深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011年9月27日
公告日期：2011年9月22日

一、重要声明与提示

《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对深证基本面120交易型开放式证券投资基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2011年6月28日《上海证券报》上的《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站（www.jsfund.cn）。

二、基金概览

1.基金名称：深圳基本面120交易型开放式指数证券投资基金
2.基金类型：股票型
3.基金运作方式：交易型开放式
4.基金场内简称：深F120
5.基金代码：159910
6.标的指数简称：深证基本面120指数
7.标的指数代码：399702
8.基金份额总额：
截至2011年9月20日，本基金的基金份额总额为485,906,143.00份。
9.基金份额净值：
截至2011年9月20日，本基金的基金份额净值为0.9595元。
10.本次上市交易的基金份额：485,906,143.00份
11.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
12.上市交易日期：2011年9月27日
13.基金管理人：嘉实基金管理有限公司
14.基金托管人：中国银行股份有限公司
15.登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
16.申购赎回代理券商：中银万国证券、银河证券、广发证券、国信证券、光大证券、兴业证券、渤海证券、华宝证券、海通证券、中信建投证券、招商证券、齐鲁证券

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2011】906号
2.基金合同生效日：2011年8月1日
3.运作方式：交易型开放式
4.基金合同期限：不定期
5.发售日期：2011年7月1日至2011年7月26日。其中，网上现金认购的日期为2011年7月1日至2011年7月26日，通过基金管理人进行网下现金认购为2011年7月1日至2011年7月26日，通过发售代理机构进行网下股票认购的日期为2011年7月20日至2011年7月26日。
6.发售价格：1.00元人民币
7.份额发售方式：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。
8.发售机构：
1）网下现金发售直销机构：
嘉实基金管理有限公司
2）网上现金发售代理机构：
具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司
3）网下股票发售代理机构：
中信证券、广发证券、中信建投证券、海通证券、中银万国证券、国泰君安证券、中国银河证券、兴业证券、招商证券、华泰联合证券、长城证券、国都证券、光大证券、渤海证券、国信证券、安信证券、平安证券、中国建银投资证券、湘财证券、中信万通证券、东吴证券、恒泰证券、东海证券、东方证券、第一创业证券、东莞证券、齐鲁证券、爱建证券、华福证券、国金证券、华鑫证券、南京证券、华宝证券、上海证券、中原证券、民生证券、广州证券、长江证券、华龙证券、新时代证券、中信金通证券、信达证券、中国民族证券、东北证券、华融证券、江海证券、万联证券、中航证券、德邦证券、华泰证券、华西证券、宏源证券、山西证券、国盛证券、方正证券
9.验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
10.募集资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为485,865,171.00元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计40,972.00元人民币。本次募集所有资金已于2011年8月1日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金托管专户。
本次募集有效认购户数为4,382户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金（含所募集股票市值）及其产生的利息结转的基金份额共计485,906,143.00份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。
11.本基金募集备案情况：本基金于2011年8月1日验资完毕，2011年8月1日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2011年8月1日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。
12.基金合同生效日：2011年8月1日
13.基金合同生效日的基金份额总额：485,906,143.00份。

（二）本基金日常申购、赎回情况

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回。基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）本基金上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2011】91号
2.上市交易日期：2011年9月27日
3.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4.基金场内简称：深F120
5.基金交易代码：159910
6.本次上市交易份额：485,906,143.00份
7.未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2011年9月20日，本基金持有人户数为4,379户，平均每户持有的基金份额为110,962.81份。
机构投资者持有的基金份额为245,627,344.00份，占基金总份额的比例为50.55%；个人投资者持有的基金份额为240,278,799.00份，占基金总份额的比例为49.45%。

（二）基金份额前十名持有人情况

截至2011年9月20日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额比例（%）
1	中国银河证券股份有限公司	20,025,625.00	4.12
2	中信证券股份有限公司	20,001,666.00	4.12
3	申银万国证券股份有限公司	20,001,388.00	4.12
4	渤海证券股份有限公司	20,001,388.00	4.12
5	中信证券–中信–中信理财2号集合资产管理计划	20,001,388.00	4.12
6	开源证券有限责任公司	20,000,199.00	4.12
7	财富证券有限责任公司	19,998,798.00	4.12
8	海通证券股份有限公司	18,999,759.00	3.91
9	招商证券股份有限公司	17,001,180.00	3.50
10	兴业证券股份有限公司	12,000,833.00	2.47
合计		188,032,224.00	38.70

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况
名称：嘉实基金管理有限公司
法定代表人：王忠民
总经理：赵学军
注册资本：1.5亿元人民币
注册地址：上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室
设立批准文号：中国证监会证监基字【1999】5号
工商登记注册的法人营业执照文号：100000400011239
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
成立日期：1999年3月25日
2、股东及其出资比例：中诚信托有限责任公司40%，立信投资有限责任公司30%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%。
3、内部组织结构及职能
公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会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。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。
公司目前下设股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部、机构投资部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务团队、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、基金运营部、登记结算部、信息技术部、财务部、人力资源部、战略发展部等部门。
股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部和机构投资部负责根据投决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程、绩效考核。监察稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。机构业务团队主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。渠道发展部、营销策划部、电子商务部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。基金运营部、登记结算部、信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务管理工作。人力资源部负责公司企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等事务等综合事务管理。战略发展部负责公司经营战略规划、新业务发展等。
4、人员情况
截至2011年8月31日，我公司共有453名员工，其中博士学位20人、硕士学位233人和学士学位203人。
5、信息披露负责人：胡勇钦
咨询电话：010-65215588
6、基金管理业务情况
截止2011年8月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、26只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII－LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。
7、本基金基金经理简介
杨阳先生，中国科学技术大学学士，宾夕法尼亚州立大学硕士，11年证券从业经验，具有基金从业资格。2000年至2003年任贝尔斯登高级工程师，2003至2005年任HBK投资公司高级工程师交易操盘手，2005至2006年任Citadel投资集团高级数量分析师，2006年至2008年任高盛集团高级数量分析师，2008年3月加入嘉实基金管理有限公司担任高级数量分析师，2009年12月30日至今任嘉实基本面50指数（LOF）基金经理。2011年8月1日至今任本基金及嘉实深证基本面120ETF联接基金经理。2011年8月4日至今任嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理。

（二）基金托管人

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
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门联系人：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942
2.主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。
3. 基金托管业务经营情况
截至2011年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或弓混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、工银金球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）等119只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，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。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
法定代表人：杨绍信
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海卢湾区湖滨路202号普华永道中心11楼
经办注册会计师：汪棣、陈宇
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800

六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利与义务
（1）基金份额持有人的权利
1）分享基金资产收益；
2）参与分配清算后的剩余基金资产；
3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4）按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7）监督基金管理人的投资运作；
8）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金份额持有人的义务
1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2）缴纳基金认购款项和认购费用、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4）在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；
5）不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
6）执行基金份额持有人大会的决议；
7）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
8）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；
9）法律法规及基金合同规定的其他义务。
2、基金管理人的权利与义务
（1）基金管理人的权利
1）依法募集基金，办理基金备案手续；
2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金资产；
3）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
4）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
5）在本合同的有效期内，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合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
6）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
7）启行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算机构，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；
8）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
9）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
10）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
11）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
12）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
13）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
14）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
15）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金管理人的义务
1）依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2）办理基金备案手续；
3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
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资产；
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，保证所管理的基金资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）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；
7）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
9）依法按受基金托管人的监督；
10）编制季度、半年度和年度基金报告；
11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
12）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；
13）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；
14）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以保密，不得向他人泄露；
15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的对价；
16）保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
17）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；
18）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；
19）组织并参加基金资产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
20）因违反基金合同导致基金资产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21）基金托管人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。
3、基金托管人的权利与义务
（1）基金托管人的权利
1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；
2）按照基金合同的约定获得基金托管费；
3）监督基金管理人对本基金的投资运作；
4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
6）法律法规、基金合同规定的其他权利。
（2）基金托管人的义务
1）安全保管基金资产；
2）设立专门的基金托管部，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，负责基金资产托管事宜；
3）按规定开设基金资产的资金账户和证券账户；
4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；
5）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和独立；
6）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；
7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
9）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应予以保密，不得向他人泄露；
10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
11）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；如果基金管理人有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；
12）保管基金份额持有人名册；
13）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15）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；
16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
18）因违反基金合同导致基金资产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
19）因基金管理人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。
（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决程序和规则
本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
鉴于本基金和本基金的联接基金（即“嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，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，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占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。
联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表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，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以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。
联接基金的基金管理人代表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，须先遵照联接基金《基金合同》的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，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，由联接基金的基金管理人代表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。
1、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：
（1）终止基金合同；
（2）转换基金运作方式；
（3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
（4）更换基金管理人、基金托管人；
（5）变更基金份额持有人名册；
（6）变更基金投资目标、范围或策略；
（7）变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
（8）本基金与其他基金合并；
（9）终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；
（10）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的基金合同变更等其他事项；
（11）法律法规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、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：
（1）调低基金管理费率、基金托管费率；
（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
（3）因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当对基金合同进行修改；
（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
（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；
（6）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、转托管、非交易过户等业务的规则；
（7）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。
3、召集方式：
（1）除法律法规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，应当自行召集。
（3）单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有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，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。
基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。
基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。
（4）单独或合计代表基金份额10%以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。
（5）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。
4、通知
召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：
（1）会议召开的时间、地点、方式；
（2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
（3）代理投票授权委托文件送达时间和地点；
（4）会务常设联系人姓名、电话；
（5）权益登记日；
（6）如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见的提交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。
5、开会方式
基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。
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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托文件等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
（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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上。
在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：
（1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；
（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；
（4）直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。
如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。
6、议事内容与程序
（1）议事内容及提案权
1）议事内容限为本条前述第1款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。
2）基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。
3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：
a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。
4）单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。
5）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
在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在大会聘请的公证机关的公证员的公证下统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。
7、表决
（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。
（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：
1）特别决议
对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。
2）一般决议
对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上通过。
更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决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。
8、计票
（1）现场开会
1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人的授权代表担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。
2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。
3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。
5）计票过程应由公证机关予以公证。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。
（2）通讯方式开会
在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：
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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人。
9、生效与公告
（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。
（2）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、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人均有法律约束力。
（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后依照《信息披露管理办法》的有关规定，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。
（4）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、公证机关、公证员姓名等一同公告。
10、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。
（三）基金收益分配原则、执行方式
1、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，基金管理人有权进行收益分配。
（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6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