# 中创400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：中国工商银行股份有限公司**
**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：2012年5月11日**
**公告日期：2012年5月8日**

## 一、重要声明与提示

《中创400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"）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，中创400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、深圳证券交易所对中创400交易型开放式指数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2012年2月15日《证券时报》上的《中创400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：中创400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：中创400
5. 基金代码：159918
6. 标的指数简称：中创400指数
7. 标的指数代码：399624
8. 基金份额总额：

截至2012年5月4日，本基金的基金份额总额为286,561,264.00份。

9. 基金份额净值：

截至2012年5月4日，本基金的基金份额净值为1.0122元。

10. 本次上市交易的基金份额：286,561,264.00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：2012年5月11日
13. 基金管理人：嘉实基金管理有限公司
14. 基金托管人：中国工商银行股份有限公司
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：国信证券股份有限公司

## 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【2012】13号
2. 基金合同生效日：2012年3月22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：2012年2月20日至2012年3月16日。其中，网上现金认购的日期为2012年2月20日至2012年3月16日，通过基金管理人进行网下现金认购为2012年2月20日至2012年3月16日，通过发售代理机构进行网下股票认购的日期为2012年3月12日至2012年3月16日。
6. 发售价格：1.00元人民币
7. 份额发售方式：场内、场外认购
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：

中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、德邦证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、民生证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

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286,543,155.00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18,109.00元人民币。本次募集所有资金已于2012年3月22日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的中创400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2,018户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计286,561,264.00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2012年3月22日验资完毕，2012年3月22日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2012年3月22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：2012年3月22日
13. 基金合同生效日的基金份额总额：286,561,264.00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【2012】117号
2. 上市交易日期：2012年5月11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：中创400
5. 基金交易代码：159918
6. 本次上市交易份额：286,561,264.00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2012年5月4日，本基金持有人户数为2,016户，平均每户持有的基金份额为142,143.48份。

截至2012年5月4日，机构投资者持有的基金份额为163,364,395.00份，占基金总份额的比例为57.01%；个人投资者持有的基金份额为123,196,869.00份，占基金总份额的比例为42.99%。

（二）基金份额前十名持有人情况

截至2012年5月4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 | 中航－浦发－中航金航2号集合资产管理计划 | 20,001,666.00 | 6.98% |
| 2 | 浙商证券－农行－浙商汇金1号集合资产管理计划 | 20,000,999.00 | 6.98% |
| 3 | 韩安云 | 11,999,499.00 | 4.19% |
| 4 | 长江证券－交行－长江证券超越理财趋势掘金集合资产管理计划 | 10,000,999.00 | 3.49% |
| 5 | 齐鲁证券－中信－金泰山灵活配置集合资产管理计划 | 10,000,416.00 | 3.49% |
| 6 | 招商证券股份有限公司 | 10,000,416.00 | 3.49% |
| 7 | 中航证券有限公司 | 10,000,416.00 | 3.49% |
| 8 | 东兴证券－光大－东兴1号优选基金集合资产管理计划 | 9,999,399.00 | 3.49% |
| 9 | 渤海证券股份有限公司 | 8,000,333.00 | 2.79% |
| 10 | 国泰君安证券股份有限公司 | 8,000,333.00 | 2.79% |
| 11 | 中国银河证券股份有限公司 | 8,000,333.00 | 2.79% |
| 合计 |  | 126,004,809.00 |  |

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：安奎
总经理：赵学军
注册资本：1.5亿元人民币
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期23楼01-03单元
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%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司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、结构产品投资部、定量投资部、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、机构业务体系、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、行政管理部、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资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。机构业务体系主要负责年金、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。信息技术部、基金运营部、登记结算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。人力资源部和行政管理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2012年3月31日，我公司共有459名员工，其中博士学位24人、硕士学位230人、学士学位189人、其他16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2012年3月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、31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）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接。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

杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有13年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理，2003年3月15日至2004年7月7日任万家（原天同）180指数证券投资基金基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司，2005年8月29日至今任嘉实沪深300指数基金基金经理。杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。

（二）基金托管人

1、公司概况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称"中国工商银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
成立时间：1984年1月1日
注册资本：人民币349,018,545,827 元
法定代表人：姜建清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】3号
联系人：赵会军
电话：（010）66105799

2.主要人员情况

截至2012年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3. 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年3月，中国工商银行共托管证券投资基金239只，其中封闭式7只，开放式232只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的29项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（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、吴海霞
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

## 七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

中创400交易型开放式指数证券投资基金2012年5月4日资产负债表（未经审计）如下：

| 资 产 | 期末<br>2012年5月4日 |
|---|---|
| 资 产： |  |
| 银行存款 | 79,602,877.71 |
| 结算备付金 | 3,153,360.64 |
| 存出保证金 | 333,333.34 |
| 交易性金融资产 | 219,993,043.76 |
| 其中：股票投资 | 219,993,043.76 |
| 基金投资 | – |
| 债券投资 | – |
| 资产支持证券投资 | – |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | – |
| 应收证券清算款 | – |
| 应收利息 | 96,861.71 |
| 应收股利 | – |
| 应收申购款 | – |
| 递延所得税资产 | – |
| 其他资产 | 3,079.68 |
| 资产总计 | 303,182,556.84 |
| 负债和所有者权益 | 期末<br>2012年5月4日 |
| 负 债： |  |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付证券清算款 | 12,688,361.03 |
| 应付赎回款 | – |
| 应付管理人报酬 | 15,601.16 |
| 应付托管费 | 3,120.23 |
| 应付销售服务费 | – |
| 应付交易费用 | 135,003.62 |
| 应交税费 | – |
| 应付利息 | – |
| 应付利润 | – |
| 其他负债 | 276,795.46 |
| 递延所得税负债 | – |
| 负债合计 | 13,118,881.50 |
| 所有者权益： |  |
| 实收基金 | 286,561,264.00 |
| 未分配利润 | 3,502,411.34 |
| 所有者权益合计 | 290,063,675.34 |
| 负债和所有者权益总计 | 303,182,556.84 |

## 八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2012年5月4日，中创400交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下：

（一）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 | 219,993,043.76 | 72.56 |
|  | 其中：股票 | 219,993,043.76 | 72.56 |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
|  | 其中：债券 | – | – |
|  | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 82,756,238.35 | 27.30 |
| 6 | 其他资产 | 433,274.73 | 0.14 |
| 7 | 合计 | 303,182,556.84 | 100.00 |

（二）按行业分类的股票投资组合

1. 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 4,019,283.68 | 1.39 |
| B | 采掘业 | 3,821,621.40 | 1.32 |
| C | 制造业 | 151,052,025.53 | 52.08 |
| C0 | 食品、饮料 | 10,032,379.71 | 3.46 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 7,034,003.70 | 2.42 |
| C2 | 木材、家具 | 1,798,750.83 | 0.62 |
| C3 | 造纸、印刷 | 4,950,331.84 | 1.71 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 26,437,259.64 | 9.11 |
| C5 | 电子 | 21,235,847.28 | 7.32 |
| C6 | 金属、非金属 | 19,027,374.19 | 6.56 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 42,352,225.23 | 14.60 |
| C8 | 医药、生物制品 | 14,210,817.12 | 4.90 |
| C99 | 其他制造业 | 3,973,035.99 | 1.37 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 2,151,244.33 | 0.74 |
| E | 建筑业 | 8,203,280.85 | 2.83 |
| F | 交通运输、仓储业 | 745,284.00 | 0.26 |
| G | 信息技术业 | 24,689,850.58 | 8.51 |
| H | 批发和零售贸易 | 9,576,661.47 | 3.30 |
| I | 金融、保险业 | – | – |
| J | 房地产业 | 2,734,658.00 | 0.94 |
| K | 社会服务业 | 9,302,992.98 | 3.21 |
| L | 传播与文化产业 | 3,361,883.50 | 1.16 |
| M | 综合类 | 334,257.44 | 0.12 |
|  | 合计 | 219,993,043.76 | 75.84 |

2. 积极投资按行业分类的股票投资组合

2012年5月4日，本基金未持有积极投资股票。

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1. 指数投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 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 | 002385 | 大北农 | 140,000.00 | 2,612,400.00 | 0.90 |
| 2 | 002353 | 杰瑞股份 | 57,460.00 | 2,389,761.40 | 0.82 |
| 3 | 002375 | 亚厦股份 | 58,686.00 | 1,821,026.58 | 0.63 |
| 4 | 002450 | 康得新 | 111,100.00 | 1,799,820.00 | 0.62 |
| 5 | 002344 | 海宁皮城 | 61,853.00 | 1,746,728.72 | 0.60 |
| 6 | 002477 | 雏鹰农牧 | 91,900.00 | 1,718,530.00 | 0.59 |
| 7 | 002250 | 联化科技 | 103,055.00 | 1,624,146.80 | 0.56 |
| 8 | 300146 | 汤臣倍健 | 26,100.00 | 1,448,550.00 | 0.50 |
| 9 | 002311 | 海大集团 | 58,500.00 | 1,299,870.00 | 0.45 |
| 10 | 002506 | 超日太阳 | 106,100.00 | 1,257,285.00 | 0.43 |

2. 积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

2012年5月4日，本基金未持有积极投资股票。

（四）按券种分类的债券投资组合

2012年5月4日，本基金未持有债券。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

2012年5月4日，本基金未持有债券。

（六）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

2012年5月4日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、2012年5月4日其他资产构成：

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 333,333.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 96,861.71 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | 3,079.68 |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 433,274.73 |

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细

2012年5月4日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2012年5月4日，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

2）期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2012年5月4日，本基金未持有积极投资股票。

## 九、重大事件揭示

中创400交易型开放式指数证券投资基金基金合同已于2012年3月22日正式生效，基金管理人于2012年3月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登《中创400交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》。

中创400交易型开放式指数证券投资基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准中创400交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
（二）《中创400交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《中创400交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
（四）《中创400交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
（五）《关于嘉实基金管理有限公司募集设立中创400交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书》；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年5月8日**

附件：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、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集基金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、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，按有关规定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；
（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、半年度和年度基金报告；
（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、足额支付申购或赎回之基金份额的对价；
（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发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（23）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
（25）建立并保管基金份额持有人名册，根据托管协议的约定定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（4）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；
（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；
（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定或经有权机关要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价；
（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、半年度和年度基金报告出具意见，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；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
（12）建立并保管基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

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

（下转D23版）

---

# 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告

**公告送出日期：2012年5月8日**

1 公告基本信息

|  |  |
|---|---|
| 基金名称 | 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实沪深300ETF |
| 基金主代码 | 159919 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年5月7日 |
| 基金管理人名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |
| 公告依据 | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》 |

2 基金募集情况

|  |  |  |
|---|---|---|
| 基金募集申请获中国证监会核准的文号 |  | 证监许可[2012]393号 |
| 基金募集期间 |  | 自2012年4月5日<br>至2012年4月27日止 |
| 验资机构名称 |  | 普华永道中天会计师事务所有限公司 |
| 募集资金划入基金托管专户的日期 |  | 2012年5月7日 |
| 募集有效认购总户数(单位：户) |  | 88,720 |
| 募集期间净认购金额(单位：元) |  | 19,332,261,440.00 |
| 认购资金在募集期间产生的利息(单位：元) |  | 1,045,952.00 |
| 募集份额(单位：份) | 有效认购份额 | 19,332,261,440.00 |
|  | 利息结转的份额 | 1,045,952.00 |
|  | 合计 | 19,333,307,392.00 |
| 其中：募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况 | 认购的基金份额(单位：份) | 0 |
|  | 占基金总份额比例 | 0% |
|  | 其他需要说明的事项 | 无 |
| 其中：募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况 | 认购的基金份额(单位：份) | 0 |
|  | 占基金总份额比例 | 0% |
| 募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件 |  | 是 |
| 向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期 |  | 2012年5月7日 |

注：本基金基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由本基金管理人承担，不从基金资产中支付。

3 其他需要提示的事项

根据嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书、基金合同的有关规定，嘉实沪深300ETF（基金代码：159919）的申购、赎回业务自基金合同生效之日起不超过3个月的时间内开始办理。本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。本基金的基金管理人应在申购开始日、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。

销售机构受理投资人认购申请并不代表该申请成功，申请的成功与否须以本基金注册登记人的确认结果为准。

特此公告。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年5月8日**

---

# 关于中创400交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告

**公告送出日期：2012年5月8日**

1 公告基本信息

|  |  |
|---|---|
| 基金名称 | 中创400交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实中创400ETF(场内简称：中创400) |
| 基金主代码 | 159918 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月22日 |
| 基金管理人名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金注册登记机构名称 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 公告依据 | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《中创400交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《中创400交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》 |
| 申购起始日 | 2012年5月11日 |
| 赎回起始日 | 2012年5月11日 |

注：投资者范围：符合法律法规的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、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。

2 日常申购、赎回业务的办理时间

基金投资者办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，具体办理时间为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，若出现深圳证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者申购的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购赎回单位为300万份，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》的有关规定在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

3.2 申购费率

投资者在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购份额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。

4 日常赎回业务

4.1 赎回金额限制

投资者赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购赎回单位为300万份，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》的有关规定在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

4.2 赎回费率

投资者在赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过赎回份额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。

5 基金销售机构

5.1 场内销售机构

国信证券股份有限公司。

5.2 其他与基金销售机构相关的事项

（1）各销售网点的地址、营业时间等信息，请参照各销售机构的规定。
（2）基金管理人可以根据情况增加或者减少场内销售机构，并另行公告。

6. 基金份额净值公告的披露安排

自2012年5月11日起，本基金管理人将在每个开放日的次日，通过中国证监会指定的信息披露媒体及本公司网站披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，敬请投资者留意。

7. 其他需要提示的事项

（1）中创400交易型开放式指数证券投资基金为交易型开放式指数基金，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

（2）本公告仅对本基金的开放日常申购、赎回业务事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请认真阅读2012年2月15日刊登在《证券时报》上的《招募说明书》，亦可登陆本公司网站（www.jsfund.cn）进行查询。

（3）有关本基金上市交易事宜本公司将另行公告。

（4）本基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，敬请投资者留意相关公告。

（5）申购和赎回的原则

① 本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 本基金的申购对价、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、赎回应遵守深交所《业务细则》的相关规定。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（6）申购和赎回的程序

① 申购和赎回申请的提出

基金投资者必须根据申购、赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按申购、赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

② 申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、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，或本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。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况，否则如因申请未得到登记结算机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

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股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在T+1日办理基金份额、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券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

④ 基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体公告。

（7）申购、赎回的对价

① 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。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。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

② 申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。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。

（8）风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

**嘉实基金管理有限公司**
**2012年5月8日**