

# 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资 基金更新招募说明书

(2026年06月13日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2013 年 7 月 12 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]921 号）核准公开发售，本基金基金合同于 2014 年 6 月 20 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，若本基金投资存托凭证的，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

本基金标的指数为中证金融地产指数。

（1）指数样本空间

中证 800 指数样本

（2）选样方法

将样本空间内证券按照中证行业分类进行分类，进入各自行业的全部证券作为相应行业指数的样本。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

投资者投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用本基金标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用本基金标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、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，也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2026 年 5 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 3 月 31 日（未经审计），特别事项注明除外。

## 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	11
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集.....	40
七、基金合同的生效.....	46
八、基金份额的交易.....	47
九、基金份额的申购与赎回.....	49
十、基金的投资.....	60
十一、基金的业绩.....	73
十二、基金的财产.....	75
十三、基金资产的估值.....	76
十四、基金的收益与分配.....	80
十五、基金的费用与税收.....	81
十六、基金的会计与审计.....	83
十七、基金的信息披露.....	84
十八、风险揭示.....	88
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	93
二十、基金合同的内容摘要.....	95
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	108
二十二、对基金份额持有人的服务.....	118
二十三、其他应披露事项.....	119
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	120
二十五、备查文件.....	121

## 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5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处,均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语或简称有如下含义:

基金或本基金	指嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金;
基金合同	指《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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;
招募说明书或本招募说明书	指《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新;
基金份额发售公告	指《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》;
托管协议	指《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
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);
中国证监会	指中国证券监督管理委员会;
《基金法》	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《销售办法》	指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《运作办法》	指2004年6月29日由中国证监会公布,于2004年7月1日起实施并于2014年7月7日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订;
《信息披露办法》	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基

	金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《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；
业务规则	指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》及其不时修订的版本、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订的版本，以及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布及其不时修订的其他相关规则和规定；
交易型开放式指数证券投资基金	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”；
ETF 联接基金	指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金；
元	指人民币元；
基金管理人	指嘉实基金管理有限公司；
基金托管人	指中国银行股份有限公司；
登记结算业务	指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订以及相关业务规则所定义的基金份额的登记、存管和结算和相关业务；

登记结算机构	指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司；
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；
个人投资者	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者	指依法可以投资证券投资基金的、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；
合格境外机构投资者	指符合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；
基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人；
基金募集期	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；
基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期；
基金合同终止日	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；
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日	指上海证券交易所的正常交易日；
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；

申购	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为；
赎回	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件，要求将基金份额兑换为基金合同和招募说明书约定的赎回对价的行为；
申购赎回清单	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价	指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价；
赎回对价	指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回申请人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价；
标的指数	指中证指数有限公司编制并发布的中证金融地产指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数；
组合证券	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
最小申购赎回单位	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍；
现金替代	指申购或赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
现金差额	指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最

	小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
预估现金部分	指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金部分由申购赎回代理券商（代办证券公司）预先冻结；
非直销销售机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金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，包括发售代理机构和申购赎回代理券商；
销售机构	指直销机构和非直销销售机构；
基金销售网点	指直销机构的直销中心及非直销销售机构的销售网点；
发售代理机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；
申购赎回代理券商	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司；
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；
开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日；
T 日	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；
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）；
收益评价日	指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数同期增长率差额之日；

基金净值增长率	指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
标的指数同期增长率	指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
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；
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数；
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
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；
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；
基金产品资料概要	指《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、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	罗朝伟

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立。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、总经理及其他高级管理人员基本情况

安国勇先生，董事长，博士研究生，中共党员。曾任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，中诚信托有限责任公司党委书记、总裁。

王会妙女士，董事，北京大学经济学博士。曾就职于河北定州师范学院、国投信托有限责任公司。2011年5月加入中诚信托有限责任公司，曾任信托业务总部业务团队负责人（MD）、信托业务三部总经理、财富管理中心副总经理、资产配置部总经理、中诚资本管理（北京）有限公司总经理等职，现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁。

Stefan Hoops先生，董事，德国籍，毕业于德国拜罗伊特大学（University of Bayreuth），获得工商管理学位及经济学博士学位。2003年加入Deutsche Bank AG（德意志银行）并担任过债券销售负责人、融资与解决方案负责人、全球市场部负责人、全球交易银行部负责人、企业银行业务全球负责人等多个职务。现任DWS Group GmbH & Co. KGaA首席执行官、总裁部负责人、投资部联席负责人。

王静雯女士，董事，毕业于明尼苏达大学（University of Minnesota），获得数学与精算硕士学位。曾于安永会计师事务所（ERNST & YOUNG）担任精算咨询集团高级顾问；于美世集团（MERCER）担任首席咨询顾问，退休、风险和金融业务的合伙人兼亚洲主管；于花旗集团（CITIGROUP）担任董事总经理兼亚太区养老金、全球市场与证券服务主管；于东方汇理香港公司（Amundi Hong Kong Limited）担任董事总经理兼北亚机构业务主管；于东方汇理美国（Amundi US）担任资深董事总经理兼美国机构业务主管。于2021年9月加入德意志投资香港有限公司（DWS Investments Hong Kong Limited）担任DWS Group董事总经理兼亚太区客户主管，现任DWS Group GmbH & Co KGaA 亚太区负责人及亚太区客户部负责人，德意志投资香港有限公司（DWS Investments Hong Kong Limited）董事会主席兼董事。

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，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。现兼任神州数码信息服务股份有限公司独立董事、北京首创生态环保集团股份有限公司独立董事、美年大健康产业控股股份有限公司独立董事。

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主任、清华大学全球私募股权研究院副院长。曾兼任中国证监会第一、二届并购重组审核委员会委员，中国上市公司协会第一、二届独立董事委员会主任委员、上海证券交易所第四、五届上市委员会委员。现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、深圳证券交易所法律专业咨询委员会委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员、中国上市公司协会学术顾问委员会委员、银行间市场交易商协会法律专业委员会委员。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，现任明石创新技术集团股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。现兼任重庆国际信托股份有限公司独立董事、中国人寿养老保险股份有限公司独立董事、深圳光韵达光电科技股份有限公司独立董事、赞同科技股份有限公司独立董事、爱美客技术发展股份有限公司董事。

类承曜先生，独立董事，中共党员，中国人民大学财政金融学院财政系专业毕业，经济学博士。现任中国人民大学财政金融学院金融学教授、博士生导师、中债研究所所长，兼任International Journal of Innovation and Entrepreneurship中方副主编、《投

资研究》编委会委员等职。2020年受聘为财政部财政风险研究专家工作室专家。现兼任余姚农商行独立董事。

雷霆先生，董事，总经理，财务负责人，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）。1998年6月至2008年5月在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部从事研究投资工作；2008年5月至2013年9月，历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人；2013年10月入职嘉实基金管理有限公司，2013年10月至2018年3月任机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月至今任嘉实基金管理有限公司总经理；2018年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、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，立信投资有限公司财务总监。现任立信投资有限公司监事。

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，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监兼董事会办公室主任。

马莲女士，监事，法学博士，中共党员。曾任北京市竞天公诚律师事务所律师，法国基德律师事务所北京代表处法律顾问，北京天驰律师事务所律师、合伙人。2013年9月加入嘉实资本管理有限公司，历任法律合规总监、首席风控官。2020年6月至2025年7月任嘉实财富管理有限公司副总经理、风控合规负责人。现任嘉实基金管理有限公司审计部总监。

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

程剑先生，副总经理，硕士研究生。2006年7月至2022年4月，历任海通证券股份有限公司固定收益部业务员、研究策略部经理及固定收益部总经理助理、副总经理。2022年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司副总经理、机构业务联席首席投资官兼启航解决方案战队负责人。

姚志鹏先生，副总经理，硕士研究生。2011年加入嘉实基金管理有限公司，曾任股票研究部研究员、基金经理、成长风格投资总监兼权益投资部总监，现任公司副总经理。

鲁令飞先生，副总经理，硕士研究生。2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，历任机构业务部机构销售、保险业务部总监、机构销售业务板块负责人，现任公司副总经理、首席市场官。

张敏女士，副总经理，博士研究生。2010年3月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部副总监、总监、首席风险官，现任公司副总经理、养老首席投资官。

刘伟先生，首席信息官，硕士研究生。2010年4月加入嘉实基金管理有限公司，历任信息技术部高级软件工程师、C-Lab科技总监、数字业务部总监，现任公司首席信息官。

## 2、投资总监

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。

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

张钟玉女士，硕士研究生，16年证券从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。曾任大成基金管理有限公司研究员、数量分析师、基金经理。2021年9月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部。2015年2月28日至2021年9月2日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理，2019年2月28日至2021年9月2日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年2月28日至2021年9月2日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金联

接基金基金经理。2022年1月25日至2022年12月26日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年1月27日至2022年9月20日任嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年5月18日至2026年3月12日任嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年11月24日至2024年1月11日任嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年12月29日至2025年2月14日任嘉实中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2023年4月12日至2024年9月13日任嘉实恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2022年1月25日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2022年1月27日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年1月27日至今任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2022年4月13日至今任嘉实上海金交易型开放式证券投资基金基金经理、2022年9月15日至今任嘉实纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理、2022年10月20日至今任嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、2023年3月2日至今任嘉实上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理、2023年4月12日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2023年4月27日至今任嘉实国证通信交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2023年5月31日至今任嘉实纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2023年9月11日至今任嘉实国证通信交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、2023年11月2日至今任嘉实标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2023年12月26日至今任嘉实标普生物科技精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2024年4月3日至今任嘉实德国DAX交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2025年7月17日至今任嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

## （2）历任基金经理

何如女士，管理时间为2014年6月20日至2019年9月28日；刘珈吟女士，管理时间为2016年3月24日至2022年1月27日；李直先生，管理时间为2019年9月28日至2021年9月24日。

## 4、指数与量化投资决策委员会

指数与量化投资决策委员会的成员包括：指数与量化投资首席投资官刘斌先生，公司总经理经雷先生，指数投资总监刘珈吟女士，股票研究部总监刘杰先生，风险管理部总监武雪冬先生，指数基金经理李直先生。

5、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、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、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、赎回对价，编制申购赎回清单；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

- 1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。
- 2、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反法律法规行为的发生。
- 3、本基金管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将基金财产用于下列投资或活动：
  - （1）承销证券；
  - （2）向他人贷款或者提供担保；
  - （3）从事承担无限责任的投资；
  - （4）买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
  - （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
  - （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
  - （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
  - （8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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

#### 5、基金经理承诺

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

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

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

（4）不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人内部控制制度

##### 1. 内部控制制度概述

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

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、合规管理、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、岗位责任、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。董事会下设合规与风险控制委员会，督促公司经理层履行职责建立有效的财务控制、内部控制的系统及制度，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，由总经理、投资总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

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

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

（5）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财产的状况。

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

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

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

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

(12) 公司建立健全内控制度，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。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行资产托管部设立于1998年，现有员工130余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至2026年3月31日，中国银行已托管1219只证券投资基金，其中境内基金1150只，QDII基金69只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务风险管理与内部控制纳入中国银行全面风险管理体系。资产托管部作为一道防线部门，承担托管业务风险控制的第一责任；风险管理部门作为第二道防线部门，承担制定风险管理制度和流程，监测和管理风险的责任，对托管业务进行指导、培训、监督检查；审计部门作为第三道防线，负责开展托管业务审计工作，发现问题，揭示风险，提出审计建议。中国银行托管业务风险控制贯穿业务各环节，通过制度建设与执行、风险与控制评估、内外部检查及审计监督等措施，持续完善托管业务全员、全面、全程的风险管理体系。

2007年起，中国银行开始聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作，已连续多年获得基于“ISAE3402”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的内控鉴证报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代办券商

##### （1）国泰海通证券股份有限公司

住所	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
办公地址	上海市静安区南京西路 768 号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
法定代表人	朱健	联系人	黄博铭
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	www.gtht.com	客服电话	95521

##### （2）中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区光华路 10 号		
注册地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
法定代表人	刘成	联系人	谢欣然
电话	010-86451810		
网址	http://www.csc108.com	客服电话	(8610)65608107

##### （3）国信证券股份有限公司

住所	广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
办公地址	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦		
注册地址	广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	张纳沙	联系人	李颖
电话	0755-81682519		
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

##### （4）招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
法定代表人	霍达	联系人	业清扬

电话	0755-82943666	传真	0755-83734343
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	95565

## (5) 广发证券股份有限公司

住所	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室		
办公地址	广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦		
注册地址	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室		
法定代表人	林传辉	联系人	陈姗姗
电话	(020) 66338888		
网址	http://www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

## (6) 中信证券股份有限公司

住所	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座		
办公地址	广东省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		
注册地址	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座		
法定代表人	张佑君	联系人	王一通
电话	010-60838888		
网址	http://www.citics.com	客服电话	95548

## (7) 中国银河证券股份有限公司

住所	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101		
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		
注册地址	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101		
法定代表人	王晟	联系人	辛国政
网址	https://www.chinastock.com.cn	客服电话	4008-888-888 或 95551

## (8) 海通证券股份有限公司

住所	上海市黄浦区广东路689号		
办公地址	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场		
注册地址	上海市黄浦区广东路689号		
法定代表人	李军(代)	联系人	张家瑞
电话	021-23185429	传真	021-63809892

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

## (9) 申万宏源证券有限公司

住所、办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
法定代表人	张剑	联系人	王昊洋
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

## (10) 兴业证券股份有限公司

住所、办公地址	福建省福州市湖东路 268 号		
注册地址	福建省福州市湖东路 268 号		
法定代表人	苏军良	联系人	乔琳雪
电话	021-38565547		
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

## (11) 长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号		
注册地址	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号		
法定代表人	刘正斌	联系人	奚博宇
电话	027-65799999	传真	027-85481900
网址	http://www.95579.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

## (12) 国投证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦		
法定代表人	王苏望	联系人	彭洁联
电话	0755-81682531		
网址	www.sdicsc.com.cn	客服电话	95517

## (13) 西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼		
注册地址	重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼		
法定代表人	姜栋林	联系人	冉绪

电话	023-63786145		
网址	http://www.swsc.com.cn	客服电话	95355

## (14) 湘财证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
法定代表人	高振营	联系人	江恩前
电话	(021)38784580		
网址	http://www.xcsc.com	客服电话	95351

## (15) 民生证券股份有限公司

住所、办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号		
法定代表人	顾伟	联系人	刘玥/曹宇鑫
电话	021-80508592/021-80508504		
网址	http://www.msza.com	客服电话	021-80508866;021-80508332

## (16) 渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区滨水西道8号		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	安志勇	联系人	王星
电话	022-28451922		
网址	http://www.ewww.com.cn/	客服电话	956066

## (17) 华泰证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省南京市江东中路228号华泰证券广场		
注册地址	江苏省南京市江东中路228号华泰证券广场		
法定代表人	王会清	联系人	郭力铭
电话	18936886079		
网址	http://www.htsc.com.cn/	客服电话	95597

## (18) 山西证券股份有限公司

住所、办公地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
注册地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	王怡里	联系人	郭熠
电话	(0351) 8686659	传真	(0351) 8686619
网址	http://www.sxzq.net/shouye/index.shtml	客服电话	95573

## (19) 中信证券（山东）有限责任公司

住所	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
办公地址	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座		
注册地址	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
法定代表人	肖海峰	联系人	赵如意
电话	0532-85725062		
网址	http://sd.citics.com	客服电话	95548

## (20) 东吴证券股份有限公司

住所	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号		
办公地址	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦		
注册地址	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号		
法定代表人	范力	联系人	陆晓
电话	0512-52938521	传真	0512-62938527
网址	http://www.dwzq.com.cn	客服电话	95330

## (21) 信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
注册地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
法定代表人	林志忠	联系人	付婷
网址	http://www.cindasc.com/	客服电话	95321

## (22) 东方证券股份有限公司

住所	上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦		
----	------------------------	--	--

办公地址	中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层、12 层、13 层、22 层、25-27 层、29 层、32 层、36 层、38 层		
注册地址	上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦		
法定代表人	鲁伟铭(代)	联系人	龚玉君、闻鑫
网址	http://www.dfzq.com.cn	客服电话	021-6332 5888

## (23) 方正证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717		
办公地址	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 17 层		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
网址	http://www.foundersc.com	客服电话	95571

## (24) 长城证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
注册地址	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
法定代表人	王军	联系人	陈静
电话	0755-8355761		
网址	http://www.cgws.com/cczq	客服电话	95514

## (25) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
注册地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	刘秋明	联系人	郁疆
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	95525

## (26) 中信证券华南股份有限公司

住所、办公地址	广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室		
注册地址	广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室		
法定代表人	陈可可	联系人	郭杏燕

电话	020-88834787		
网址	http://www.gzs.co m.cn	客服电话	95548

## (27) 东北证券股份有限公司

住所	吉林省长春市生态大街 6666 号		
办公地址	长春市生态大街 6666 号		
注册地址	吉林省长春市生态大街 6666 号		
法定代表人	李福春	联系人	安岩岩
电话	021-20361166		
网址	http://www.nesc.c n	客服电话	95360

## (28) 上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市黄浦区人民路 366 号		
注册地址	上海市黄浦区人民路 366 号		
法定代表人	李海超	联系人	邵珍珍
电话	(021) 53686888	传真	(021) 53686100- 7008
网址	http://www.shzq.c om	客服电话	4008918918

## (29) 诚通证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层		
注册地址	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层		
法定代表人	张威	联系人	廖晓
电话	010-83561321		
网址	www.cctgsc.com.cn	客服电话	95399

## (30) 大同证券有限责任公司

住所	山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
办公地址	山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层		
注册地址	山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
法定代表人	董祥	联系人	纪肖峰
电话	0351-7219280	传真	0351-4137986
网址	http://www.dtsbc. com.cn	客服电话	4007121212

## (31) 国联民生证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省无锡市金融一街8号		
注册地址	江苏省无锡市金融一街8号		
法定代表人	顾伟	联系人	庞芝慧
电话	15006172037		
网址	http://www.glms.com.cn	客服电话	95570

## (32) 浙商证券股份有限公司

住所、办公地址	浙江省杭州市五星路201号		
注册地址	浙江省杭州市五星路201号		
法定代表人	钱文海	联系人	许嘉行
电话	(0571) 87901912	传真	(0571) 87901913
网址	http://www.stocke.com.cn	客服电话	95345

## (33) 平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层		
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座22-25层		
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层		
法定代表人	何之江	联系人	尹杭婷
传真	021-58991896		
网址	http://www.stock.pingan.com	客服电话	95511-8

## (34) 国海证券股份有限公司

住所	广西壮族自治区桂林市辅星路13号		
办公地址	广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦		
注册地址	广西壮族自治区桂林市辅星路13号		
法定代表人	王海河	联系人	李健
电话	0755-88313842		
网址	http://www.ghzq.com.cn	客服电话	0771-95563

## (35) 东莞证券股份有限公司

住所	广东省东莞市莞城区可园南路1号		
办公地址	广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
注册地址	广东省东莞市莞城区可园南路1号		
法定代表人	潘海标	联系人	梁微
电话	0769-22115712		
网址	http://www.dgzq.com.cn/	客服电话	95328

## (36) 中原证券股份有限公司

住所、办公地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号		
注册地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	张秋云	联系人	李盼盼
电话	0371--69099882		
网址	http://www.ccnew.com	客服电话	95377

## (37) 国都证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
注册地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	钱文海	联系人	张晖
电话	010-87413731		
网址	http://www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

## (38) 东海证券股份有限公司

住所	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
办公地址	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦		
注册地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	王文卓	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	021-50498825
网址	http://www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-8888-588

## (39) 金融街证券股份有限公司

住所	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼		
----	--------------------------------	--	--

办公地址	中国内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼		
注册地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼		
法定代表人	祝艳辉	联系人	熊丽、王捷勋
电话	0471-4972675		
网址	http://www.jrjzq.com.cn	客服电话	956088

## (40) 国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市新建区子实路 1589 号		
办公地址	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼		
注册地址	江西省南昌市新建区子实路 1589 号		
法定代表人	刘朝东	联系人	占文驰
电话	0791-88250812		
网址	https://www.gsyzq.com/	客服电话	956080

## (41) 华西证券股份有限公司

住所、办公地址	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦		
注册地址	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦		
法定代表人	杨炯洋	联系人	赵静静
电话	010-58124967		
网址	http://www.hx168.com.cn	客服电话	028-86150207

## (42) 申万宏源西部证券有限公司

住所、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		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
法定代表人	王献军	联系人	王昊洋
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

## (43) 中泰证券股份有限公司

住所	山东省济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼		
办公地址	济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼		
注册地址	山东省济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼		
法定代表人	王洪	联系人	张峰源
电话	021-20315719		
网址	http://www.zts.co m.cn	客服电话	95538

## (44) 第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
注册地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
法定代表人	吴礼顺	联系人	王雯
电话	0755-23838752		
网址	http://www.firstc apital.com.cn	客服电话	95358

## (45) 金元证券股份有限公司

住所、办公地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
注册地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
法定代表人	陆涛	联系人	唐乙丹
网址	http://www.jyzq.c n	客服电话	400-8888-228

## (46) 中航证券有限公司

住所	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层		
办公地址	北京市朝阳区望京东园四区2号中航产融大厦35层		
注册地址	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层		
法定代表人	戚侠	联系人	孙健
网址	http://avicsec.co m/main/home/index .shtml	客服电话	95335

## (47) 德邦证券股份有限公司

住所	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼		
办公地址	上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S2幢22楼		

注册地址	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼		
法定代表人	梁雷	联系人	张卉娟
电话	(021) 68761616		
网址	http://www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

## (48) 华福证券有限责任公司

住所	福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层		
办公地址	福州市台江区江滨中大道380号宝地广场18-19层		
注册地址	福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层		
法定代表人	黄德良	联系人	林秋红
网址	http://www.hfzq.com.cn	客服电话	95547

## (49) 华龙证券股份有限公司

住所	甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼		
办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心19楼		
注册地址	甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼		
法定代表人	王锡真	联系人	周鑫
电话	0931-4890208		
网址	http://www.hlzq.com/	客服电话	95368

## (50) 中国国际金融股份有限公司

住所、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		
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层		
法定代表人	陈亮	联系人	中金公司股票业务部
传真	010-65058065		
网址	http://www.cicc.com.cn	客服电话	4008209068

## (51) 财通证券股份有限公司

住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼		
注册地址	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼		
法定代表人	章启诚	联系人	严泽文

网址	http://www.ctsec.com	客服电话	95336
----	----------------------	------	-------

## (52) 甬兴证券有限公司

住所	浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层		
办公地址	上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 31、32 层		
注册地址	浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层		
法定代表人	李抱	联系人	苏晓杰
电话	13917829777		
网址	https://www.yongxingsec.com	客服电话	400-916-0666

## (53) 华鑫证券有限责任公司

住所	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A		
办公地址	上海市徐汇区云锦路 277 号西岸数字股二期 T3		
注册地址	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A		
法定代表人	俞洋	联系人	刘熠
电话	021-64339000		
网址	http://www.cfsc.com.cn	客服电话	95323, 4001099918 (全国)

## (54) 瑞银证券有限责任公司

住所	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12、15 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
法定代表人	陈安	联系人	牟冲
电话	(010) 58328112	传真	(010) 58328748
网址	http://www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

## (55) 中国中金财富证券有限公司

住所	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608		
办公地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 20 层		

注册地址	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608		
法定代表人	王建力	联系人	陈梓基
网址	https://www.ciccw m.com/ciccwweb/	客服电话	95532

## (56) 东方财富证券股份有限公司

住所	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼		
办公地址	上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦		
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼		
法定代表人	戴彦	联系人	陈亚男
电话	021-23586583	传真	021-23586789
网址	http://www.18.cn	客服电话	95357

## (57) 江海证券有限公司

住所	哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
办公地址	哈尔滨市松北区创新三路 833 号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	赵洪波	联系人	周俊
网址	http://www.jhzq.c om.cn/	客服电话	956007

## (58) 华源证券股份有限公司

住所	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号		
办公地址	武汉市江汉区青年路 278 号中海中心 32F-34F		
注册地址	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号		
法定代表人	邓晖	联系人	陈涛
电话	15618903281	传真	010-57672020
网址	http://www.huayua nstock.com	客服电话	95305

## (59) 国金证券股份有限公司

住所	成都市青羊区东城根上街 95 号		
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1088 号 7 楼		
注册地址	成都市青羊区东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	郭元媛
电话	15690849268		

网址	<a href="http://www.gjqzq.com.cn">http://www.gjqzq.com.cn</a>	客服电话	95310
----	---	------	-------

## (60) 华宝证券股份有限公司

住所、办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层		
法定代表人	刘加海	联系人	夏元
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	<a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a>	客服电话	4008209898

## (61) 爱建证券有限责任公司

住所	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
办公地址	上海市浦东新区前滩大道 199 弄 5 号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
法定代表人	江伟	联系人	赵婧玥
电话	021-32229888-25129		
网址	<a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>	客服电话	4001962502

## (62) 国新证券股份有限公司

住所	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室		
办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号		
注册地址	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室		
法定代表人	张海文	联系人	孙燕波
电话	010-85556048	传真	010-85556088
网址	<a href="https://crhcweb.rsec.com.cn/">https://crhcweb.rsec.com.cn/</a>	客服电话	400-898-4999

## (63) 财达证券股份有限公司

住所、办公地址	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦		
注册地址	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦		
法定代表人	张明	联系人	高晨婧
电话	0311-86273151		
网址	<a href="https://www.95363.com/">https://www.95363.com/</a>	客服电话	河北省内:95363;河北省外:0311-95363

## (64) 万和证券股份有限公司

住所	海口市南沙路 49 号通信广场二楼		
办公地址	深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 层西厅		
注册地址	海口市南沙路 49 号通信广场二楼		
法定代表人	甘卫斌	联系人	张雷
电话	0755-82830333	传真	0755-25170093
网址	http://www.vanho. cn/	客服电话	4008-882-882

## (65) 首创证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层		
注册地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层		
法定代表人	张涛	联系人	梁健
网址	http://www.sczq.c om.cn/	客服电话	95381

## (66) 开源证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层		
注册地址	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层		
法定代表人	李刚	联系人	张蕊
传真	029-88365835		
网址	http://www.kysec. cn	客服电话	95325

## (67) 华金证券股份有限公司

住所	上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室		
办公地址	上海市浦东新区杨高南路 759 号 27 层（陆家嘴世纪金融广场 2 号楼）		
注册地址	上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室		
法定代表人	燕文波	联系人	秦臻
电话	021-20655438	传真	021-20655438
网址	http://www.huajin sc.cn	客服电话	956011

## (68) 联储证券股份有限公司

住所	山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层		
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层		
注册地址	山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层		

法定代表人	张强	联系人	陈茜
电话	010-86499838	传真	010-86499401
网址	http://www.lczq.com/	客服电话	021-80295794;0755-36991988

## 2、二级市场交易代办证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司。

### （二） 登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号		
法定代表人	于文强		
联系人	赵亦清		
电话	(010) 50938782		
传真	(010) 50938991		

### （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	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	(021) 51150298	传真	(021) 51150398
经办律师	廖海、刘佳		

### （四） 审计基金财产的会计师事务所

名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
办公地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
执行事务合伙人	唐恋炯	联系人	郭新华
电话	+86 (21) 6141 8888	传真	+86 (21) 6335 0003
经办注册会计师	汪芳、姜金玲		

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的相关规定、并经中国证券监督管理委员会 2013 年 7 月 12 日《关于核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]921 号）核准募集。

### （一）基金运作方式和类型

- 1、基金的类别：股票型
- 2、基金的运作方式：交易型开放式

### （二）基金存续期

不定期

### （三）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象

1、募集期限：本基金自 2014 年 5 月 19 日至 2014 年 6 月 6 日通过本公司的直销中心和非直销销售机构的网点公开发售。

2、募集方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的具体安排详见招募说明书的相关规定。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。

#### 3、募集场所：

投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增加、减少或调整基金的发售代理机构，并另行公告。发售代理机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

4、募集对象：符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### (四) 募集目标

本基金不设定发售规模上限。

#### (五) 基金的认购份额面值、认购价格

本基金每份基金份额初始面值为 1.00 元，按初始面值发售。

#### (六) 认购程序

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金的基金份额发售公告。

#### (七) 认购费用

认购费用由投资者承担，不高于 0.8%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
M < 50万份	0.8%
50万份 ≤ M < 100万份	0.5%
M ≥ 100万份	按笔收取，1000元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

#### (八) 网上现金认购

1、认购时间：2014年6月4日至2014年6月6日。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认

购手续。

#### 4、认购佣金和认购金额的计算

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

5、清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

### (九)网下现金认购

1、认购时间：2014年5月19日至2014年6月6日。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍，投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购申请一经受理不得撤销，投资者在认购本基金时，需按基金管理人的规定办理相关认购手续，并备足认购资金，认购金额和利息折算的份额的计算公式为：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购价格 × 认购份额 × 认购费率

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于T+2日内进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。现金认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金

认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

#### (十)网下股票认购

1、认购时间：2014年5月19日至2014年6月6日。

2、认购限额：

网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是其所认购基金的标的指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：

投资者在认购基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。

4、特别提示：投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

5、特殊情形

(1) 已公告的将被调出本基金标的指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据市场情况、个股价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少2日公告限制认购规模的个股名单。对于在认购期间停牌的个股，认购规模上限不得超过该个股占标的指数权重所对应的认购规模的2倍。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

6、清算交收：

T日日终（T日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海

市场和深圳市场的股票过户至本基金的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

7、认购份额的计算公式：

投资者的认购份额 =  $\sum_{i=1}^n$  （第*i*只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00

其中，

（1）*i*代表投资者提交认购申请的第*i*只股票，如投资者仅提交了1只股票的申请，则*i*=1。

（2）“第*i*只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

①除息：调整后价格 = T日均价 - 每股现金股利或股息

②送股：调整后价格 = T日均价 / (1 + 每股送股比例)

③配股：调整后价格 = (T日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股配股比例)

④送股且配股：调整后价格 = (T日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

⑤除息且送股：调整后价格 = (T日均价 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例)

⑥除息且配股：调整后价格 = (T日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股配股比例)

⑦除息、送股且配股：调整后价格 = (T日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构进行清算交收的股票股数。有效认购数量的具体确认原则和方法，基金管理人可另行公告。若某一股票在股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

（十一）募集资金利息与募集股票权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以基金管理人的记录为准。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产。投资者的认购股票在股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间的权益归投资者所有。

## （十二）募集期间的费用

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2014 年 6 月 20 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。

## 八、基金份额的交易

### （一）基金份额的上市

本基金于 2014 年 7 月 25 日在上海证券交易所上市交易，场内简称：金融地产，扩位证券简称：金融地产 ETF 嘉实，基金代码：512640。

### （二）基金份额的上市交易

基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

基金管理人可按照监管机关及/或上海证券交易所的规定，经与基金托管人协商一致后，增加本基金的分级份额，将本基金变更为份额分级的交易型开放式指数证券投资基金。基金管理人为实施前述变更应事先报请监管机关并公告相应的分级安排，但不必召开基金份额持有人大会审议批准。

### （三）IOPV 的计算

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

#### 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

### （四）基金份额的终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金份额的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市开放式指数基金，且因上述 1、4、5 项之一情形终止上市的，无需召开基金份额持有人大会。届时，基金管理人可变更本基金的登记结算机构并相应调整申购赎回业务规则，同时，基金管理人将按照《信息披露办法》的规定公告相关基金合同及招募说明书。

（五）在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在其他证券交易所（含境外证券交易所）上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

（六）法律法规、监管部门和上海证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回业务。

基金管理人在开始办理申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

本基金自2014年7月25日起办理申购与赎回业务，具体办理时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回；具体申购、赎回业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。

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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回对价以下一开放日基金管理人公布的申购赎回清单为准。

### （三）申购和赎回的原则

1、基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

2、基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守业务规则的规定。

5、基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，或依据上海证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整，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。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

## 2、申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，即基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式；申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

基金管理人、上海证券交易所、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，基金管理人应于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### (五) 申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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。

目前，本基金最小申购、赎回单位为50万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购、赎回的对价、费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

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

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

#### （七）申购赎回清单的内容与格式

##### 1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

##### 2、组合证券相关内容

组合证券是指基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

##### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于上交所上市的成份股（“沪市成份证券”），现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于深交所上市的成份股（“深市成份证券”），可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不

允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于所有成份股。当可以现金替代适用于上交所上市的成份股时，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。当可以现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

## （2）可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：沪市成份证券和深市成份证券。

### 1) 对于沪市成份证券

①适用情形：投资者申购时持仓不足的成份证券。登记结算机构先使用成份证券，不足时差额部分使用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比例)

其中，“该证券参考价格”为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购

入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例 (\%)} = \frac{\sum_i \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}} \times 100\%$$

如果上海证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以上海证券交易所通知规定的为准。

## 2) 对于深市成份证券

①适用情形：适用于本基金标的指数中深交所股票。登记机构对设置可以现金替代的深市成份证券全部使用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比例)。

赎回的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 - 现金替代折价比例)。

其中，“该证券参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果交易所参考价格确定原则发生变化，以交易所通知规定的参考价格为准。

申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取

的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代折价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

### ③替代金额的处理程序

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续与被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本

（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后 T 日开盘参考价。

（4）基金管理人可根据运作情况调整代理申赎投资者买券卖券的相关规则并按规定公告。

（5）未来上海证券交易所、登记结算机构有关申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变等，基金管理人可对上述相关现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。

#### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

$T日预估现金部分 = T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中各可以现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和 + 申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和)$

其中，该证券调整后T日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

$T日现金差额 = T日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中各可以现金替代成份证券的数量与相应证券T日收盘价相乘之和 + 申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券T日收盘价相乘之和)$

T日投资者申购赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	XXXX-XX-XX

基金名称	嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	嘉实基金管理有限公司
基金代码	512640

T-1日 信息内容	
现金差额(单位：元)	
最小申购、赎回单位净值(单位：元)	
基金份额净值(单位：元)	

T日 信息内容	
最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位：元)	
现金替代比例上限	
当日累计可申购的基金份额上限	
当日累计可赎回的基金份额上限	
当日净申购的基金份额上限	
当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日净申购的基金份额上限	
单个证券账户当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可申购的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可赎回的基金份额上限	
是否需要公布 IOPV	
最小申购、赎回单位(单位：份)	
申购赎回的允许情况	
申购赎回模式	沪市成分证券实物对价

成份股信息内容							
证券代码	证券简称	股票数量(股)	现金替代标志	申购现金替代	赎回现金替代	替代金额(单)	挂牌市场

				溢价比 例	折价比 例	位：人 民币元)	

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

#### （八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购、赎回申请。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单。
- 5、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。
- 6、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 7、基金资产规模过大，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。
- 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记结算机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统或基金登记结算系统或基金会计系统无法正常运行。
- 9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施。
- 10、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（第 6 项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停申购、赎回时，基金管理人应在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### （九）其他申购赎回方式

1、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，无需召开基金份额持有人大会。场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

2、若本基金推出 ETF 联接基金，在本基金上市之前，ETF 联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

3、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

4、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

5、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

#### （十）基金的份额折算

基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算后，基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响，无需召开基金份额持有人大会。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

#### （十一）基金的非交易过户等其他业务的办理

基金登记结算机构可根据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并按照规定收取一定的手续费用。

（十二）基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。

### （二）投资范围

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票，衍生工具（权证、股指期货等），债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

### （三）投资策略

#### （一）投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

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

本基金投资于股指期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

### 1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2、投资管理体制

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

### 3、投资程序

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

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

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

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

（4）交易执行：中央交易部门负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

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

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

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

## （二）、投资组合管理

## 1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5) 其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

- (1) 确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。
- (2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。
- (3) 逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

## 2、每日投资组合管理

(1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为(如：股本变化、分红、停牌、复牌等)信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

(2) 标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

(3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

(5) 组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案,确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

(6) 以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，考虑T日将会发生的上市公司变动等情况，设计T日申购赎回清单并公告。

## 3、定期投资组合管理

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

根据标的指数的编制规则及指数样本股的定期调整或临时调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

#### 4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。

### （四）投资组合管理

#### 1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5) 其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

- （1）确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。
- （2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。
- （3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

#### 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

根据标的指数的编制规则及指数样本股的定期调整或临时调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

### 4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。

## （五）标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为中证金融地产指数，业绩比较基准为中证金融地产指数收益率，中证金融地产指数为中证行业指数之一。

为反应沪深 A 股不同行业公司股票的整体表现，为投资者提供分析工具，中证行业指数借鉴国际主流行业分类标准并结合我国上市公司特点，将中证 800 指数的 800 只样本股分为能源、原材料、工业、可选消费、主要消费、医药卫生、金融地产、信息技术、电信业务和公用事业等 10 个行业并形成相应行业指数的成份股。中证行业指数采用派许方法，按照样本股的调整股本数为权数加权计算。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运

作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

## （六） 风险收益特征

本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## （七） 投资限制

### 1、 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%；
- （2）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
- （3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- （4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
- （5）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- （7）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
- （8）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

(10) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 100%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

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

(12) 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；

(13) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

(14) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（7）、（11）、（12）项外，如果法律法规或中国证监会的相关规定对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，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。

## 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) 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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；

（6）法律、行政法规，或中国证监会规定禁止的其他活动。

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

#### （八）基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （九）基金的融资融券、转融通

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

#### （十）基金投资组合报告

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年4月20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2026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（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	51,926,596.68	98.91
	其中：股票	51,926,596.68	98.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	570,725.98	1.09
8	其他资产	3,069.50	0.01
9	合计	52,500,392.16	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	56,240.00	0.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,246,878.23	95.94
K	房地产业	1,593,146.45	3.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	51,896,264.68	99.09

**(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	30,480.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	30,480.00	0.06

**(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

无。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	93,600	5,314,608.00	10.15
2	600036	招商银行	108,700	4,274,084.00	8.16

3	601166	兴业银行	148,700	2,798,534.00	5.34
4	601398	工商银行	284,200	2,171,288.00	4.15
5	300059	东方财富	111,018	2,097,130.02	4.00
6	600030	中信证券	83,795	2,014,431.80	3.85
7	601288	农业银行	252,400	1,691,080.00	3.23
8	601211	国泰海通	99,170	1,645,230.30	3.14
9	601328	交通银行	234,300	1,640,100.00	3.13
10	600919	江苏银行	128,850	1,407,042.00	2.69

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天3	76,200	30,480.00	0.06

注：报告期末，本基金仅持有上述1只积极投资股票。

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

**9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

**(2) 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

无。

### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### (3) 本期国债期货投资评价

无。

## 11. 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

### (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（元）
1	存出保证金	3,069.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,069.50

### (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****①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	400174	中天3	30,480.00	0.06	重大事项停牌

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## 十一、基金的业绩

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

### （一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

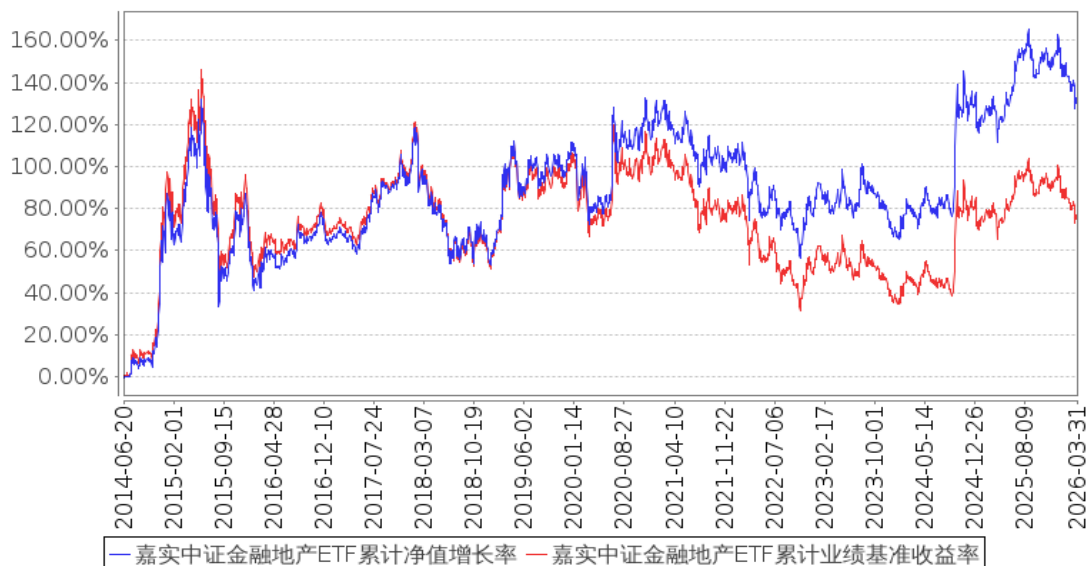
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014年6月20日 （基金合同生效日）至 2014年12月31日	84.27%	1.80%	94.67%	1.89%	-10.40%	-0.09%
2015年	-2.27%	2.49%	-3.35%	2.56%	1.08%	-0.07%
2016年	-8.96%	1.29%	-10.70%	1.30%	1.74%	-0.01%
2017年	17.41%	0.76%	15.72%	0.76%	1.69%	0.00%
2018年	-19.46%	1.43%	-21.03%	1.43%	1.57%	0.00%
2019年	34.95%	1.37%	32.71%	1.37%	2.24%	0.00%
2020年	5.91%	1.56%	0.28%	1.60%	5.63%	-0.04%
2021年	-7.89%	1.19%	-12.14%	1.21%	4.25%	-0.02%
2022年	-11.87%	1.38%	-15.51%	1.41%	3.64%	-0.03%
2023年	-4.86%	1.04%	-8.37%	1.05%	3.51%	-0.01%
2024年	34.18%	1.33%	30.06%	1.34%	4.12%	-0.01%
2025年	10.36%	0.93%	7.13%	0.94%	3.23%	-0.01%
2026年1月1日至 2026年3月31日	-9.13%	1.00%	-9.53%	1.02%	0.40%	-0.02%

该时间区间历任基金经理

何如女士，管理时间为2014年6月20日至2019年9月28日；刘珈吟女士，管理时间为2016年3月24日至2022年1月27日；李直先生，管理时间为2019年9月28日至2021年9月24日。

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

**嘉实中证金融地产ETF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**  
(2014年06月20日至2026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。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （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资金账户、证券账户、期货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结算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、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记结算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。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十三、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

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

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；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、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；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、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-6 项规定的方法对基金资产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人具有充足的理由认为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。

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

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

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

#### （四）估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 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、或登记结算机构、或销售机构、或投资人违反基金合同约定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，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，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）错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

（3）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、期货公司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。

### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 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

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额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，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 十四、基金的收益与分配

### （一）基金收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5、本基金收益分配采取现金方式；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （二）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

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后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。

### （五）基金收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》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、律师费和诉讼仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 7、基金资产的资金汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、基金的上市初费和月费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

除管理费、托管费之外的基金费用，由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （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、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

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。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，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。

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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。

基金募集申请经中国证监会核准后，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》摘要登载在指定媒介和网站上；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。

## （二）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。

## （三）《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和网站上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金净值信息

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

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

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

## （五）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站、申购赎回代理机构或其他媒介公告当日的申购赎回清单。

## （六）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

## （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度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。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”

项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### （八）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、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，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；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、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；
- 13、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；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 19、本基金变更标的指数；
- 20、基金份额暂停、恢复、终止上市交易；

21、本基金实施基金份额折算；

22、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；

23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （九）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、基金上市交易的证券交易所。

#### （十）基金份额持有人大会决议

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

#### （十一）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。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

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

#### （十三）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、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### （十四）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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；

4、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

5、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

#### （十五）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。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的主要风险

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

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

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

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

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

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

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

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

#### 4、标的指数变更的风险

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

#### 5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数服务，自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 6、成份股停牌的风险

本基金的标的指数成份股可能出现停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后对相关成份股进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

#### 7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 8、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算还可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### 9、退市风险

因基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### 10、投资者申购失败的风险

基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

#### 11、投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### 12、基金份额赎回对价的变现风险，即流动性风险

基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险，即流动性风险。

#### 1) 本基金的申购、赎回安排

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

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

#### 2) 拟投资市场及资产的流动性风险评估

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

#### 3) 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：

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对价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。

#### 13、深交所上市的成份证券申赎处理规则带来的风险

本基金申购赎回清单对于深交所上市的成份证券的现金替代标识包括“可以现金替代”，在申购赎回环节中必须使用现金作为替代，并根据基金管理人实际买卖情况与投资者进行退补款，可能导致如下风险：

1) 由于深交所上市的成份证券采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

2) 因技术系统、通讯联络或其他原因可能导致基金管理人无法严格遵循“时间优先、实时申报”原则对“可以现金替代”的深交所上市的成份证券进行处理，基金管理人也不

对“时间优先、实时申报”原则的执行效率和结果做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准，由此可能影响投资者的投资损益。

#### 14、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

#### 15、股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货主要存在以下风险：

- （1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

#### 16、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，若本基金投资存托凭证的，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 17、第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

- （1）申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

（2）登记结算机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

（3）证券交易所、登记结算机构、基金托管人、申购赎回代理券商及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### 18、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

#### 19、技术风险

在基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错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、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

#### 20、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 21、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

### （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售代理机构销售，但是，本基金并不是销售代理机构的存款或负债，也没有经销售代理机构担保或者背书，销售代理机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （二）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金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；

#### 5、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财产中支付。

#### 6、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 7、基金财产清算的公告

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

#### 8、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、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金份额持有人的权利

- （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）依法赎回或转让其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）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、基金份额持有人的义务

- （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）及时足额缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价、赎回对价及法律法规和《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，自基金管理人及/或基金管理人的代理人、基金托管人、非直销销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- （9）遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
- （10）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规定的监督基金托管人，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结算机构办理基金登记结算业务，并按照《基金合同》规定对基金登记结算机构进行必要的监督和检查；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规定的决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券、转融通以及将基金作为融资融券标的进行运用等相关业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规、《基金合同》、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的前提下，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回及其他相关业务规则；
- (17) 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。

#### 4、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；
- (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》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价格、申购对价、赎回对价和注销的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 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，将已缴纳的认购款项、股票及其孳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。

#### 5、基金托管人的权利

- （1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- （2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- （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、期货账户及投资所需其他账户、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）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。

#### 6、基金托管人的义务

- （1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- （2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- （3）建立健全内部风险控制、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》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货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》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、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；
- （9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10)对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

(12) 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对价的现金部分；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、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定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决程序和规则

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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

ETF 联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和 ETF 联接基金的相关性，ETF 联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的 ETF 联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，ETF 联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，ETF 联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的 ETF 联接基金份额占 ETF 联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

ETF 联接基金的基金管理人不应以 ETF 联接基金的名义代表 ETF 联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受 ETF 联接基金的特定基金份额持有人的委托以 ETF 联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

ETF 联接基金的基金管理人代表 ETF 联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照 ETF 联接基金基金合同的约定召开 ETF 联接基金的基金份额持有人大会，ETF 联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由 ETF 联接基金的基金管理人代表 ETF 联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（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》；
- （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、基金合同和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（但法律法规要求提高该等报酬标准的除外）；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和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%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）终止基金上市，但因基金合同另有约定的除外；
- （13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （14）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、尽管有前款的约定，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《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

（4）因相应的法律法规、监管机关的监管规则、相关证券交易所或者登记结算机构业务规则等发生变动而应当对《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变化；

(6) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

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

(8) 基金管理人推出以本基金为目标 ETF 的 ETF 联接基金；

(9) 在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(10) 监管机关或上海证券交易所要求本基金终止上市的；

(11) 开通场外申购赎回业务；

(12) 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情形以外的其他情形。

#### (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、单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会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) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 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) 基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，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书符合法律法规、《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的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》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不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面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，并与基金登记结算机构记录相符；

（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。

（E）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容本部分第一条“召开事由”所述应当召开基金份额持有人大会审议决定的事项。

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%）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

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时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监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者备案之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。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）本基金按照本基金合同约定变更为分级的交易型开放式指数证券投资基金时，同一类别的每份基金份额具有同等的合法权利。就基金份额持有人大会提案、出席及表决等事项，将由各类基金份额持有人分别行使，基金管理人就此与基金托管人协商一致并报监管机关后可修改基金份额持有人大会程序，并向投资人公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

（J）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、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

(1) 基金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财产中支付。

(D) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(E) 基金财产清算的公告

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

(F) 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。

《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。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“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

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：中国证监会证监基金字【1999】5号

组织形式：有限责任公司（外商投资，非独资）

注册资本：1.5亿元人民币

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(A) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票，衍生工具（权证、股指期货等），债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

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

基金管理人应将拟投资的标的指数成份股及备选成份股股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督。

(1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%；

(2) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

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

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

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

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

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

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

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

（10）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%，本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的100%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

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

（12）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；

（13）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（7）、（11）、（12）项外，如果法律法规或中国证监会的相关规定对《基金合同》约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，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。

3、对基金投资禁止行为进行监督。

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

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

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

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

（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、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复核。

（C）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（D）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（E）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：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。

### （三）基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，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核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金资产、开设基金资产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金资产、未对基金资产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

### （四）基金财产的保管

#### （A）基金资产保管的原则

1、基金资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资产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金资产的资金账户、证券账户、期货账户及投资所需其他账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

#### (B) 《基金合同》生效前募集资金、股票的验资和入账

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名方式开立的证券账户下，基金托管人在收到资金和股票当日出具确认文件。同时，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款、股票解冻及返还事宜，基金托管人应提供协助。

#### (C) 基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款、支付或收取现金差额、支付或收取现金替代、支付或收取现金替代退补款，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### (D) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

#### (E) 基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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。

(F) 其他账户的开设和管理

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

(G) 投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的结算通知或者基金管理人的指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代、现金差额和现金替代多退少补款的结算。

(H) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

(I) 基金资产投资的有关有价凭证的保管

基金资产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

(J) 与基金资产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

(五) 基金资产净值计算和会计核算

(A) 基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应个每开放日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，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、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金资产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理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；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除《基金合同》和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金资产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应依据《基金合同》及本协议承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金资产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人及基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所、期货公司及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但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、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （B）基金会计核算

### 1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双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。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

## 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

## 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。在《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。

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

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应3个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后10个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司担任本基金的登记结算机构，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由登记结算机构承担。基金份额持有人名册的内容至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记结算机构提供，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规规定承担责任。

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

#### （七）争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按届时有效的仲裁规则进行仲裁。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、律师费用由败诉方承担。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### （八）托管协议的修改与终止

##### （A）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准或备案。

##### （B）托管协议的终止

发生以下情况，经履行适当程序后，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### （C）基金资产的清算

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

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。

以下是基金管理人提供的主要服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

### （一）产品讯息咨询服务

投资者如果想查询基金净值、相关公告、基金产品与服务等信息，可通过拨打基金管理人客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，或登录本基金管理人网站（[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)）进行咨询、查询。

### （二）客户投诉与建议受理服务

客户对我们工作的意见和建议，可通过客服热线、留言信箱、电子邮件或信函等方式向我们提出，对于普通投诉我们会在两天内予以回复，对于重大投诉的回复不超过 72 小时。

## 二十三、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过规定媒介（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	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2025年5月22日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分上交所基金变更扩位证券简称的公告	2025年6月16日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2025年7月5日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分上交所ETF申购赎回清单版本更新的公告	2025年11月17日

## 二十四、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、基金托管人及基金非直销销售机构住所，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。

## 二十五、备查文件

- 1、中国证监会核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《证券登记及服务协议》及附加协议；
- 4、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照。

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  
2026年06月13日