级别的基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。

## 3、认购份额的计算

本基金嘉实新兴市场A的初始面值为1.000美元，嘉实新兴市场B的初始面值为1.000元人民币。

### （1）嘉实新兴市场A认购份额的计算

认购份额 = (认购金额 + 认购利息) / 嘉实新兴市场A的初始面值

认购份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。

例4：某投资人投资1万美元认购本基金份额，假设其认购资金的利息为10美元，则其可得到的认购份额为：

认购份额 = (10,000 + 10) / 1.000 = 10,010.00份

即投资者投资10,000美元认购本基金嘉实新兴市场A份额，可得到嘉实新兴市场A基金份额10,010.00份基金份额。

### （2）嘉实新兴市场B认购份额的计算

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 嘉实新兴市场B的初始面值。

认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表

的资产计入基金资产。

例 5：某投资人投资 10 万元认购本基金嘉实新兴市场 B 份额，假设其认购资金的利息为 100 元，则其可得到的认购份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 0.6\%) = 99,403.57 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,403.57 = 596.43 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (99,403.57 + 100) / 1.000 = 99,503.57 \text{ 份}$$

即投资者投资 100,000 元认购本基金嘉实新兴市场 B 份额，可得到嘉实新兴市场 B 基金份额 99,503.57 份基金份额。

#### 4、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 九、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2013 年 11 月 26 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

### （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（美元份额所对应的基金资产净值需按计算日汇率折算为人民币）低于 5000 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。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 十、基金份额折算

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A 将按以下规则进行基金份额折算。

### （一）折算基准日

嘉实新兴市场 A 的基金份额折算基准日为嘉实新兴市场 A 开放日。基金份额折算的具体计算见基金合同第四部分“基金份额的分级”中“嘉实新兴市场 A 的运作”的相关内容。

### （二）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的嘉实新兴市场 A 所有份额。

### （三）折算方式

折算基准日日终，嘉实新兴市场 A 的基金份额净值调整为 1.000 美元，折算后，基金份额持有人持有的嘉实新兴市场 A 的份额数按照折算比例相应增减。因本基金的估值日为 T+1 日，嘉实新兴市场 A 的基金份额折算以嘉实新兴市场 A 开放日为基准，在嘉实新兴市场 A 开放日的下一个工作日进行。

嘉实新兴市场 A 的基金份额折算公式如下：

$$\text{嘉实新兴市场 A 的折算比例} = \frac{\text{折算基准日折算前嘉实新兴市场 A 的基金份额净值}}{1.000}$$
$$\text{嘉实新兴市场 A 经折算后的份额数} = \text{折算前嘉实新兴市场 A 的份额数} \times \text{嘉实新兴市场 A 的折算比例}$$

嘉实新兴市场 A 份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，计算结果中，不足 0.01 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 0.01 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕，计算的结果以登记机构的记录为准。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前嘉实新兴市场 A 的基金份额净值、嘉实新兴市场 A 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### （四）基金份额折算的公告

- 1、基金份额折算方案须最迟于实施日前 2 日在指定媒介公告，并报中国证监会备案。
- 2、基金份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

## 十一、基金份额的申购、赎回

### （一）申购、赎回的场所

本基金分级运作期内，投资者可在嘉实新兴市场 A 份额的开放日对嘉实新兴市场 A 份额以美元计价并进行申购、赎回，嘉实新兴市场 B 份额以人民币计价，在分级运作期内封闭运作，不开放申购或赎回。在本基金分级运作期届满时，本基金依据基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的不同类别份额，并办理基金的申购与赎回业务。

### （二）嘉实新兴市场 A 份额的申购与赎回

#### 1、开放日及开放时间

投资人在嘉实新兴市场 A 的开放日办理嘉实新兴市场 A 份额的申购和赎回，具体办理时间为开放日上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日的交易时间，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、申购与赎回的开始时间

在确定嘉实新兴市场 A 申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。嘉实新兴市场 A 的开放日以及开放日办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时公布的相关公告。

如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放日为不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。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、赎回或者转换。投资人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，详见相关公告的有关规定。

#### 3、申购与赎回的原则

（1）“确定价”原则，即嘉实新兴市场 A 份额的申购、赎回价格以 1.000 美元为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）“分币种申赎”原则，即以美元申购获得美元份额，赎回美元份额获得美元赎回款；

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

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 4、申购与赎回的程序

##### （1）申购和赎回的申请方式

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

##### （2）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项。若在规定时间内申购款项未全额到账的，则提交的申购申请无效。

投资人赎回基金份额时，必须持有足够的可用基金份额余额，否则提交的赎回申请无效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。外管局相关规定发生变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则发生变更时，赎回款项支付日期将相应调整。

##### （3）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+3 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不成功或无效，则申购款项本金将退还给投资人。

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并按照有关规定公告。

在嘉实新兴市场 A 的开放日，本基金以嘉实新兴市场 B 的份额余额为基准，以经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 与嘉实新兴市场 B 之比不超过 6:4 为原则，对嘉实新兴市场 A 的有效申购申请进行确认。

在嘉实新兴市场 A 的开放日，对所有经确认有效的嘉实新兴市场 A 的赎回申请全部予以成交确认。在发生巨额赎回的情形时，按照本部分“10、巨额赎回的情形及处理方式”对巨额赎回的有关规定执行。

对于嘉实新兴市场 A 的申购申请，如果对嘉实新兴市场 A 的全部有效申购申请进行确认后，经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 的份额余额小于或等于  $\frac{3}{2}$  倍嘉实新兴市场 B 的份



额余额，则对所有经确认有效的嘉实新兴市场 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对嘉实新兴市场 A 的全部有效申购申请进行确认后，经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 的份额余额大于 3/2 倍嘉实新兴市场 B 的份额余额，则在确认后并经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 份额余额不超过 3/2 倍嘉实新兴市场 B 的份额余额范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。其中，每份嘉实新兴市场 A 份额按照 T 日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率折算成嘉实新兴市场 B 的份额进行比较。嘉实新兴市场 A 每个开放日的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

基金销售机构对嘉实新兴市场 A 申购和赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到嘉实新兴市场 A 申购和赎回申请。嘉实新兴市场 A 申购和赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。

#### 5、申购和赎回的数量限制

投资者通过代销机构首次申购嘉实新兴市场 A 份额的单笔最低限额为 100 美元，追加申购单笔最低限额为 100 美元；投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为 2,000 美元，追加申购单笔最低限额为 100 美元。投资者可多次申购，对单一投资者的累计申购份额不设上限。

基金份额持有人可将其全部或部分嘉实新兴市场 A 份额赎回，单笔赎回不得少于 1000 份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 1,000 份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足 1,000 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### 6、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）嘉实新兴市场 A 基金份额的申购、赎回价格为 1.000 美元。

（2）申购份额的计算及余额的处理方式：嘉实新兴市场 A 不收取申购费用。申购的有效份额为实际确认的申购金额除以 1.000 美元确定。

申购份额 = 申购金额 / 申购当日嘉实新兴市场 A 基金份额净值

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

例 6：某投资人投资 10 万美元申购本基金份额，申购当日嘉实新兴市场 A 折算后的基金份额净值为 1.000 美元，则其可得到的申购份额为：

申购份额 =  $100,000 / 1.000 = 100,000.00$  份

即投资者投资 10 万美元申购本基金嘉实新兴市场 A 份额，可得到嘉实新兴市场 A 基金份额 100,000.00 份基金份额。

（3）赎回金额的计算及处理方式：嘉实新兴市场 A 不收取赎回费用。赎回金额为赎回的有效份额乘以 1.000 美元确定。

赎回总金额=赎回份额 X 赎回当日嘉实新兴市场 A 基金份额净值

净赎回金额=赎回总金额

例 7：某投资人赎回本基金嘉实新兴市场 A 50,000 份基金份额，赎回当日嘉实新兴市场 A 折算后的基金份额净值为 1.000 美元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=50,000 X 1.000 =50,000.00 美元

即投资者赎回 5 万份所持有的本基金嘉实新兴市场 A 份额，可得到的净赎回金额为 50,000.00 美元。

#### 7、申购与赎回的注册登记

（1）经基金销售机构同意，投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

（2）投资人申购嘉实新兴市场 A 份额成功后，登记机构在 T+2 日为投资人增加权益并办理注册登记手续。

（3）投资人赎回嘉实新兴市场 A 份额成功后，登记机构在 T+2 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

（4）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，并应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 8、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

（3）证券交易所交易时间非正常停市或外汇市场休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（4）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。

（5）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利益的情形。

（6）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害基金份额持有人利益时。

（7）基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

（8）基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）。

(9) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)-(3)、(5)-(9)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 9、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(3) 证券交易所交易时间非正常停市或外汇市场休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 嘉实新兴市场 A 在开放日发生巨额赎回。

(5) 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

(6) 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暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量所代表的基金资产净值占申请总量所代表的基金资产净值的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在计算单个赎回申请人的赎回申请量所代表的基金资产净值和赎回申请总量所代表的基金资产净值时，美元份额所代表的部分依据当日适用的汇率折算为人民币。若出现上述第(4)项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 10、巨额赎回的情形及处理方式

##### (1) 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的嘉实新兴市场 A 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)超过前一日的嘉实新兴市场 A 份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### (2) 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额支付赎回款或延期支付赎回款。

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

2) 延期支付赎回款：当基金管理人认为全额支付投资人的赎回款有困难或认为因支付投资人的赎回款而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对已经接受的有效赎回申请延缓支付赎回款项，但最长不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

### 3) 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 11、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

(2) 上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定于重新开放日前在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

### (三) 分级运作届满日后本基金的申购与赎回

分级运作届满日后，本基金更名为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，相关申购、赎回按照以下约定办理。

#### 1、开放日及开放时间

本基金的申购、赎回自转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金之日起不超过 30 日内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日为本基金的开放日，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外。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。

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、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2015 年 12 月 2 日开始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、深圳证券交易所以及境外主要投资市场同时开放交易的工作日的交易时间，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体上公告。

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与赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或赎回申请且登记机构确认接受的，视为下一开放日的申购或赎回申请。

### 3、申购与赎回的原则

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

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）“分币种申购”原则，即以人民币申购获得人民币计价的份额，以美元申购获得美元计价的份额，依此类推；

（5）一般情况下，本基金赎回遵循“分币种赎回”原则，即赎回人民币计价的份额获得人民币赎回款，赎回美元计价的份额获得美元赎回款；但在今后外管局和中国证监会允许的情况下，无须召开基金份额持有人大会，本基金可开通并采用“交叉币种赎回”原则，即赎回人民币或美元计价的份额，均可获得经许可的其他币种的赎回款，具体详见届时基金管理人发布的相关公告；

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

（7）本基金份额分为多个类别，适用不同的申购费率或销售服务费率，各类别份额可采用多币种销售。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 4、申购与赎回的程序

#### （1）申购和赎回的申请方式

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

#### （2）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，若在规定时间内申购款项未全额到账的，则提交的申购申请无效。

投资人赎回基金份额时，必须持有足够的可用基金份额余额，否则提交的赎回申请无效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日

划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。外管局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更时，赎回款项支付日期将相应调整。

### （3）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+2日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+3日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

### 5、申购和赎回的数量限制

对于人民币份额的申购，投资者通过代销机构首次申购单笔最低限额为人民币1元，通过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，投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元，但已持有本基金份额的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币1元；投资者通过代销机构或直销中心柜台追加申购单笔最低限额为人民币1元，通过嘉实基金管理有限公司网上直销追加申购单笔最低限额为人民币1元。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。投资者可多次申购，对单一投资者的累计申购份额不设上限，但法律法规、监管规则另有规定或基金合同另有约定的除外。

对于美元份额的申购，投资者通过代销机构首次申购单笔最低限额为1美元，追加申购单笔最低限额为1美元；投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为2,000美元，追加申购单笔最低限额为1美元。投资者可多次申购，对单一投资者的累计申购份额不设上限，但法律法规、监管规则另有规定或基金合同另有约定的除外。

对于已持有某一份额类别，首次申购另一份额类别的投资者，其申购适用于另一份额类别申购的首次单笔最低限额。

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。

投资者通过代销机构及嘉实基金管理有限公司直销中心柜台对任一份额类别的赎回，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，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。

投资者通过销售机构赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；单笔赎回不得少于1份，每个基金交易账户最低持有基金份额余额为1份，若某笔赎回导致某一销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于1份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。投资者通过代销机构赎回本基金的具体单笔赎回最低份额以各销售机构规定为准。

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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### 6、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。T日的基金份额净值在T+1内计算，并在T+2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。

（2）本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后的A1类基金份额在投资者申购时收取前端申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费；C2类基金份额不收取前后端申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费，对于持有期限不少于30日的本类别基金份额的赎回不收取赎回费，但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。本基金申购费用由投资人承担，不列入基金财产；本基金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，基金的赎回费用应全额计入基金财产。

本基金A1类基金份额申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

| A1类基金份额申购金额（含申购费）                        | A1类基金份额申购费率  |
|------------------------------------------|--------------|
| $M < 100$ 万元                             | 0.80%        |
| $100 \text{ 万元} \leq M < 300 \text{ 万元}$ | 0.50%        |
| $300 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$ | 0.30%        |
| $M \geq 500$ 万元                          | 按笔收取，1000元/笔 |

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，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的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

2020年4月2日，本基金管理人发布了《关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告》，自2020年4月3日起，对通过本公司直销中心（包括直销中心柜台及网上直销）申购本基金的养老金客户实施特定申购费率：通过公司直销中心申购本基金的，适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的10%；申购费率为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。其中，养老金客户包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、基本养老保险基金、符合人社部规定的养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

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

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2015年12月2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，本基金优惠后的费率见下表：

| 持有期限 (T) | 基金网上直销<br>后端申购优惠费率 |
|----------|--------------------|
| 0<T<1年   | 0.10%              |
| 1年≤T<3年  | 0.05%              |
| 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。

本基金对 A1、C2 类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。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对 A1 类基金份额，持续持有期少于 7 日的投资者将收取 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，除此之外的赎回费也一并全额计入基金财产。对于持有期限少于 30 日的 C2 类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。



本基金 A1 类基金份额的赎回费率具体如下：

| 持有期限（H）                        | 赎回费率  |
|--------------------------------|-------|
| $H < 7$ 天                      | 1.50% |
| $7 \text{ 天} \leq H < 365$ 天   | 0.10% |
| $365 \text{ 天} \leq H < 730$ 天 | 0.05% |
| $H \geq 730$ 天                 | 0     |

本基金 C2 类基金份额的赎回费率具体如下：

| 持有期限（H）                     | 赎回费率  |
|-----------------------------|-------|
| $H < 7$ 天                   | 1.50% |
| $7 \text{ 天} \leq H < 30$ 天 | 0.75% |
| $H \geq 30$ 天               | 0     |

（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，针对以特定交易方式（如网上交易等）等进行基金交易的投资人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必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。

## 7、申购份额、赎回金额的计算方式

### （1）申购份额的计算

1）当投资者选择申购A1类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

□申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A1类基金份额净值}$$

□申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A1类基金份额净值}$$

例8：某投资者投资5万元申购本基金A1类基金份额，假设申购当日基金份额净值为

1.05元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.8\%) = 49,603.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,603.17 = 396.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,603.17 / 1.05 = 47,241.11 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金 A1 类基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 47,241.11 份 A1 类基金份额。

2) 当投资者选择申购C2类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T日C2类基金份额净值}$$

3) 基金份额的计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产。

## (2) 基金赎回金额的计算

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

1) 当投资者赎回A1类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日A1类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

2) 当投资者赎回C2类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日C2类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

3) 赎回金额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财产。

例9：假定三笔赎回申请的赎回A1类基金份额均为10,000 份，但持有时间长短不同，其中基金份额净值为假设数，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

|             | 赎回1       | 赎回2         | 赎回3    |
|-------------|-----------|-------------|--------|
| 赎回份额（份，a）   | 10,000    | 10,000      | 10,000 |
| 基金份额净值（元，b） | 1.100     | 1.200       | 1.300  |
| 持有时间H       | 7天≤H<365天 | 365天≤H<730天 | H≥730天 |

|                          |           |           |           |
|--------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 适用赎回费率（c）                | 0.1%      | 0.05%     | 0         |
| 赎回总额（元， $d=a \times b$ ） | 11,000    | 12,000    | 13,000    |
| 赎回费（ $e=c \times d$ ）    | 11        | 6         | 0         |
| 赎回金额（ $f=d-e$ ）          | 10,989.00 | 11,994.00 | 13,000.00 |

#### （1） 基金份额净值计算

本基金基金份额净值的计算方式见基金合同第九部分“基金份额基金转型分级运作终止后的基金份额转换”

### 8、申购与赎回的注册登记

（1）经基金销售机构同意，投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

（2）投资人申购本基金基金份额成功后，登记机构在 T+2 日为投资人增加权益并办理注册登记手续。

（3）投资人赎回本基金基金份额成功后，登记机构在 T+2 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

（4）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，并应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 9、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运转。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

（3）证券交易所交易时间非正常停市或外汇市场休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（4）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。

（5）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利益的情形。

（6）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害基金份额持有人利益时。

（7）基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

（8）基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）。

(9) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

(10) 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。

(11) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)–(3)、(5)–(8)、(10)–(11)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 10、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(3) 证券交易所交易时间非正常停市或外汇市场休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(5) 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

(6) 经外管局和中国证监会允许后，本基金采用“交叉币种赎回”原则时，发生外汇管制或换汇问题，导致无法支付指定币种的赎回款项。

(7) 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。

(8) 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暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量所代表的基金资产净值占申请总量所代表的基金资产净值的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在计算单个赎回申请人的赎回申请量所代表的基金资产净值和赎回申请总量所代表的基金资产净值时，美元份额所代表部分依据当日适用的汇率折算为人民币。若出现上述第(4)项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 11、巨额赎回的情形及处理方式

### （1）巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内本基金某类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）超过上一开放日该类基金份额总数的 10%，即认为该类基金份额发生了巨额赎回。

### （2）巨额赎回的处理方式

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

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

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

若某类基金份额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该类基金份额赎回比例不低于上一开放日该类基金总份额 10%的前提下，如出现该类基金份额的单个基金份额持有人超过前一开放日该类基金总份额 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该类基金份额的其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日该类基金份额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) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### （3）巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 12、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

（1）发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

（2）如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日前在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

（3）如果发生暂停的时间超过一日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 2 日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（4）如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定，不适用于基金合同约定的开放期与封闭期间基金运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。

### （四）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

此处所指“基金转换”不包括本基金转为“嘉实新兴市场债券型证券投资基金”的情形。

### （五）基金的非交易过户

基金的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。基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规

的其它非交易过户(参见临时公告)。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### （六）基金的转托管

基金份额持有人可向其销售机构申请办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。尽管有前述约定,基金销售机构仍有权决定是否办理基金份额的转托管业务。

#### （七）定期定额投资计划

本基金是否开通定期定额投资计划及具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （八）基金的冻结、解冻与其他业务

基金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,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 十二、基金份额分级运作终止后的基金份额转换

### （一）基金份额分级运作终止后的基金运作方式

本基金分级运作届满日，本基金嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 分级运作终止，本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，本基金的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的不同类别份额，在正常情形下，每个交易日办理嘉实新兴市场债券型证券投资基金的申购与赎回业务。

### （二）基金份额分级运作终止后嘉实新兴市场 A 的处理方式

本基金分级运作届满日前，基金管理人将提前公告本基金基金份额分级运作终止后嘉实新兴市场 A 的处理方式。嘉实新兴市场 A 的基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式做出选择赎回嘉实新兴市场 A 份额，赎回价格以“未知价”原则，即赎回价格以 T+1 日计算的 T 日的基金份额净值为基准进行计算。如果基金份额持有人不做出选择的，其持有的嘉实新兴市场 A 份额将被默认为转入“嘉实新兴市场债券型证券投资基金”的 C2 类份额。

### （三）基金份额分级运作终止时的份额转换

#### 1、基金份额转换规则

对投资者持有到期的每一份嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B，在本基金分级运作届满日，按照基金合同约定的资产及收益的计算规则计算嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的不同类别份额。无论基金份额持有人单独持有或同时持有嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B，均无需支付转换基金份额的费用。其中，本基金嘉实新兴市场 A 将转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额，嘉实新兴市场 B 份额将转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额。

嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的份额转换基准日为自基金合同生效之日后 2 年的对应日。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。转换基准日的具体确定日期，届时见基金管理人公告。

#### 2、份额转换方式

在份额转换基准日，嘉实新兴市场债券型证券投资基金的各类份额的基金份额净值均调整为 1.000 元或 1.000 美元。

在份额转换基准日的下一个工作日，以份额转换后 1.000 美元的基金份额净值为基准，基金管理人将根据嘉实新兴市场 A 转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换；在份额转换基准日的下一个工作日，以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，基金管理人将根据嘉实新兴市场 B 转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换。

#### 3、份额转换计算公式：



嘉实新兴市场 A 份额的转换比率 = 份额转换基准日嘉实新兴市场 A 的基金份额净值 / 1.000

嘉实新兴市场 B 份额的转换比率 = 份额转换基准日嘉实新兴市场 B 的基金份额净值 / 1.000

嘉实新兴市场 A 份额、嘉实新兴市场 B 份额转换比率的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

嘉实新兴市场 A 基金份额持有人持有的转换后嘉实新兴市场债券型证券投资基金 C2 类基金份额 = 基金份额持有人持有的转换前嘉实新兴市场 A 份额数 × 嘉实新兴市场 A 份额的转换比率

嘉实新兴市场 B 基金份额持有人持有的转换后嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类基金份额 = 基金份额持有人持有的转换前嘉实新兴市场 B 份额数 × 嘉实新兴市场 B 份额的转换比率

嘉实新兴市场 A 基金份额持有人持有的转换后嘉实新兴市场债券型证券投资基金 C2 类基金份额数和嘉实新兴市场 B 基金份额持有人持有的转换后嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类基金份额数保留到小数点后两位，计算结果中，不足 0.01 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 0.01 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕，计算的结果以登记机构的记录为准。

在实施基金份额转换时，嘉实新兴市场 A 份额（或嘉实新兴市场 B 份额）的转换比率、嘉实新兴市场 A（或嘉实新兴市场 B）基金份额持有人持有的转换后嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （四）份额转换的公告

1、本基金分级运作届满日，本基金将转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案；

2、在本基金分级运作届满日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告；

3、嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 个工作日内在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

#### （五）基金份额分级运作终止后基金的投资管理

本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变，仍按照基金合同第十五部分的规定执行。

#### （六）转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，T 日基金份额净值计算

T 日 A1 类基金份额的基金份额净值 = T 日闭市后的 A1 类基金份额的基金资产净值 / T 日 A1 类基金份额的余额数量

$T$  日 C2 类基金份额的基金份额净值= $T$  日闭市后的 C2 类基金份额的基金资产净值/ $T$  日 C2 类基金份额的余额数量

本基金 A1 类和 C2 类基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$  日的 A1 类和 C2 类基金份额净值在  $T+1$  日内计算，并在  $T+2$  日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 十三、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（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和税务顾问费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），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；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、销售服务费；
- 9、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 10、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）；
- 11、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；
- 12、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 13、与基金有关的诉讼、追索费用；但由基金管理人或托管人自身原因造成的此类费用由基金管理人或托管人自行承担；
- 14、因基金运作需要或基金份额持有人决定更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新基金托管人所引起的费用；
- 15、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。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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首日起 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、公休日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金的销售服务费

基金的销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

### （1）本基金分级运作期内的销售服务费

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A 基金份额收取销售服务费，年费率为 0.5%，嘉实新兴市场 B 基金份额不收取销售服务费。

计算方法如下：

$$H = E \times FX \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为嘉实新兴市场 A 基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日嘉实新兴市场 A 的基金份额参考净值与嘉实新兴市场 A 的基金份额数的乘积

FX 为前一日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）。

基金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基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（2）本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，其中 A1 类基金份额不收取销售服务费，C2 类基金份额收取销售服务费，年费率为 0.5%。

计算方法如下：

$$H = E \times FX \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类基金份额前一日基金资产净值

FX 为前一日美元兑换人民币的汇率（CNY/USD）。

基金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，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用”的种类中除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用，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。

### （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）基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金费率、基金托管费率、基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过，除非《基金合同》、相关法律法规或监管机构另有规定。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家或投资市场所在国家或地区的税收法律、法规执行。除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致基金在税收方面的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

## 十四、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有价证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立人民币和外币资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金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）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人和境外托管人保管。基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金登记机构和基金销售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。除依法律法规和《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、境外托管人因依法解散、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。

在符合基金合同和《托管协议》有关资产保管的要求下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。基金托管人在已根据《试行办法》的要求谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规、本合同及托管协议的要求保管托管资产的前提下，基金托管人对境外托管人破产产生的损失不承担责任。

## 十五、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金的开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日，T+1日完成T日估值。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、基金、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、股票估值方法

（1）交易所上市的股票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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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）未上市股票的估值。

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估值方法估值；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，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估值方法估值；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。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### （4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、固定收益证券估值方法

（1）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，按最近交易日的收盘价估值。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。

（2）对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值；对于首次发行未上市的债券按成本价估值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、衍生工具估值方法

（1）上市流通衍生工具按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市衍生工具按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

### 4、基金估值方法

（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

### 5、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通或流通受限或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、在两个或者两个以上的交易场所交易的同一证券，一般采用该证券主要交易市场的收盘价或报价；根据不同交易市场的发行量之比确定该证券的主要交易市场。个别市场有特殊交易结算规则的，根据该市场规则处理。

### 7、汇率

本基金外币资产价值计算中，所涉及人民币对美元、港币、英镑、欧元、日元的汇率应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

### 8、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

9、为股票、固定收益证券、外汇等基金资产估值需要，经过基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可以利用及依据基金管理人届时确定的一种或多种来源的数据信息。

10、在任何情况下，基金管理人如采用上述方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。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。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1、本基金分级运作期内，在嘉实新兴市场 A 的开放日计算嘉实新兴市场 A 的基金份额净值；在嘉实新兴市场 B 的封闭期届满日分别计算嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额净值。

本基金分级运作期内，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，按照基金合同的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。嘉实新兴市场 A 与嘉实新兴市场 B 基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类与 C2 类单独进行基金份额净值计算。每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金份额净值及基金份额参考净值由基金管理人完成估值后，将估值结果发送给基金托管人，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，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。



3、在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任，同时，须按照有关规定在基金定期报告中进行披露。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当某一级别（类别）基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的行为造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

##### 2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”），则估值错误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估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

##### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差小于某一级别（类别）基金份额净值的0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；错误偏差达到或超过某一级别（类别）基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 5、特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

（3）全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在基金管理人和基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

（4）对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

#### （六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易场所或市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、出现会导致基金管理人不能出售或无法评估基金资产的紧急情况；；

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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于 T+1 日计算 T 日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按照基金合同的约定对基金净值予以公布。

## 十六、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、汇兑损益、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）基金收益分配原则

1、本基金分级运作期内，本基金的收益分配原则如下：

（1）本基金分级运作期内，本基金不进行收益分配；

（2）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、分级运作届满日后，本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后的收益分配原则如下：

（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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对 A1 类 C2 类基金份额分别选择现金红利或将现金红利自动转为该类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；

（3）本基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。人民币份额的现金分红分配币种为人民币，美元等外币份额现金分红币种为其相应币种；不同币种份额红利再投资适用的净值为该币种份额的净值；

（4）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的人民币基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值；对于美元等外币份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元等外币份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；

（5）由于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类基金份额不收取销售服务费，而 C2 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（6）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截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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止日）的时间不得超过 15 个工作日。

#### （六）基金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，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十七、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托管协议约定方式确认。

### （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、境外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、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。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十八、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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （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，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”）及指定媒介指定媒介互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，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。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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

（1）《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事项的法律文件。

（2）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。

（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

基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体和网站上；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网站上。

## 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

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金净值信息

（1）《基金合同》生效后，在嘉实新兴市场A份额首次开放日前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值和基金份额累计净值。如本基金投资衍生品，应当在每个工作日计算并披露嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值和基金份额累计净值。

（2）在嘉实新兴市场A份额首次开放后，基金管理人T+2日内，通过指定网站、销售机构网点或者营业网点，披露嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值和基金份额累计净值；

（3）基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的T+2日内，将嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒介上。

（4）基金托管人对嘉实新兴市场A份额和嘉实新兴市场B份额的基金份额净值或基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值及相关披露内容进行复核；



（5）在本基金分级运作期届满并转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后：

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嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类份额和嘉实新兴市场债券型证券投资基金 C2 类份额的基金份额净值和基金份额累计净值。如本基金投资衍生品，应当在每个工作日计算并披露基金份额净值以及嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类份额和 C2 类份额的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后的 2 个工作日，通过基金管理人指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类份额和 C2 类份额的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后的 2 个工作日，在指定网站披露半年度和年度最后一日嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类份额和 C2 类份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

自基金合同生效之日起满 2 年后，基金管理人将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，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十五个工作日内，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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人在会计年度结束后 60 个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

#### 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下列事件：

- （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、基金托管人或境外资产托管人、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、境外资产托管人的法定名称、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）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- （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）基金份额净值计价错误达基金某一类（或某一级别）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）嘉实新兴市场 A 份额收益率设定及其调整；
- （23）基金管理人将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金、相应的基金转换及本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后开始办理申购、赎回；
- （24）基金增减外币基金份额类别或销售币种；
- （25）本基金开通并采用“交叉币种赎回”原则；
- （26）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；
- （27）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它事项。

#### 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### 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、本基金合同所述信息披露事项、披露时间、内容及要求，如法律法规或监管机构发布新的规定的，本基金信息披露事宜即按照新的规定执行，无需基金份额持有人大会审议批准。

#### 12、中国证监会规定的其它信息。

##### （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净值信息、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15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）暂停或延迟信息披露的情形

- 1、基金投资所涉及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、出现会导致基金管理人不能出售或无法评估基金资产的紧急情况；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

#### （九）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。

## 十九、基金合并、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

### （一）基金合并

#### 1、基金合并概述

本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后的存续期间，如发生下列情形之一的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以决定本基金与基金管理人管理的其他基金合并：

- （1）连续3个月平均基金份额持有人数量不满100人的；
- （2）连续3个月平均基金资产净值低于5000万元的；

基金合并的方式包括但不限于本基金吸收合并其他基金、本基金被其他基金吸收合并、本基金与其他基金合并为新的基金等方式。本基金吸收合并其他基金时，其他基金终止，本基金存续；本基金被其他基金吸收合并时，其他基金存续，本基金终止；本基金与其他基金合并为新的基金时，本基金与其他基金均终止。

#### 2、基金合并的实施方案

##### （1）基金合并公告

1）基金管理人应就本基金合并事宜，依照相关法律法规的规定进行公告，向投资人披露合并后基金的法律文件，明确实施安排，说明对现有持有人的影响，并报中国证监会备案或更新基金申请材料。

2）基金管理人应在合并实施前至少提前二十个工作日就基金合并相关事宜进行提示性公告。

3）为了保障现有基金份额持有人的利益，基金管理人可在合并实施前的合理时间内暂停本基金的日常申购或转换转入业务。

##### （2）基金合并业务的规则

1）基金管理人应在有关基金合并的公告中，说明对现有基金份额的处理方式及基金合并操作的具体起止时间，并提示现有基金份额持有人在基金合并前的指定期限内（该期限不少于二十个工作日，具体期限在公告中列明，以下简称指定期限）可行使选择权。

2）基金份额持有人在指定期限内可行使的选择权包括：

- a. 赎回其持有的本基金份额；
- b. 将其持有的本基金份额转换为基金管理人管理的、可接受转换转入的其他基金份额；
- c. 继续持有合并后的基金份额；
- d. 基金管理人届时公告的其他选择权。

3）基金份额持有人可就其持有的本基金全部或部分基金份额选择行使上述任一项选择权。

4) 除以下 5) 所述情形外, 基金份额持有人在指定期限内因行使选择权而赎回或转换转出本基金份额的, 基金管理人免除基金份额持有人赎回或转换时应支付的赎回费或转换费(包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差, 下同)等交易费用。

5) 在指定期限内, 本基金可以开放申购及/或转换转入业务, 但对该等申购及/或转换转入的份额, 如其在指定期限内再赎回或转换转出的, 基金管理人有权不予免除相应的赎回费或转换费等交易费用。

6) 指定期限届满, 基金份额持有人没有作出选择的, 视为基金份额持有人选择继续持有基金合并后的基金份额。

3、基金合并导致本基金终止并清算时, 由此产生的清算费用由本基金财产承担。

#### 4、基金合并后的投资管理

本基金吸收合并其他基金的, 本基金的投资管理将按基金合同约定保持不变。

本基金被其他基金吸收合并的, 本基金的投资管理将按照其他基金基金合同的约定执行。

本基金与其他基金合并为新基金的, 本基金的投资管理按照基金管理人、基金托管人协商一致的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等执行。

5、基金管理人与基金托管人应就基金合并事宜协商一致, 并按照基金合同的约定具体实施, 且无需经基金份额持有人大会审议批准。

### (二) 《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当按照法律法规或中国证监会的规定, 报中国证监会核准或备案, 并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### (三) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的, 在履行相关程序后, 《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、本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金的;

4、《基金合同》约定的其他情形;

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (四) 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、具有证券、期货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）基金财产清算小组成立后，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）对基金剩余财产进行分配。

（五）清算费用

清算费用是指基金财产清算小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剩余财产中支付。

（六）基金财产清偿顺序

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）分配给基金份额持有人。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

本基金分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足嘉实新兴市场 A 份额的本金及约定收益，剩余部分（如有）由嘉实新兴市场 B 份额的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，如果发生基金财产清算的情形，则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。

（七）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具有证券、期货相关业务资格的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财产清算报告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。

（八）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十、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 2021 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 214 人，平均年龄 34 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 2021 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1288 只。自 2003 年以来，本行连续十八年获得香港《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 80 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 年至今共十四次顺利通过评估组

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。基金管理人对于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。

## 二十一、境外托管人

### （一）基本情况

名称：香港上海汇丰银行有限公司

注册地址：香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦

办公地址：香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼

成立日期：1865 年

管理层：

行政总裁：王冬胜

联系人：钟咏苓

电话：+86 21 3888 2381

Email: sophiachung@hsbc.com.cn

公司网址：www.hsbc.com

2021 年 12 月 31 日公司股本：1,723.35 亿港元

2021 年 12 月 31 日托管资产规模：10 万亿美元

信用等级：标准普尔 AA-

汇丰是全球最大的银行及金融服务机构之一。我们通过三大环球业务：财富管理及个人银行、工商金融、环球银行及资本市场，为超过 4,000 万名客户提供服务。我们的业务网络遍及欧洲、亚洲、中东及非洲、北美和拉美，覆盖全球 64 个国家和地区。

汇丰旨在把握市场增长机会，致力建立联系以协助客户开拓商机，推动企业茁壮成长及各地经济繁荣发展，而最终目标是让客户实现理想。

汇丰控股有限公司在伦敦、香港、纽约、巴黎和百慕大证券交易所上市，股东约 194,000 名，遍布全球 130 个国家和地区。

### （二）境外托管人的职责

对基金的境外财产，基金托管人可以授权境外资产托管人代为履行其对基金的受托人职责，包括但不限于：

1、仅在依基金托管人指示之情形下，依规定之形式及方式转移、交换或交付其于境外资产托

管协议下为基金托管之 QDII 客持有之投资；

2、按照相关合同的约定，计算境外受托资产的资产净值，提供与受托资产业务活动有关的会计、交易记录、并保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料。

境外托管人须及促使其次托管人或代表人尽其合理努力及判断力履行有关协议所规定之责任与义务，但境外托管人或其代表人或次托管人并无欺诈、疏忽、故意失责之情况下，境外托管代理人或其代表人或次托管人及其董事、人员及其代理人就其等因善意及恰当地

履行境外资产托管协议，或依照基金托管人（或其获授权人）之指示或所为之行为而导致托管资产遭受之任何损失、费用或任何后果均不用负上法律责任。

境外托管人在履行职责过程中，因本身欺诈、疏忽、故意失责而导致托管资产遭受之损失（但任何附带、间接、特别、从属损害或惩戒性损害赔偿除外）的，基金托管人应当承担相应责任。在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议的适用法律及当地的证券市场惯例决定。

## 二十二、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 | 北京市丰台区丽泽路 16 号院 4 号楼汇亚大厦 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 | 上海浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 21 层 |    |               |
| 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  | 罗毅                                            |    |               |

##### （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）84362222              | 传真 | （0755）84362284 |
| 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 B 座 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 号万象城华润大厦 B 座 2 幢 1001A 室 |  |  |
|------|----------------------------------------------|--|--|

|     |                |    |                |
|-----|----------------|----|----------------|
| 电话  | （0571）88061392 | 传真 | （0571）88021391 |
| 联系人 | 邵琦             |    |                |

## (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号信和广场1802单元 |    |                |
| 电话   | （0591）88013670          | 传真 | （0591）88013670 |
| 联系人  | 陈寒梦                     |    |                |

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

|      |                       |  |  |
|------|-----------------------|--|--|
| 办公地址 | 南京市新街口汉中路2号亚太商务楼23层B区 |  |  |
| 电话   | （025）66671118         |  |  |
| 联系人  | 潘曙晖                   |  |  |

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

|      |                                  |    |               |
|------|----------------------------------|----|---------------|
| 办公地址 | 广东省广州市天河区冼村路5号凯华国际金融中心36层05-06单元 |    |               |
| 电话   | （020）29141918                    | 传真 | （020）29141914 |
| 联系人  | 陈寒梦                              |    |               |

## 2、代销机构

| 序号 | 代销机构名称                      | 代销机构信息                                                                                                                                                                 |
|----|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1  | 中国农业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座<br>法定代表人: 谷澍<br>电话: (010)85108227<br>传真: (010)85109219<br>客服电话: 95599<br>网址: <a href="http://www.abchina.com">http://www.abchina.com</a> |
| 2  | 中信银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街9号<br>法定代表人: 李庆萍<br>联系人: 丰靖<br>客服电话: 95558<br>网址: <a href="http://www.citicbank.com">http://www.citicbank.com</a>                                    |
| 3  | 中国民生银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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<br>法定代表人: 高迎欣<br>联系人: 王志刚                                                                                                                 |



|   |                               |                                                                                                                                                                                                               |
|---|-------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|   |                               | 电话: (010)58560666<br>客服电话: 95568<br>网址: <a href="http://www.cmbc.com.cn">http://www.cmbc.com.cn</a>                                                                                                           |
| 4 | 上海银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 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>                                             |
| 5 | 广发银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 办公地址: 广州市越秀区东风东路 713 号<br>法定代表人: 王凯<br>联系人: 詹全鑫、张扬眉<br>电话: (020) 38322256<br>传真: (020) 87310955<br>客服电话: 800-830-8003、400-830-8003<br>网址: <a href="http://www.cgbchina.com.cn">http://www.cgbchina.com.cn</a> |
| 6 | 平安银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 办公地址: 深圳市深南东路 5047 号<br>法定代表人: 谢永林<br>联系人: 张青<br>电话: 0755-22166118<br>传真: 0755-82080406<br>客服电话: 95511-3 或 95501<br>网址: <a href="http://www.bank.pingan.com">http://www.bank.pingan.com</a>                   |
| 7 | 上海农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号 16 层<br>法定代表人: 徐力<br>联系人: 施传荣<br>电话: 021-38523692<br>传真: 021-50105124<br>客服电话: (021)962999<br>网址: <a href="http://www.srcb.com">http://www.srcb.com</a>                                 |
| 8 | 北京农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号<br>法定代表人: 王金山<br>联系人: 王薇娜<br>电话: (010)85605006<br>传真: (010)85605345<br>客服电话: 96198<br>网址: <a href="http://www.bjrcb.com">http://www.bjrcb.com</a>                                     |
| 9 | 徽商银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 办公地址: 安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座<br>法定代表人: 吴学民<br>联系人: 顾伟平<br>电话: 0551-65898103<br>传真: 0551-62667684                                                                                                              |

|    |                                 |                                                                                                                                                                                                                     |
|----|---------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                 | <p>客服电话：4008896588</p> <p>网址：<a href="http://www.hsbank.com.cn">http://www.hsbank.com.cn</a></p>                                                                                                                    |
| 10 | 杭州银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。       | <p>办公地址：杭州市下城区庆春路 46 号</p> <p>法定代表人：陈震山</p> <p>联系人：严峻</p> <p>电话：(0571)85108309</p> <p>传真：(0571)85108309</p> <p>客服电话：400-888-8508</p> <p>网址：<a href="http://www.hzbank.com.cn">http://www.hzbank.com.cn</a></p>      |
| 11 | 深圳农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <p>办公地址：中国广东省深圳市深南东路 3038 号</p> <p>法定代表人：李光安</p> <p>联系人：常志勇</p> <p>电话：0755-25188781</p> <p>传真：0755-25188785</p> <p>客服电话：961200(深圳)</p> <p>网址：<a href="http://www.4001961200.com">http://www.4001961200.com</a></p>  |
| 12 | 大连银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。       | <p>办公地址：辽宁省大连市中山区人民路 6 号大连<br/>银行华昌支行 3 楼</p> <p>法定代表人：彭寿斌</p> <p>联系人：沈宗达</p> <p>电话：0411-82311936</p> <p>传真：0411-82311731</p> <p>客服电话：4006640099</p> <p>网址：<a href="http://www.bankofd.com">www.bankofd.com</a></p> |
| 13 | 广东顺德农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>办公地址：广东省佛山市顺德区大良德和居委会<br/>拥翠路 2 号</p> <p>法定代表人：姚真勇</p> <p>联系人：杨素苗</p> <p>电话：0757-22382524</p> <p>传真：0757-22388777</p> <p>网址：<a href="http://www.sdebank.com">http://www.sdebank.com</a></p>                      |
| 14 | 四川天府银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | <p>办公地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97<br/>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>                                    |
| 15 | 南洋商业银行(中国)有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路<br/>898 号 13 层至 16 层、18 层至 20 层</p> <p>法定代表人：孙建东</p> <p>联系人：施艳</p> <p>电话：021-38566625</p> <p>传真：021-68879803</p>                                                                           |

|    |                                   |                                                                                                                                                                                               |
|----|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                   | 网址: <a href="http://www.ncbchina.cn">http://www.ncbchina.cn</a>                                                                                                                               |
| 16 | 华融湘江银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。       | 办公地址: 湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段<br>828 号鑫远杰座大厦<br>法定代表人: 黄卫忠<br>联系人: 杨舟<br>电话: 0731-89828900<br>客服电话: 0731-96599<br>网址: <a href="http://www.hrxjbank.com.cn">http://www.hrxjbank.com.cn</a>             |
| 17 | 青岛农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 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 | 桂林银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。         | 办公地址: 桂林市中山南路 76 号<br>法定代表人: 吴东<br>联系人: 周佩玲<br>传真: 0773-3851691<br>客服电话: 4008696299<br>网址: <a href="http://www.guilinbank.com.cn">http://www.guilinbank.com.cn</a>                            |
| 19 | 浙江杭州余杭农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街<br>72 号<br>法定代表人: 来煜标<br>联系人: 蔡亮<br>电话: 0571-86209980<br>传真: 0571-86137150<br>客服电话: 96596/4008896596<br>网址: <a href="http://www.yhrcb.com/">http://www.yhrcb.com/</a>  |
| 20 | 浙江富阳农村商业银行股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 浙江省杭州市富阳区鹿山街道依江路<br>501 号第 1 幢<br>法定代表人: 丁松茂<br>联系人: 周群<br>电话: 0571-61732352<br>传真: 0571-63360418<br>客服电话: 40088-96596<br>网址: <a href="http://www.fyrcbk.com">http://www.fyrcbk.com</a> |
| 21 | 财咨道信息技术有限公司<br>注:只代销人民币份额。        | 法定代表人: 朱荣晖<br>电话: 024-82280563<br>网址: <a href="http://jinjiwo.com">jinjiwo.com</a>                                                                                                            |
| 22 | 江苏汇林保大基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 办公地址: 南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰<br>大厦 2005 室<br>法定代表人: 吴言林                                                                                                                                           |

|    |                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----|---------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                 | <p>联系人：林伊灵<br/> 电话：025-66046166-810<br/> 传真：025-56663409<br/> 客服电话：025-66046166<br/> 网址：<a href="http://www.huilinbd.com/">http://www.huilinbd.com/</a></p>                                                                                                       |
| 23 | 嘉晟瑞信(天津)基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>办公地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场 1 号楼 1708 室<br/> 法定代表人：陈峭<br/> 电话：022-59006885<br/> 网址：<a href="http://www.jsrxfund.com">www.jsrxfund.com</a></p>                                                                                                                   |
| 24 | 诺亚正行基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | <p>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></p>                                                               |
| 25 | 深圳众禄基金销售股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <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<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></p> |
| 26 | 上海好买基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | <p>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></p>                                                             |
| 27 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>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></p>                                                |
| 28 | 上海利得基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | <p>办公地址：上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室<br/> 法定代表人：李兴春<br/> 联系人：曹怡晨</p>                                                                                                                                                                                                    |

|    |                                 |                                                                                                                                                                                               |
|----|---------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                 | 电话：021-50583533<br>传真：021-50583633<br>客服电话：400-921-7755<br>网址： <a href="http://www.leadfund.com.cn">http://www.leadfund.com.cn</a>                                                            |
| 29 | 嘉实财富管理有限公司<br>注：只代销人民币份额。       | 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 11 层(100020)<br>法定代表人：张峰<br>联系人：闫欢<br>电话：400-021-8850<br>传真：--<br>客服电话：400-021-8850<br>网址： <a href="http://www.harvestwm.cn">http://www.harvestwm.cn</a> |
| 30 | 北京创金启富基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：中国北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A<br>法定代表人：梁蓉<br>联系人：魏素清<br>电话：010-66154828<br>传真：010-63583991<br>客服电话：400-6262-818<br>网址： <a href="http://www.5irich.com">http://www.5irich.com</a>           |
| 31 | 宜信普泽(北京)基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 15 层 1809<br>法定代表人：才殿阳<br>联系人：魏晨<br>电话：010-52413385<br>传真：010-85894285<br>客服电话：400-6099-200<br>网址： <a href="http://www.yixinfund.com">http://www.yixinfund.com</a>       |
| 32 | 浦领基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。       | 办公地址：北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层<br>法定代表人：张昱<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>                       |
| 33 | 通华财富(上海)基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 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：沈丹义<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>   |
| 34 | 北京中植基金销售有限公司                    | 办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 A 座 28                                                                                                                                                                      |

|    |                               |                                                                                                                                                                                                     |
|----|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 注:只代销人民币份额。                   | 层<br>法定代表人: 武建华<br>联系人: 侯艳红<br>电话: 010-53572363<br>传真: 010-56642623<br>客服电话: 400-8180-888<br>网址: <a href="http://www.zzfund.com">http://www.zzfund.com</a>                                          |
| 35 | 北京汇成基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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 D 座 4 层<br>法定代表人: 王伟刚<br>联系人: 宋子琪<br>电话: 010-62680527<br>传真: 010-62680527<br>客服电话: 400-619-9059<br>网址: <a href="http://www.hcfunds.com">www.hcfunds.com</a>           |
| 36 | 北京唐鼎耀华基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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: 鲁志勇<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>                           |
| 37 | 北京植信基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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: 王军辉<br>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> |
| 38 | 海银基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 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: 秦琼<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>       |
| 39 | 北京广源达信基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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<br>法定代表人: 齐剑辉<br>联系人: 王英俊<br>电话: 010-57298634<br>传真: 010-82055860                                                                                             |

|    |                                            |                                                                                                                                                                                                                                 |
|----|--------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                            | <p>客服电话：4006236060</p> <p>网址：<a href="http://www.niuniufund.com">http://www.niuniufund.com</a></p>                                                                                                                              |
| 40 | <p>济安财富(北京)基金销售有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p> | <p>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</p> <p>法定代表人：杨健</p> <p>联系人：李海燕</p> <p>电话：010-65309516</p> <p>传真：010-65330699</p> <p>客服电话：400-673-7010</p> <p>网址：<a href="http://www.jianfortune.com">http://www.jianfortune.com</a></p>  |
| 41 | <p>上海联泰资产管理有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p>     | <p>办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 楼</p> <p>法定代表人：尹彬彬</p> <p>联系人：兰敏</p> <p>电话：021-52822063</p> <p>传真：021-52975270</p> <p>客服电话：400-166-6788</p> <p>网址：<a href="http://www.66zichan.com">http://www.66zichan.com</a></p>             |
| 42 | <p>泰信财富基金销售有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p>     | <p>办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206</p> <p>法定代表人：彭浩</p> <p>联系人：郑雅婷</p> <p>电话：010-53579668</p>                                                                                                                                    |
| 43 | <p>上海中正达广基金销售有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p>   | <p>办公地址：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 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>       |
| 44 | <p>北京虹点基金销售有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p>     | <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：何静</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> |
| 45 | <p>奕丰基金销售有限公司</p> <p>注:只代销人民币份额。</p>       | <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</p> <p>法定代表人：TEO WEE HOWE</p> <p>联系人：叶健</p> <p>电话：0755-89460500</p>                                                                                                        |

|    |                                 |                                                                                                                                                                                            |
|----|---------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                 | 传真：0755-21674453<br>网址： <a href="https://www.ifastps.com.cn/">https://www.ifastps.com.cn/</a>                                                                                              |
| 46 | 中证金牛(北京)投资咨询有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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<br>法定代表人：钱昊旻<br>联系人：仲甜甜<br>电话：010-59336492<br>传真：010-59336510<br>客服电话：010-59336512<br>网址： <a href="http://www.jnlc.com">http://www.jnlc.com</a>       |
| 47 | 大连网金基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | 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>      |
| 48 | 中民财富基金销售(上海)有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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>            |
| 49 | 上海中欧财富基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号 729S 室<br>法定代表人：许欣<br>联系人：屠帅颖<br>电话：021-68609600<br>客服电话：400-700-9700<br>网址： <a href="http://www.qiangungun.com">http://www.qiangungun.com</a>                     |
| 50 | 万家财富基金销售(天津)有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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<br>法定代表人：戴晓云<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> |
| 51 | 上海华夏财富投资管理有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层<br>法定代表人：毛淮平<br>联系人：仲秋玥                                                                                                                                   |



|    |                             |                                                                                                                                                                                                |
|----|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | 电话：010-88066632<br>传真：010-88066214<br>客服电话：400-817-5666<br>网址： <a href="https://www.amcfortune.com/">https://www.amcfortune.com/</a>                                                           |
| 52 | 阳光人寿保险股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 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>          |
| 53 | 中国人寿保险股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 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>                                             |
| 54 | 国泰君安证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 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>                                |
| 55 | 中信建投证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号<br>法定代表人：王常青<br>联系人：权唐<br>电话：(010) 65183880<br>传真：(010) 65182261<br>客服电话：400-8888-108<br>网址： <a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>                   |
| 56 | 国信证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号<br>国信证券大厦十六层至二十六层<br>法定代表人：何如<br>联系人：李颖<br>电话：0755-82130833<br>传真：0755-82133952<br>客服电话：95536<br>网址： <a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a> |
| 57 | 招商证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座<br>38-45 层<br>法定代表人：霍达<br>联系人：林生迎                                                                                                                                       |

|    |                             |                                                                                                                                                                                                                |
|----|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | 电话: (0755)82943666<br>传真: (0755)82943636<br>客服电话: 4008888111、95565<br>网址: <a href="http://www.cmschina.com">http://www.cmschina.com</a>                                                                        |
| 58 | 广发证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦<br>法定代表人: 孙树明<br>联系人: 陈姗姗<br>电话: (020) 66338888<br>传真: (020) 87555305<br>客服电话: 95575 或致电各地营业网点<br>网址: <a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a>                       |
| 59 | 中信证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦<br>法定代表人: 张佑君<br>联系人: 郑慧<br>电话: 010-60838888<br>客服电话: 95558<br>网址: <a href="http://www.cs.ecitic.com">http://www.cs.ecitic.com</a>                            |
| 60 | 中国银河证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦<br>法定代表人: 陈共炎<br>联系人: 辛国政<br>电话: 010-80928123<br>传真: 010-83574807<br>客服电话: 4008-888-888 或 95551<br>网址: <a href="http://www.chinastock.com.cn">http://www.chinastock.com.cn</a> |
| 61 | 申万宏源证券有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号<br>法定代表人: 李梅<br>联系人: 陈宇<br>电话: 021-33388214<br>传真: 021-33388224<br>客服电话: 95523 或 4008895523<br>网址: <a href="http://www.swhysc.com">http://www.swhysc.com</a>                             |
| 62 | 兴业证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 福建省福州市湖东路 268 号<br>法定代表人: 杨华辉<br>联系人: 乔琳雪<br>电话: 021-38565547<br>客服电话: 95562<br>网址: <a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a>                                                          |
| 63 | 长江证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号<br>法定代表人: 李新华<br>联系人: 奚博宇<br>电话: 027-65799999                                                                                                                                          |

|    |                               |                                                                                                                                                                                                          |
|----|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                               | 传真：027-85481900<br>客服电话：95579 或 4008-888-999<br>网址： <a href="http://www.95579.com">http://www.95579.com</a>                                                                                              |
| 64 | 安信证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。     | 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<br>法定代表人：黄炎勋<br>联系人：陈剑虹<br>电话：（0755）82825551<br>传真：（0755）82558355<br>客服电话：4008001001<br>网址： <a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a> |
| 65 | 国元证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。     | 办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号<br>法定代表人：蔡咏<br>联系人：陈玲玲<br>电话：（0551）2246273<br>传真：（0551）2272100<br>客服电话：95578<br>网址： <a href="http://www.gyzq.com.cn">http://www.gyzq.com.cn</a>                                      |
| 66 | 华泰证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。     | 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>                                |
| 67 | 中信证券(山东)有限责任公司<br>注：只代销人民币份额。 | 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层<br>法定代表人：姜晓林<br>联系人：焦刚<br>电话：（0531）89606166<br>传真：（0532）85022605<br>客服电话：95548<br>网址： <a href="http://sd.citics.com/">http://sd.citics.com/</a>                           |
| 68 | 东吴证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。     | 办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号<br>法定代表人：范力<br>联系人：方晓丹<br>电话：(0512)65581136<br>传真：(0512)65588021<br>客服电话：95330<br>网址： <a href="http://www.dwzq.com.cn">http://www.dwzq.com.cn</a>                                  |
| 69 | 方正证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。     | 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<br>法定代表人：施华<br>联系人：丁敏                                                                                                                                    |

|    |                             |                                                                                                                                                                                                            |
|----|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | 电话：(010)59355997<br>传真：(010)56437013<br>客服电话：95571<br>网址： <a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a>                                                                                  |
| 70 | 长城证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号<br>能源大厦南塔楼 10-19 层<br>法定代表人：曹宏<br>联系人：金夏<br>电话：(021)62821733<br>传真：(0755)83515567<br>客服电话：4006666888、(0755)33680000<br>网址： <a href="http://www.cgws.com">http://www.cgws.com</a> |
| 71 | 光大证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号<br>法定代表人：周健男<br>联系人：刘晨、李芳芳<br>电话：(021) 22169999<br>传真：(021) 22169134<br>客服电话：4008888788、10108998<br>网址： <a href="http://www.ebscn.com">http://www.ebscn.com</a>                      |
| 72 | 中信证券华南股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际<br>金融中心主塔 19 层、20 层<br>法定代表人：胡伏云<br>联系人：梁微<br>电话：020-88836999<br>传真：020-88836984<br>客服电话：95396<br>网址： <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>                    |
| 73 | 浙商证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：浙江省杭州市五星路 201 号<br>法定代表人：吴承根<br>联系人：许嘉行<br>电话：(0571) 87901912<br>传真：(0571) 87901913<br>客服电话：(0571) 967777<br>网址： <a href="http://www.stocke.com.cn">http://www.stocke.com.cn</a>                      |
| 74 | 平安证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融<br>中心 61 层-64 层<br>法定代表人：何之江<br>联系人：周一涵<br>电话：021-38637436<br>传真：021-58991896<br>客服电话：95511—8<br>网址： <a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a>                      |
| 75 | 华安证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路<br>198 号                                                                                                                                                                             |

|    |                             |                                                                                                                                                                                                                  |
|----|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | <p>法定代表人：章宏韬<br/> 联系人：范超<br/> 电话：0551-65161821<br/> 传真：0551-65161672<br/> 客服电话：95318<br/> 网址：<a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a></p>                                                           |
| 76 | 东海证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | <p>办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦<br/> 法定代表人：陈耀庭<br/> 联系人：王一彦<br/> 电话：(021)20333333<br/> 传真：(021)50498825<br/> 客服电话：95531;400-8888-588<br/> 网址：<a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a></p> |
| 77 | 申万宏源西部证券有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | <p>办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室<br/> 法定代表人：李琦<br/> 联系人：王怀春<br/> 电话：0991-2307105<br/> 传真：0991-2301927<br/> 客服电话：4008-000-562<br/> 网址：<a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a></p>           |
| 78 | 中泰证券股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | <p>办公地址：济南市市中区经七路86号<br/> 法定代表人：李玮<br/> 联系人：许曼华<br/> 电话：021-20315290<br/> 客服电话：95538<br/> 网址：<a href="http://www.zts.com.cn/">http://www.zts.com.cn/</a></p>                                                     |
| 79 | 中国国际金融股份有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | <p>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<br/> 法定代表人：丁学东<br/> 联系人：杨涵宇<br/> 电话：(010)65051166<br/> 传真：(010)85679203<br/> 客服电话：400 910 1166<br/> 网址：<a href="http://www.cicc.com.cn">http://www.cicc.com.cn</a></p>       |
| 80 | 华鑫证券有限责任公司<br>注：只代销人民币份额。   | <p>办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元<br/> 法定代表人：俞洋<br/> 联系人：杨莉娟<br/> 电话：021-54967552<br/> 传真：021-54967032<br/> 客服电话：021-32109999;029-68918888;4001099918</p>                                                |

|    |                             |                                                                                                                                                                                                             |
|----|-----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | 网址: <a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a>                                                                                                                                             |
| 81 | 中国中金财富证券有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层<br>法定代表人: 高涛<br>联系人: 胡芷境<br>电话: 0755-88320851<br>传真: 0755-82026539<br>客服电话: 400 600 8008<br>网址: <a href="http://www.china-invs.cn">http://www.china-invs.cn</a> |
| 82 | 国金证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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<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>       |
| 83 | 华宝证券有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层<br>法定代表人: 陈林<br>联系人: 夏元<br>电话: (021) 68777222<br>传真: (021) 68777822<br>客服电话: 4008209898<br>网址: <a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a>                 |
| 84 | 海通证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 办公地址: 上海市广东路 689 号<br>法定代表人: 周杰<br>联系人: 金芸、李笑鸣<br>电话: (021)23219000<br>传真: (021)23219100<br>客服电话: 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话<br>网址: <a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>                       |
| 85 | 万联证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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: 袁笑一<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>                                              |
| 86 | 民生证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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: 张玉蕊<br>电话: 010-85127609                                                                                                                     |

|    |                           |                                                                                                                                                                                                           |
|----|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                           | 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>                                                                                                    |
| 87 | 渤海证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 天津市南开区宾水西道8号<br>法定代表人: 王春峰<br>联系人: 蔡霆<br>电话: (022)28451991<br>传真: (022)28451892<br>客服电话: 4006515988<br>网址: <a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a>                                    |
| 88 | 信达证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼<br>法定代表人: 张志刚<br>联系人: 尹旭航<br>电话: (010)63081493<br>传真: (010)63081344<br>客服电话: 95321<br>网址: <a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>                             |
| 89 | 东北证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 长春市生态大街6666号<br>法定代表人: 李福春<br>联系人: 安岩岩<br>电话: (0431)85096517<br>传真: (0431)85096795<br>客服电话: 95360<br>网址: <a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a>                                        |
| 90 | 财信证券有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层<br>法定代表人: 刘宛晨<br>联系人: 郭静<br>电话: (0731)84403347<br>传真: (0731)84403439<br>客服电话: 95317<br>网址: <a href="http://www.cfzq.com">http://www.cfzq.com</a>                        |
| 91 | 中信期货有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | 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<br>法定代表人: 张皓<br>联系人: 刘宏莹<br>电话: 010-60833754<br>传真: 021-60819988<br>客服电话: 400-990-8826<br>网址: <a href="http://www.citicsf.com">http://www.citicsf.com</a> |
| 92 | 东海期货有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。 | 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                                                                                                                                                      |

|    |                             |                                                                                                                                                                                                                 |
|----|-----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | <p>法定代表人：钱俊文<br/> 联系人：李天雨<br/> 电话：021-68757102<br/> 传真：021-68757102<br/> 客服电话：95531/4008888588<br/> 网址：<a href="http://www.qh168.com.cn/">http://www.qh168.com.cn/</a></p>                                      |
| 93 | 上海证券有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。   | <p>办公地址：上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼<br/> 法定代表人：李俊杰<br/> 联系人：邵珍珍<br/> 电话：(021)53686888<br/> 传真：(021)53686100-7008<br/> 客服电话：(021)962518、4008918918<br/> 网址：<a href="http://www.shzq.com">http://www.shzq.com</a></p> |
| 94 | 新时代证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。  | <p>办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501<br/> 法定代表人：叶顺德<br/> 联系人：田芳芳<br/> 电话：(010)83561146<br/> 客服电话：95399<br/> 网址：<a href="http://www.xsdzq.cn">http://www.xsdzq.cn</a></p>                                    |
| 95 | 国都证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <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<br/> 法定代表人：王少华<br/> 联系人：黄静<br/> 电话：(010)84183389<br/> 传真：(010)84183311<br/> 客服电话：400-818-8118<br/> 网址：<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a></p>            |
| 96 | 上海华信证券有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼<br/> 法定代表人：陈灿辉<br/> 联系人：倪丹<br/> 电话：021-38784818<br/> 传真：021-68775878<br/> 客服电话：68777877<br/> 网址：<a href="http://www.shhxxzq.com/">http://www.shhxxzq.com/</a></p>     |
| 97 | 江海证券有限公司<br>注:只代销人民币份额。     | <p>办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号<br/> 法定代表人：赵洪波<br/> 联系人：周俊<br/> 电话：0451-85863726<br/> 传真：0451-82337279<br/> 客服电话：956007<br/> 网址：<a href="http://www.jhzq.com.cn/">http://www.jhzq.com.cn/</a></p>                     |



|     |                           |                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 98  | 爱建证券有限责任公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 层<br>法定代表人: 祝健<br>联系人: 姚盛盛<br>电话: (021) 32229888<br>传真: 021-68728703<br>客服电话: 4001962502<br>网址: <a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>                            |
| 99  | 华融证券股份有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | 办公地址: 北京朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 18 层<br>法定代表人: 祝献忠<br>联系人: 李慧灵<br>电话: 010-85556100<br>传真: 010-85556088<br>客服电话: 400-898-4999<br>网址: <a href="http://www.hrsec.com.cn">http://www.hrsec.com.cn</a>                          |
| 100 | 中国工商银行股份有限公司              | 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号<br>法定代表人: 陈四清<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> |
| 101 | 中国银行股份有限公司                | 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>                                                                  |
| 102 | 交通银行股份有限公司                | 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号<br>法定代表人: 任德奇<br>联系人: 高天<br>电话: 021-58781234<br>传真: 021-58408483<br>客服电话: 95559<br>网址: <a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>                                                  |
| 103 | 招商银行股份有限公司                | 办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号<br>法定代表人: 缪建民<br>联系人: 季平伟<br>电话: (0755) 83198888<br>传真: (0755) 83195050<br>客服电话: 95555<br>网址: <a href="http://www.cmbchina.com">http://www.cmbchina.com</a>                                    |
| 104 | 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                                                                                                                                                                                            |

|     |                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----|------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                          | <p>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>                                                                                         |
| 105 | <p>深圳市新兰德证券投资咨询有限公司<br/> 注：只代销人民币份额。</p> | <p>办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 17 层<br/> 法定代表人：CHEN ZHENG JAMES<br/> 联系人：孙博文<br/> 电话：010-83363101<br/> 传真：010-83363072<br/> 客服电话：400-166-1188<br/> 网址：<a href="http://8.jrj.com.cn">8.jrj.com.cn</a></p>                                                      |
| 106 | <p>和讯信息科技有限公司<br/> 注：只代销人民币份额。</p>       | <p>办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层<br/> 法定代表人：章知方<br/> 联系人：陈慧慧<br/> 传真：8610-65884788<br/> 客服电话：4009200022<br/> 网址：<a href="http://www.hexun.com/">http://www.hexun.com/</a></p>                                                                                         |
| 107 | <p>上海挖财基金销售有限公司<br/> 注：只代销人民币份额。</p>     | <p>办公地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元<br/> 法定代表人：吕柳霞<br/> 联系人：毛善波<br/> 电话：021-50810687<br/> 传真：021-58300279<br/> 客服电话：021-50810673<br/> 网址：<a href="http://www.wacaijijin.com">http://www.wacaijijin.com</a></p>                                            |
| 108 | <p>腾安基金销售(深圳)有限公司<br/> 注：只代销人民币份额。</p>   | <p>办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼<br/> 法定代表人：林海峰<br/> 联系人：谭广锋<br/> 电话：0755-86013388-80618<br/> 传真：-<br/> 客服电话：95017<br/> 网址：<a href="http://www.tenganxinxi.com">http://www.tenganxinxi.com</a> 或 <a href="http://www.txfund.com">http://www.txfund.com</a></p> |
| 109 | <p>北京百度百盈基金销售有限公司<br/> 注：只代销人民币份额。</p>   | <p>办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼<br/> 法定代表人：盛超<br/> 联系人：林天赐<br/> 电话：010-59403028<br/> 传真：010-59403027</p>                                                                                                                                                        |

|     |                               |                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                               | <p>客服电话：95055</p> <p>网址：<a href="http://www.baiyingfund.com">http://www.baiyingfund.com</a></p>                                                                                                                                   |
| 110 | 上海天天基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座</p> <p>法定代表人：其实</p> <p>联系人：屠彦洋</p> <p>电话：95021</p> <p>传真：(021) 64385308</p> <p>客服电话：400-1818-188</p> <p>网址：<a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a></p>                        |
| 111 | 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>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</p> <p>法定代表人：祖国明</p> <p>联系人：韩爱彬</p> <p>电话：021-60897840</p> <p>传真：0571-26697013</p> <p>客服电话：400-0766-123</p> <p>网址：<a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a></p>               |
| 112 | 浙江同花顺基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。  | <p>办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大厦</p> <p>法定代表人：吴强</p> <p>联系人：林海明</p> <p>传真：0571-86800423</p> <p>客服电话：952555</p> <p>网址：<a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a></p>                                                  |
| 113 | 南京苏宁基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。   | <p>办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号</p> <p>法定代表人：王锋</p> <p>联系人：冯鹏鹏</p> <p>电话：025-66996699-887226</p> <p>传真：025-66996699-887226</p> <p>客服电话：95177</p> <p>网址：<a href="http://www.snjijin.com/">http://www.snjijin.com/</a></p>                 |
| 114 | 上海大智慧基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。  | <p>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</p> <p>法定代表人：张俊</p> <p>联系人：张蜓</p> <p>电话：021-20219988-37492</p> <p>传真：021-20219923</p> <p>客服电话：021-20292031</p> <p>网址：<a href="https://www.wg.com.cn/">https://www.wg.com.cn/</a></p> |
| 115 | 北京新浪仓石基金销售有限公司<br>注:只代销人民币份额。 | <p>办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼</p> <p>法定代表人：穆飞虎</p> <p>联系人：韩宇琪</p> <p>电话：010-62675768</p>                                                                                                                       |

|     |                               |                                                                                                                                                      |
|-----|-------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                               | 传真：010-62676582<br>客服电话：010-6267 5369<br>网址：www.xincai.com                                                                                           |
| 116 | 上海万得基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼<br>法定代表人：黄玮<br>联系人：徐亚丹<br>电话：021-68882280<br>传真：021-68882281<br>客服电话：400-799-1888<br>网址：https://www.520fund.com.cn/  |
| 117 | 上海陆金所基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。  | 办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼<br>法定代表人：陈祎彬<br>联系人：郑理<br>电话：021-20665952<br>传真：021-22066653<br>客服电话：4008219031<br>网址：http://www.lufunds.com        |
| 118 | 珠海盈米基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室<br>法定代表人：肖雯<br>联系人：邱湘湘<br>电话：020-89629019<br>传真：020-89629011<br>客服电话：020-89629066<br>网址：http://www.yingmi.cn          |
| 119 | 和耕传承基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503<br>法定代表人：温丽燕<br>联系人：高培<br>电话：0371-85518395 4000-555-671<br>传真：0371-85518397<br>网址：https://www.hgccpb.com/ |
| 120 | 南京途牛金融信息服务有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-32 号<br>法定代表人：单宏杰<br>联系人：张士帅<br>电话：025-86853960 025-86853969<br>传真：025-86853969<br>网址：http://jr.tuniu.com/                       |
| 121 | 京东肯特瑞基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。  | 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<br>法定代表人：李骏<br>联系人：隋斌                                                                                 |

|     |                             |                                                                                                                                                     |
|-----|-----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                             | 电话：4000988511<br>传真：010-89188000<br>客服电话：95118<br>网址：kenterui.jd.com                                                                                |
| 122 | 北京雪球基金销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。 | 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<br>法定代表人：李楠<br>联系人：侯芳芳<br>电话：010-61840688<br>传真：010-61840699<br>客服电话：400-159-9288<br>网址：https://danjuanapp.com/ |
| 123 | 华瑞保险销售有限公司<br>注：只代销人民币份额。   | 办公地址：上海市浦东区向城路 288 号 8 楼<br>法定代表人：路昊<br>联系人：张爽爽<br>电话：021-68595976<br>传真：021-68595766<br>客服电话：952303<br>网址：http://www.huaruisales.com               |

## （二） 登记机构

|       |                                       |
|-------|---------------------------------------|
| 名称    | 嘉实基金管理有限公司                            |
| 住所    | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 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） 出具法律意见书的律师事务所

|         |                           |     |               |
|---------|---------------------------|-----|---------------|
| 名称      | 上海源泰律师事务所                 |     |               |
| 住所、办公地址 | 中国上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层 |     |               |
| 负责人     | 廖海                        | 联系人 | 张兰            |
| 电话      | （021）51150298             | 传真  | （021）51150398 |

|      |       |
|------|-------|
| 经办律师 | 刘佳、张兰 |
|------|-------|

（四） 审计基金财产的会计师事务所

|         |                                             |     |               |
|---------|---------------------------------------------|-----|---------------|
| 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                                       |     |               |

## 二十三、基金合同内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### A. 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）根据本合同的约定决定进行份额转换的权利；
- （10）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、《业务规则》；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）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；
- （5）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；
- （6）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；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）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。

#### B. 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （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、更换基金销售机构，对基金销售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登记机构办理基金登记业务并获得《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、赎回和转换申请；

（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、融券；

（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并确定有关费率；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和收益分配等内容，开通人民币、美元之外的其他币种的申购、赎回业务；

（17）根据有关规定选择、更换或撤销基金证券经纪代理商以及证券登记机构，并对其行为进行必要的监督；

（18）委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；



- （3）自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、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》、《试行办法》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、嘉实新兴市场 A 及嘉实新兴市场 B 的基金份额净值及份额参考净值,确定转换后本基金 A1 类和 C2 类基金份额的申购、赎回价格;
- （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》、《试行办法》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》、《试行办法》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》、《试行办法》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条件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）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）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；

（24）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，基金管理人承担全部募集费用，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；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）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。

#### C. 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（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费用；

（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）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）选择、更换或撤销境外托管人并为之签署有关协议；

（8）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》、《试行办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（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）建立健全内部风险控制、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》、《试行办法》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（或委托境外托管人保管）由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户，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》、《试行办法》及其他有关规定另有规定外，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、嘉实新兴市场 A 及嘉实新兴市场 B 的基金份额净值及份额参考净值、转换后本基金各类别基金份额的申购、赎回价格、基金份额净值；

（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）基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；其它基金托管业务活动的相关资料的保存时间应不少于 15 年；

（12）建立并保存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）依据《基金法》、《基金合同》、《试行办法》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》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，应为基金份额持有人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议；

（22）选择符合《试行办法》第十九条规定的境外资产托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责；境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；

（23）保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

（24）每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

（25）办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

（26）法律法规、中国证监会、外管局规定的和《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组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额持有人就基金份额持有人大会涉及的提案、出席、表决分别计算基金份额。嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额级别内拥有平等的投票权；

分级运作届满日起，本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，基金份额持有人持有的不同币种份额在基金份额持有人大会所代表的表决权不同。每份人民币份额代表一份投票权。每份美元份额，按其在权益登记日的基金份额净值以当日适用汇率折算为人民币后的金额与权益登记日的人民币份额的基金份额净值之比计算其代表的投票权数。

### A. 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止《基金合同》（法律法规，或《基金合同》，或中国证监会另有规定的除外）；
- （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（法律法规，或《基金合同》，或中国证监会另有规定的除外）；
- （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并（法律法规，或《基金合同》，或中国证监会另有规定的除外）；

（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规，或《基金合同》，或中国证监会另有规定的除外）；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算；②本基金分级运作期内，该等基金份额持有人单独或合计持有的基金份额应同时包括嘉实新兴市场 A 与嘉实新兴市场 B，并且占各该级别份额总数的 10%以上；本基金终止分级运作方式并转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，该等基金份额持有人单独或合计持有的基金份额应同时包括嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类份额与嘉实新兴市场债券型证券投资基金 C2 类份额，并且占各该类别份额总数的 10%以上，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对《基金合同》当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）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、尽管存在前述情形，但如属于以下情况之一的，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、基金托管费及其他应由基金承担的费用；

（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或变更收费方式、赎回费率；

（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）《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况；

（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则，或增设其他外币基金份额或销售币种；

（8）本基金分级运作届满日，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 终止基金份额分级运作，并将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金；

（9）在外管局和中国证监会允许，符合相关法律法规的情况下，本基金开通并采用“交叉币种赎回”原则；

（10）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。

#### B. 会议召集人及召集方式

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、单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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、单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### C. 通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，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、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

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

- （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，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对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。

#### D. 开会方式

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证明委派代表出席，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证明符合法律法规、《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益登记日持有基金份额所代表的基金资产净值的凭证显示，有效的基金份额所代表的基金资产净值不少于本基金在权益登记日基金资产净值的50%（含50%）（本基金分级运作期内，指全部有效凭证所对应的嘉实新兴市场A和嘉实新兴市场B应占权益登记日各级别总份额50%以上，含50%。下同）；

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》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（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统计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统计书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额所代表的基金资产净值不少于在权益登记日基金资产净值的50%（含50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于第1条第（2）款、第2条第（3）款规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

#### E. 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”项下第一款所述事项。

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前及时公告。

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。

##### 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计票人，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%）（本基金分级运作期内，指本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的嘉实新兴市场A和嘉实新兴市场B应占权益登记日各级别总份额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拒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。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 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。

## F. 表决

本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 的基金份额持有人就基金份额持有人大会涉及的表决应分别独立实施。嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额级别内拥有平等的表决权。

分级运作届满日起，本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额、嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额的基金份额持有人就基金份额持有人大会涉及的表决应合并实施。基金份额持有人持有的不同币种份额在基金份额持有人大会所代表的表决权不同。每份人民币份额代表一份表决权。每份美元份额，按其在权益登记日的基金份额净值以当日适用汇率折算为人民币后的金额与权益登记日的人民币份额的基金份额净值之比计算其代表的表决权数。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议，在满足前二款所述条件下，有效的一般决议和特别决议还应符合下列条件：

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》，与其他基金合并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，除非在计票时计票人及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面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，但应当计入出具书面意见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。

## G. 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人士共同担任计票人；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计票人。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）计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异议，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。计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）计票过程可以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计票人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。

## H. 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日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自报中国证监会依法备案之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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。

I . 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## （三）基金合同解除和终止的理由、程序

### a) 基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《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、本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

b) 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、具有证券、期货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) 基金财产清算小组成立后，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) 对基金剩余财产进行分配；

C. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小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剩余财产中支付。

D. 基金财产清偿顺序

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 分配给基金份额持有人。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

本基金分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足嘉实新兴市场 A 份额的本金及约定收益，剩余部分（如有）由嘉实新兴市场 B 份额的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，如果发生基金财产清算的情形，则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。

#### F. 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具有证券、期货相关业务资格的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财产清算报告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。

#### G. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （四）争议解决方式

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，各方当事人应尽量通过协商、调解解决。协商、调解不能解决的任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

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

《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。本《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。投资者也可在支付一定工本费后获得基金合同复印件或复制件，但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

#### A. 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 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

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

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；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

存续期间：持续经营

电话：(010)65215588

传真：(010)65185678

联系人：胡勇钦

#### B. 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

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

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 35,640,625.7089 万元

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

### A. 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与基金管理人的约定监督事项，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：本基金的投资范围包括政府债券、政府支持债券、公司债券（包括公司发行的金融债券）、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券、房地产信托凭证（REITs）、公募基金（包括ETF）、货币市场工具、结构性投资产品、利率互换、信用违约互换、债券期货、货币远期或期货合约、外汇互换等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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：：本基金投资组合中债券类资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于新兴市场债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金和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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

“新兴市场债券”指新兴市场国家或地区的政府发行的债券、总部登记注册在新兴市场国家或地区或主要业务收入/资产在新兴市场国家或地区的机构、企业等发行的债券，主要包括离岸人民币债券及中国、香港美元债券部分亚洲及其他新兴市场国家或地区政府、金融机构及公司发行的以美元或本币计价的固定收益证券。

“新兴市场国家或地区”所指的国家或地区主要包括：中国、韩国、台湾、香港、新加坡、印度、土耳其、泰国、马来西亚、印度尼西亚、以色列、菲律宾、中东地区、南非、埃及、摩洛哥、俄罗斯、捷克、波兰、匈牙利、巴西、墨西哥、智利、哥伦比亚、秘鲁、等国家或地区。本基金主要投资于与中国证监会签署备忘录的新兴市场国家或地区的证券。

（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：

1) 本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定。

2) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

3) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。

4) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

5) 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量；同一机构境内外上市的总股本将合并计算，同时全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券将一并计算，并假设对持有的股本权证行使转换；

6) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%；前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

7) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

8) 同一境内机构投资者管理且由基金托管人托管的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

9) 关于金融衍生品投资的限制

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

I. 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

II. 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

III. 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

a. 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

b. 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

c. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%；

d. 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品；

基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告；

10) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

I. 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

II. 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

III. 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

IV. 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a. 现金；

b. 存款证明；

c. 商业票据；

d. 政府债券；

e. 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

V. 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

VI. 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

11) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

I. 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

II. 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

III. 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

IV. 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

12) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

13) 本基金如果参与境内逆回购交易，还应当遵守：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。



法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定或设定其他本基金须遵循的比例限制的，从其规定。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第 13）项规定外，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门调整上述限制的，基金管理人有权按照调整后的规定执行。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财产划转至托管账户之日起开始。

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）购买不动产；
- （2）购买房地产抵押按揭；
- （3）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （4）购买实物商品；
- （5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金、集合计划资产净值的 10%；
- （6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （7）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （8）从事证券承销业务；
- （9）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （10）从事承担无限责任的投资；
- （11）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （12）不公平对待不同客户或不同投资组合；
- （13）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；

上述组合限制、禁止行为的设定依据为本基金合同生效时法律法规及监管机关的要求，如果法律法规或监管机关对上述组合限制、禁止行为进行调整的，基金管理人将按照调整后的规定执行。

B. 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、基金份额参考净值计算、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。

C. 对于承诺监督的事项，基金托管人发现基金管理人或其授权境外投资顾问的投资运作和投资指令违反法律法规或《基金合同》的规定，应及时以书面或电话或双方认可的其他方式通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人应报告监管部门。

对于承诺监督的事项，基金托管人发现基金管理人或其授权投资机构有重大违法违规行为，应立即报告有关监管机构，同时通知基金管理人；由基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告有关监管机构。

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。

D. 基金管理人认可，合规投资责任方为基金管理人，基金托管人及其境外托管人的合规监管系统的准确性和完整性受限与基金管理人、经纪人及其他中介机构提供用于该系统的数据和信息。基金托管人及其境外托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

#### E. 无投资责任

基金管理人应理解，托管人基于法律法规、基金合同及本协议对基金管理人进行业务监督。除下列第 4.6 项及法律法规、基金合同明确另有规定外，基金托管人及其境外托管人将不会因为履行业务监督职责而承担任何因基金管理人违规投资所产生的责任，也没有义务采取任何手段回应任何与合规分析服务有关的信息和报道，除非接到基金管理人或其授权境外投资顾问要求基金托管人或其境外托管人针对某个信息和报道作回应的书面指示。

F. 基金托管人及其境外托管人应本着诚实尽责的原则，采取合理的手段、方法和实施工具，来提高业务监督质量，除非基金托管人或其境外托管人因疏忽、过失或故意而未能尽职尽责，未履行或未充分履行监督职责，并进而给基金资产或基金管理人造成损失，否则基金托管人或其境外托管人不应就业务监督承担任何责任。

### （三）基金管理人对其基金托管人的业务监督和核查

A. 在本协议有效期内，在不违反公平、合理原则，以及不导致基金托管人的接受基金管理人监督与检查与相关法律法规及其行业监管要求相冲突的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的监督与检查。基金管理人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、嘉实新兴

市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额参考净值、各自的基金份额累计参考净值、嘉实新兴市场 A 的约定年收益率、嘉实新兴市场 A 与嘉实新兴市场 B 的份额配比，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。

B. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人须向基金托管人作出书面提示；基金托管人在接到提示后，应在下一工作日前及时对提示内容予以确认，如无异议，应在基金管理人给定的合理期限内改进，如有异议，应作出书面解释。

C. 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。

D. 基金管理人须尽其最大努力保证其对基金托管人的业务核查不影响基金托管人的正常营业活动。

#### （四）基金财产保管

##### A. 基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产；基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户。境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人签订的主次托管协议为本基金在境外开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。

3、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4、境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券交易所规则、市场惯例及其与基金托管人签订的主次托管协议持有并保管基金财产。基金托管人在已根据《试行办法》的要求谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规、本合同及托管协议的要求保管托管资产的前提下，基金托管人对境外托管人破产产生的损失不承担责任。但基金托管人应根据基金管理人的指令采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。除非基金管理人、基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金管理人、基金托管人不对境外托管人依据当地法律法规、证券交易所规则、市场惯例的作为或不作为承担责任。；

5、基金托管人自身，并确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；

6、除非根据基金管理人书面同意，基金托管人自身，并应确保境外托管人不得在任何基金资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，但根据基金财产所在地法律法规的规定而产生的担保权利除外；

7、对于因为基金管理人进行本协议项下基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人。如因基金持有的资产所产生的应收资产，

并由基金托管人作为资产持有人，基金托管人应负责与有关当事人确定到账日期并通知基金管理人。到账日没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知并配合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。

#### B. 募集资金的验资与划转

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。

2、基金募集期满或基金管理人停止基金募集时，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，由基金管理人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有效。

3、验资完成，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。基金托管人自基金财产划入资产托管专户之日起履行本协议项下托管职责。

#### C. 资产保管内容和约定事项

基金管理人同意，现金账户中的现金将由基金托管人或其境外托管人以基金托管人或其境外托管人的银行身份持有。

除非基金管理人按指令程序发送的指令另有规定，否则，基金托管人和其境外托管人应在收到基金管理人的指令后，按下述方式收付现金、或收付证券：(a) 按照交易发生的司法管辖区或市场的有关惯常和既定惯例和程序作出；或 (b) 就通过证券系统进行的买卖而言，按照管辖该系统运营的规则、条例和条件作出。基金托管人和其境外托管人应不时将该等有关惯例、程序、规则、条例和条件及时通知基金管理人。

基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将基金财产归入其清算财产。基金托管人应自身，并确保其境外托管人建立安全的数据管理机制，安全完整地保存基金管理人与基金财产相关的业务数据和信息。

#### D. 基金的银行账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金或者托管人与基金联名的形式在其营业机构或其境外托管人处开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金资金账户的银行预留印鉴由基金托管人或其境外托管人的营业机构保管和使用。

2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行基金业务以外的活动。

3、基金资金账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区相关监管机构的有关规定。

#### E. 基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人按照投资地法律法规要求或行业惯例需要，在基金所投资市场或证券交易所适用的登记结算机构为基金开立基金名义或基金托管人名义或境外托管人名义或境外托管人的代理人名义，或以上任何一方与基金联名名义的证券账户。由基金托管人或其境外托管人负责办理与开立证券账户有关的手续，基金管理人提供所有必要协助。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及境外托管人均不得出借或未经基金托管人、基金管理人双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基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金管理人投资于合法合规、符合基金合同的其他非交易所市场的投资品种时，基金托管人或其境外托管人根据投资所在市场以及国家或地区的相关规定，开立进行基金的投资活动所需要的各类证券和结算账户，并协助办理与各类证券和结算账户相关的投资资格。

5、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区有关法律的规定。

#### F. 其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或其境外托管人负责开立，基金管理人应提供所有必要协助。

2、投资市场所在国家或地区法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### G. 证券登记

1、境外证券的注册登记方式应符合投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例。

2、基金托管人应确保基金管理人所管理的基金或基金份额持有人始终是以所有证券的实益所有人(beneficial owner)的方式持有基金财产中的所有证券。

3、基金托管人应该：(a)在其账目和记录中单独列记属于本基金的证券，并且(b)要求和确保其境外托管人在其账目和记录中单独清楚列记证券不属于境外托管人，不论证券以何人的名义登记。而且，若证券由基金托管人、境外托管人以无记名方式实际持有，要求和确保其境外托管人将这些证券和基金托管人、其境外托管人自有资产分别独立存放。

4、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性(包括是否以良好形式转让)。

5、基金托管人及其境外托管人应指示存放在证券系统的证券为基金的实益所有人持有，但须遵守管辖该系统运营的规则、条例和条件。

6、由基金托管人及其境外托管人为基金的利益而持有的证券（无记名证券和在证券系统持有的证券除外）应按本协议约定登记，投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例另有规定的除外。

7、基金托管人及其境外托管人应就其为基金利益而持有证券的市场有关证券登记方式的重大改变通知基金管理人。若基金管理人要求改变本协议约定的证券登记方式，基金托管人及其境外托管人应就此予以充分配合。

#### H. 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可存放于基金托管人或其境外托管人的保管库或其他机构。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人（或其授权的境外投资顾问）的指令办理。属于基金托管人及其境外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及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### I. 与基金财产有关的重大合同的保管

基金管理人应及时向基金托管人提供涉及基金财产投资运作的书面协议的副本或相关证明文件。

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。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，保存时间应符合相关法律、法规要求。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### A. 基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### 1、会计核算和估值的处理原则

（1）托管资产的会计责任主体为基金管理人，基金托管人对本基金的资产净值、基金份额参考净值、嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额净值的计算进行复核。基金管理人应向基金托管人提供基金托管人进行本基金的净值计算复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。基金管理人应依据与基金托管人及其境外托管人协商确定的会计原则和会计准则进行会计处理。

（2）基金托管人应按国家规定和基金管理人要求对托管资产中的证券账户和现金账户进行帐实核对。

（3）基金管理人有权委托第三方独立机构进行会计核算，并认可其委托的第三方独立机构所计算的基金资产净值，基金托管人对基金管理人认可的第三方独立机构所计算的资产净值进行复核。

## 2、基金托管人的会计核算处理

（1）在遵守相关会计法律法规的前提下，基金托管人应按基金管理人和基金托管人协商确定的会计核算方法和处理原则进行会计核算，并对基金单独建账、独立核算，并应指定专门人员负责会计核算与会计资料保管。属于基金财产的收益应全额计入会计账簿，不得与其他托管资产的收益相混淆。

（2）托管资产核算的内容包括但不限于：证券买卖业务的核算、持有资产的付息、兑付、分红等业务的核算、证券发行认购业务的核算、货币市场产品买卖业务的核算、银行存款计息、存款账户间的资金划付业务的核算、支付费用的核算、汇兑损益的核算等。

## 3、净值计算

（1）资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。本基金分级运作期内，基金管理人按照《基金合同》约定分别计算基金份额参考净值、嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 的基金份额净值。本基金在《基金合同》生效后 2 年期届满，基金管理人将按照基金合同约定把本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，并对嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类与 C2 类单独进行基金份额净值计算。份额净值是指资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

（2）基金资产净值的计算日为每一基金估值日，基金管理人和基金托管人在收集净值计算日估值价格截止时点所估值证券的最近市场价格后，按基金管理人和基金托管人双方协商确定的估值方法和处理原则对各类估值资产进行估值，如监管有相关规定的，按相关规定进行估值，计算出基金资产净值及基金份额净值、基金份额参考净值，并按规定公告。

## B. 基金份额净值错误的处理方式

基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后 3 位。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。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、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的行为造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失，基金管理人可选择先行承担，对不应由其承担的责任，有权向差错责任人追偿。本协议的当事人应将按照以下约定处理。

（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，如果因基金管理人违反基金合同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，如果因基金托管人违反基金合同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》或其它规定，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差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）由于证券交易所、交易市场及登记结算公司及数据供应商发送的数据错误，券商或交易对家的成交回报错误或延误，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人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。

（8）按法律法规规定的其它原则处理差错。

## 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，需要修改基金登记机构的交易数据的，由基金登记机构进行更正，基金管理人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基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在两日内公告并报中国证监会备案。

#### C. 暂停估值的情形

（1）基金投资所涉及的主要证券交易场所或市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

（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）出现会导致基金管理人不能出售或无法评估基金资产的紧急情况；

（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）《基金合同》规定的其他情形；

（6）监管机构认定的其他情形。

#### D. 特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按《基金合同》规定估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（3）全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在基金管理人和基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

（4）对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

#### E. 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算，基金托管人对本基金的基金资产净值计算进行复核。基金托管人和基金管理人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金管理人应

向基金托管人提供基金托管人进行本基金的净值计算复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行记录的账册记录相符。

#### F. 基金法定报告的编制和复核

基金托管人需根据相关法律法规的规定向监管机构报告相关信息，包括但不限于以下内容：

- （1）自开设境外结算账户之日起5日内，将有关账户的详情报告外管局；
  - （2）每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关监管规定进行国际收支申报；
  - （3）发现基金管理人投资指令或资金汇出违法、违规的，及时向中国证监会或外管局报告；
  - （4）中国证监会和国家外管局规定的其他报告事项；
- 对于基金托管人提供上述报告，基金管理人应予以支持和配合。

#### G. 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度和准则执行。

#### H. 基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整。

##### 3、财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在上半年结束之日起二个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期中期报告或者年度报告。

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

#### （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益登记日、嘉实新兴市场 A 的开放日、嘉实新兴市场 B 封闭期届满日、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登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额，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。保管期限为法律法规规定的期限。

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益登记日、嘉实新兴市场 A 的开放日、嘉实新兴市场 B 封闭期届满日、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后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、《基金合同》和本协议另有规定外，基金管理人或基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金管理人或基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行《基金合同》和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。基金管理人或基金托管人未能妥善保存基金份额持有人名册，造成基金份额持有人名册毁损、灭失，或向第三方泄露了基金份额持有人信息的，基金管理人或基金托管人应对此承担法律责任，赔偿基金份额持有人和基金托管人（或基金管理人）遭受的全部直接损失。

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

A. 本托管协议适用中华人民共和国法律并依照其解释。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，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会在北京仲裁，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

B. 当任何争议发生或任何争议正在进行仲裁时，除争议事项外，双方仍有权行使本协议项下的其它权利并应履行本协议项下的其它义务。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

#### A. 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以书面形式对本协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。托管协议的修改和变更应报送中国证监会核准或备案。

#### B. 托管协议的终止

发生以下任一情况，本协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金管理人或基金托管人职责终止；
- 3、中国证监会规定的其他终止情形

#### C. 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、具有证券、期货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）基金财产清算小组成立后，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）将基金清算结果报告中国证监会并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

#### D. 清算费用

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

#### E. 基金财产清算剩余资产的分配

本基金分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足嘉实新兴市场 A 份额的本金及约定收益，剩余部分（如有）由嘉实新兴市场 B 份额的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人将本基金按照基金合同约定转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，如果发生基金财产清算的情形，则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。

#### F. 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具有证券、期货相关业务资格的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财产清算报告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。

#### G. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

H. 本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的，本基金财产应清理、估价，但可根据届时有效的相关规定，基金财产不予变现和分配。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项参照前述约定执行。

## 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

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）定期定额投资计划

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

### （三）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查询。

#### 2、信息资讯服务

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

#### 3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基金管理人网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn) 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

### （四）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）、（010）85712266，传真：（010）65215577。

#### 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             |
|----|-------------------------------------------------------------|------------------|
| 1  | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 5 月 19 日暂停申购、赎回及定投业务的公告            | 2021 年 5 月 17 日  |
| 2  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                        | 2021 年 5 月 29 日  |
| 3  | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定投业务的公告             | 2021 年 6 月 29 日  |
| 4  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                        | 2021 年 7 月 23 日  |
| 5  | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 9 月 22 日暂停申购、赎回及定投业务的公告            | 2021 年 9 月 16 日  |
| 6  | 嘉实基金管理有限公司关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告                    | 2021 年 9 月 28 日  |
| 7  | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 10 月 14 日暂停申购、赎回及定投业务的公告           | 2021 年 10 月 12 日 |
| 8  | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 10 月 13 日暂停申购、赎回及定投业务的公告           | 2021 年 10 月 14 日 |
| 9  | 嘉实基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告                 | 2021 年 11 月 16 日 |
| 10 | 嘉实基金管理有限公司关于对中信银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告                      | 2021 年 12 月 3 日  |
| 11 | 嘉实基金管理有限公司关于对中国邮政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告                  | 2021 年 12 月 3 日  |
| 12 | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 12 月 24 日、12 月 27 日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 2021 年 12 月 22 日 |
| 13 | 嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息公告                               | 2021 年 12 月 24 日 |
| 14 | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日暂停申购、赎回及定投业务的公告           | 2021 年 12 月 29 日 |
| 15 | 关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2022 年 4 月 15 日、4 月 18 日暂停申购、赎回及定投业务的公告   | 2022 年 4 月 13 日  |



## 二十七、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，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新兴市场双币分级债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《嘉实新兴市场债券型证券投资基金托管协议》；
- 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、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  
2023 年 1 月 18 日