(上接 C9 版)

朱蕾女士,监事,中共党员,硕士研究生。曾任首都医科大学教师,中国保险监督管理委员会主任科员、国都证券有限责任公司高级经理,中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007 年 10 月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)股份有限公司董事会秘书、北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信投资有限公司财务总监。

王利刚先生,监事,经济学学士。2001 年 2 月至今,就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部,历任人力资源部副总监、总监。

宋振茹女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981 年 6 月至 1996 年 10 月任职于中办警卫局。1996 年 11 月至 1998 年 7 月于中国银行海外行管理部任副处长。1998 年 7 月至 1999 年 3 月任博时基金管理公司总经理助理。1999 年 3 月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察长和公司副总经理。

张峰先生,副总经理,中共党员,硕士。曾就职于国家计委,曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士,副总经理,武汉大学经济学硕士,加拿大大不列颠哥伦比亚大学 MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人;平安证券公司助理总经理,平安集团投资审批委员会委员。2004 年 3 月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2、基金经理

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 12 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,现任公司结构产品投资部总监。2005 年 8 月 29 日至今任嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)(原嘉实沪深 300 指数(LOF))基金经理,2012 年 3 月 22 日至今任嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接基金经理、2012 年 5 月 7 日至今任嘉实沪深 300ETF 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。

3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,投资决策委员会的成员包括:公司总经理赵学军先生、公司副总经理戴京焦女士,总经理助理孟凌蔚先生、总经理助理邵健先生、股票投资部总监刘天君先生、机构投资部总监莹开宇女士、资深基金经理陈勤先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(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、编制中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

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,但是国务院另有规定的除外;

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,由国务院证券监督管理机构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、监察稽核、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全面性原则:内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

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

③独立性原则:公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立;

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

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

3.内部控制组织体系

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

②投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构,由公司总经理、副总经理、总经理助理、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监察稽核部:公司管理层重视和支持监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性,配备了充足合格的监察稽核人员,明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程,组织纪律。监察稽核部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察稽核工作。

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的重叠。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公司建立健全内部监控制度,督察长、监察稽核部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。

③对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细,按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查,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。

④对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点,界定风险责任人,设计内部风险点自我评估表,对风险点进行评估和分析,并由监察稽核部监督风险控制措施的执行,及时防范和化解风险。

⑤督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为,在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时,向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

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)基金托管人基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期:1983 年 10 月 31 日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管部门信息披露联系人:唐州徽

电话:(010)66594855

传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

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,现有员工 120 余人。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。2011 年末,中国银行各类托管资产规模突破两万亿元,居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至 2012 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、海富通精选或号混合、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、华泰柏瑞量化阿行股票型、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、易方达少非添利债券型、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(MT)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、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 180 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、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)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 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。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(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》、《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,立即通知基金管理人,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,应当立即通知基金管理人,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)场外销售机构

1、直销机构

①)嘉实基金管理有限公司北京直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65180615
联系人	赵虹		

②)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	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		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	吴冬梅		

③)嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段 86 号城市之心 30H 嘉实基金		
电话	(028)86202100	传真	(028)86202100
联系人	王启明		

④)嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦附楼二楼		
电话	(0755)25870686	传真	(0755)25870663
联系人	周炜		

⑤)嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(0532)66777766	传真	(0532)66777676
联系人	曹涌		

⑥)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室		
电话	(0571)87759328	传真	(0571)87759331
联系人	徐莉莉		

⑦)嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591)88013673	传真	(0591)88013670
联系人	吴冬梅		

⑧)嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025)66671118	传真	(025)66671100
联系人	陈建林		

⑨)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020)87555163	传真	(020)81552120
联系人	庄文胜		

②)中国银行

注册地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人 肖钢

电话 (010)66596688 传真 (010)66594946

网址 www.boc.cn 客服电话 95566

③)其他代销机构:详见本基金发售公告

(二)场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见发售公告。

(三)基金注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人:金颖

电话:(010-59378835

传真:(010-59378907

联系人:任瑞新

(四)律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所、办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 层

联系电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

负责人:韩炯

联系人:黎明

经办律师:吕红、黎明

(五)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

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

法定代表人:杨绍信

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联 系 人:金毅

经办注册会计师:许康玮、金毅

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》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 13 日《关于核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2012]1681 号)核准募集。

(一)基金运作方式和类型

1、基金的类别:债券指数型

2、基金的运作方式:上市契约型开放式

(二)基金存续期

不定期。

(三)基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象、募集规模上限

1.募集期:本基金募集期为自基金份额发售之日起不超过 3 个月,具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及基金合同的规定确定,并在发售公告中披露。

2.募集方式及场所:

本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。A 类基金份额通过场外和场内两种方式发售,C 类基金份额通过场外方式发售。场外将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点发售,场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售,具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。

3.募集对象:

本基金的发售对象为个人投资者、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者。

4.募集规模上限

本基金的募集上限详见基金份额发售公告。

基金合同生效后不受此规模限制。

(四)基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为两不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额,称为 A 类;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费,但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额,称为 C 类。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于每一类基金份额类别的费率不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定,并在本招募说明书中公告。

根据基金运作情况,基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下,经与基金托管人协商,在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者增加新的基金份额类别等,调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

(五)基金面值、认购费用、认购份额及计算公式

1、基金面值

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的基金份额初始面值均为人民币 1.00 元。

2、认购份额

本基金按初始面值发售,认购份额为每份基金份额人民币 1.00 元。

3、认购费率

本基金 A 类基金份额在认购申请时收取基金前端认购费用;C 类基金份额不收取认购费用。

1)、场外认购:投资者在场外认购 A 类基金份额时需交纳前端认购费,费率按认购金额递减,具体如下:

认购金额(含认购费)	认购费率
M<50 万元	0.4%
50万元≤M<100 万元	0.3%
100万元≤M<200 万元	0.2%
200万元≤M<500 万元	0.1%
M≥500 万元	按笔收取,1000 元/笔

2)、场内认购:场内会员单位可按照基金招募说明书中约定的场外认购 A 类基金份额的认购费率设定投资人场内认购 A 类基金份额的佣金比率。

3)、本基金认购费由认购人承担,认购费不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

4)、投资者重复认购时,需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

4. 认购份额的计算:

1)、场外认购 A 类基金份额的份额计算:

基金场外认购采用金额认购的方式。A 类基金份额的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为:

①认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:

净认购金额 = 认购金额/(1+认购费率);

认购费用 = 认购金额-净认购金额;

认购份额 = (净认购金额+认购利息)/基金份额面值。

②认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额面值

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分截去,由此产生的误差计入基金财产。

例一:某投资者在认购期投资 10,000 元认购 A 类基金份额,假设募集期利息为 10 元,对应费率为 0.4%,则其可得到的基金份额计算如下:

净认购金额=10,000/(1+0.4%)=9,960.16 元

认购费用=10,000 - 9,960.16=39.84 元

认购份额= 9,960.16 + 10)/1.00=9,970.16 份

即投资者投资 10,000 元认购 A 类基金份额,可得到 9,970.16 份基金份额。

2)、场外认购 C 类基金份额的份额计算:

认购份额=(认购金额+认购资金利息)/1.00 元

例二:某投资者投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额,假设这 10,000 元在募集期间产生的利息为 10 元,则其可得到的基金份数计算如下:

认购份额=(10,000+10)/1.00=10,010 份

即投资者投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额,加上募集期间利息后一共可以得到 10,010 份 C 类基金份额。

3)、场内认购 A 类基金份额的计算

场内认购采用份额认购的方式。计算公式为:

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=利息挂牌价格

场内认购金额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入。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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位(最小单位为 1 份),余额计入基金财产。

例三:某投资者认购本基金 A 类基金份额 10,000 份,若会员单位设定发售(认购)费率为 0.4%,假定该笔认购产生利息 5.00 元。则认购金额和利息折算的份额为:

挂牌价格=1.00 元

净认购金额=挂牌价格×认购份额=1.00×10,000=10,000 元

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率=1.00×10,000×0.4%=40 元

认购金额=净认购金额+认购费用=10,000+40=10,040 元

利息折算的份额=利息挂牌价格=5.00/1.00=5 份

即:投资者认购 10,000 份 A 类基金份额,需缴纳 10,040 元,若利息折算的份额为 5 份,则总共可得到 10,005 份 A 类基金份额。

(六)认购安排

1、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,详见本基金的发售公告。

2、认购原则:

基金份额的场内认购采用份额认购方式,基金份额的场外认购采用金额认购方式。

3、认购的限制:

投资者认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。

投资者在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。

在基金募集期内,投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次认购单笔最低限额为人民币 5,000 元,追加认购单笔最低限额为人民币 1,000 元;投资者通过直销中心柜台首次认购单笔最低限额为人民币 20,000 元,追加认购单笔最低限额为人民币 1,000 元。

场内认购单笔最低认购份额为 1,000 份,超过 1,000 份的须为 1,000 份的整数倍,且每笔认购最大不超过 99,999,000 份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

4.认购申请的确认:

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。认购的确认以基金合同生效后注册登记机构的确认结果为准。

(七)募集资金利息的处理方式

确认成功的认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资者所有。其中利息的数额以基金注册机构的记录为准。

(八)募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。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)基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,(基金合同)生效;否则(基金合同)不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对(基金合同)生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

(二)基金合同的生效

1、自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效;

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

(三)基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满,不能满足基金备案的条件的,则基金募集失败。基金管理人应当:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(四)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本合同存续期内,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和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的,按其规定办理。

八、基金份额的上市交易

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金 A 类份额的上市交易。

(一)上市交易的证券交易所

深圳证券交易所。

(二)上市交易的时间

本基金 A 类份额拟在基金合同生效后三个月内申请在深圳证券交易所上市交易。

基金份额获准在深圳证券交易所上市的,基金管理人应在基金份额上市日的 3 个工作日前发布基金份额上市交易公告书。

基金上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内后,方可上市交易。

(三)上市交易的规则

1、本基金 A 类份额上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;

2、本基金 A 类份额实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%,自上市首日起实行;

3、本基金 A 类份额买入申报数量为 100 份或其整数倍;

4、本基金 A 类份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;

5、本基金 A 类份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及其他有关规定。

(四)上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

(五)上市交易的行情揭示

本基金 A 类份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示 A 类份额前一交易日的基金份额净值。

(六)上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金 A 类份额上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所相关规定执行。

(七)终止上市的情形和处理方式

本基金 A 类份额终止上市的情形和处理方式遵照深圳证券交易所相关规定。

如果本基金根据法律法规和基金合同的规定变更为 ETF 联接基金后,基金管理人可以向深圳证券交易所申请本基金 A 类份额终止上市,并无需基金份额