嘉实中证主要消费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
登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2014 年 7 月 25 日
公告日期:2014 年 7 月 22 日

一、重要声明与提示

《嘉实中证主要消费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《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,嘉实中证主要消费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、上海证券交易所对本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 2014 年 5 月 16 日《证券时报》上的《嘉实中证主要消费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:嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金
2. 基金简称:股票型
3.基金运作方式:交易型开放式
4.基金二级市场交易简称:主要消费
5.基金二级市场交易代码:512600
6.截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日基金份额总额:236,951,224.00 份。
7.截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日基金份额净值:1.0164 元。
8.本次上市交易的基金份额:236,951,224.00 份
9.上市交易的证券交易所:上海证券交易所
10.上市交易日期:2014 年 7 月 25 日
11.基金管理人:嘉实基金管理有限公司
12.基金托管人:中国银行股份有限公司
13.登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司
14.申购赎回代理券商:长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中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【2013】917 号
2.基金合同生效日:2014 年 6 月 13 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:2014 年 5 月 19 日至 2014 年 6 月 6 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 种方式认购本基金。
8.发售机构:
1)本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。
2)本基金管理人办理网下现金认购及网下股票认购。
3)网下股票发售代理机构为:

中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、中航证券有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、长江证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、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、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国信证券股份有限公司

验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

9.募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为 236,945,556.00 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 5,668.00 元人民币。本次募集所有资金已于 2014 年 6 月 12 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嘉实中证主要消费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 2,287 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 236,951,224.00 份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10.本基金募集备案情况:本基金于 2014 年 6 月 12 日验资完毕,2014 年 6 月 12 日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于 2014 年 6 月 13 日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。

11.基金合同生效日:2014 年 6 月 13 日

12.基金合同生效日的基金份额总额:236,951,224.00 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,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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:上海证券交易所【2014】399 号
2.上市交易日期:2014 年 7 月 25 日
3.上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4.基金二级市场交易简称:主要消费
5.基金二级市场交易代码:512600
6.本次上市交易份额:236,951,224.00 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

截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日,本基金持有人户数为 2,287 户,平均每户持有的基金份额为 103,607.88 份。

截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日,机构投资者持有的基金份额为 90,943,846.00 份,占基金总份额的比例为 38.38%;个人投资者持有的基金份额为 146,007,378.00 份,占基金总份额的比例为 61.62%。

(二)基金份额前十名持有人情况

截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 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	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	20,001,699.00	8.4413%
2	中意人寿保险有限公司-分红-团体年金债券、基金账户	10,001,350.00	4.2208%
3	中信证券股份有限公司	8,000,000.00	3.3762%
4	海通证券股份有限公司	7,900,000.00	3.3340%
5	华西证券-建行-华西证券融诚 2 号集合资产管理计划	7,000,945.00	2.9546%
6	东方证券股份有限公司	7,000,000.00	2.9542%
7	中国银河证券股份有限公司	7,000,000.00	2.9542%
8	山西华银投资担保有限公司	5,000,000.00	2.1101%
9	银河证券-建行-银河木星 1 号基金精选集合资产管理计划	4,999,674.00	2.1100%
10	陈毓颖	4,150,000.00	1.7514%
合计		81,053,668.00	34.2068%

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%,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

(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)股票投资决策委员会由公司总经理、总经理助理、总监及资深基金经理组成,负责指导权益类基金资产的运作、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、人员情况

截至 2014 年 6 月 30 日,我公司共有 513 名员工,其中博士学位 25 人、硕士学位 260 人、学士学位 212 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 2014 年 7 月 5 日,基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、62 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、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 300ETF 联接(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、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E。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

何如女士,硕士研究生,8 年证券从业经历。曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司,任产品管理部高级产品经理职位,负责指数产品及 ETF 创新产品的设计与开发、指数研究及产品管理工作;2012 年 9 月加入指数投资部,先后担任基金经理助理、基金经理职位。2014 年 5 月 9 日至今任嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接基金经理。2014 年 6 月 13 日至今任嘉实中证医药卫生 ETF 基金经理。2014 年 6 月 20 日至今任嘉实中证金融地产 ETF 基金经理。2014 年 6 月 13 日至今任本基金基金经理。

(二)基金托管人
1、公司概况
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:人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年,现有员工 110 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、境外三类机构银行间债券、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、产品丰富的托管产品体系。在国内,中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

3、基金托管业务经营情况

截至 2014 年 6 月 30 日,中国银行已托管 276 只证券投资基金,其中境内基金 251 只,QDII 基金 25 只,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(特殊普通合伙)
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:洪磊
经办注册会计师:许康玮、洪磊

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。

截至公告前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日,本基金的资产负债表(未经审计)如下:

资 产	2014年 7 月 18 日
资 产:	
银行存款	314,533.93
结算备付金	4,157,886.91
存出保证金	17,056.35
交易性金融资产	92,882,001.02
其中:股票投资	92,882,001.02
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	143,800,000.00
应收证券清算款	1,645,501.33
应收利息	42,014.23
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	242,858,993.77
负债和所有者权益	2014年 7 月 18 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	1,873,839.94
应付赎回款	-
应付管理人报酬	58,746.01
应付托管费	11,749.20
应付销售服务费	-
应付交易费用	59,224.19
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	22,244.35
负债合计	2,025,803.69
所有者权益:	
实收基金	236,951,224.00
未分配利润	3,881,966.08
所有者权益合计	240,833,190.08
负债和所有者权益总计	242,858,993.77

八、基金投资组合

截至公告日前两个工作日即 2014 年 7 月 18 日,本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	92,882,001.02	38.25
	其中:股票	92,882,001.02	38.25
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	143,800,000.00	59.21
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,472,420.84	1.84
7	其他资产	1,704,571.91	0.70
	合计	242,858,993.77	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	7,207,661.00	2.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,066,207.79	28.68
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	14,439,346.38	6.00
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	-	-
L	租赁和商务服务业	2,168,785.85	0.90
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	92,882,001.02	38.57

2.积极投资按行业分类的股票投资组合

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有积极投资股票。

(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

1.指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	600519	贵州茅台	64,831	10,436,494.38	4.33
2	600887	伊利股份	423,727	9,461,823.91	3.93
3	000858	五 粮 液	332,200	6,411,460.00	2.66
4	000895	双汇发展	115,500	3,803,415.00	1.58
5	600518	康美药业	269,400	3,768,906.00	1.56
6	002304	洋河股份	56,500	3,218,805.00	1.34
7	600315	上海家化	82,315	2,806,941.50	1.17
8	600600	青岛啤酒	60,850	2,442,519.00	1.01
9	000061	农 产 品	237,545	2,168,785.85	0.90
10	000568	泸州老窖	122,300	2,115,790.00	0.88

2.积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有积极投资股票。

(四)按债券品种分类的债券投资组合

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有债券。

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有债券。

(六)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有资产支持证券。

(七)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

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有贵金属投资。

(八)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有权证。

(九)本基金投资的股指期货交易情况说明

2014 年 7 月 18 日,本基金未参与股指期货交易。

(十)本基金投资的国债期货交易情况说明

2014 年 7 月 18 日,本基金未参与国债期货交易。

(十一)投资组合报告附注

1、2014 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 7 月 18 日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、2014 年 7 月 18 日其他资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,056.35
2	应收证券清算款	1,645,501.33
3	应收股利	-
4	应收利息	42,014.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,704,571.91

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

1)指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2014 年 7 月 18 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)积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2014 年 7 月 18 日,本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同已于 2014 年 6 月 13 日正式生效,基金管理人于 2014 年 6 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》。

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、上海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)中国证监会核准嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
(二)《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
(三)《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
(四)《嘉实中证主要消费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嘉实中证主要消费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
2014 年 7 月 22 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、代销机构、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发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已缴纳的认购款项、股票及其孳息在基金募集期结束后 30 日内返还基金认购人;
(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)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、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)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、议事及表决的程序和规则

(一)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,但因本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。

(二)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。

(三)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,在指定媒体公告。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。

(四)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证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,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。

(五)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。

(六)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。

(七)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。

(八)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 个工作日内在指定媒体上公告。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。

(九)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。

(十)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、基金收益分配原则、执行方式

(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,基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

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。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

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:

$H=E\times0.5\%\div$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:

$H=E\times0.1\%\div$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。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益,对上述计提方式进行合理变更并公告。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、指数许可使用费之外的基金费用,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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)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,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(包含中小板、创业板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。

(二)投资限制

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,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)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。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对本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本基金合同生效之日起开始。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)《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。

(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;

(三)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。

(四)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。

(五)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。

(六)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。

八、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。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《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。