嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII- LOF)更新招募说明书摘要

（2017年第2号）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII- LOF)（以下简称“本基金”）根据2010年4月19日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可［2010］479号文）核准进行募集。本基金基金合同于2010年9月30日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

重要提示

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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。

基金管理人承诺依照恪尽职守，诚实信用、谨慎勤勉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。

本摘要所载内容截止日为2017年9月30日（特别事项注明截止日除外），有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（未经审计）。

一、基金的名称

本基金名称：嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII- LOF)

二、基金的类型

上市契约型开放式，股票型证券投资基金。

三、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，年跟踪误差不超过4%，以实现对恒生中国企业指数的有效跟踪，给投资者提供一个投资恒生中国企业指数的有效投资工具。

四、基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股、备选股、同一标的指数的ETF、以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、同一标的指数的股指期货、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%；权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在合理期限内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。

五、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为被动式指数基金，按照成份股在恒生中国企业指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金可以投资于同一标的指数的ETF，基金管理人可在香港恒生国企指数成份股和同一标的指数的ETF之间选择较优的方式实施组合构建，以达到节约成本和更好地跟踪标的指数的目的。

1.资产配置策略

作为被动式指数基金，本基金主要投资于恒生中国企业指数成份股和备选成份股。本基金将根据市场的实际情况，投资于金融衍生产品，以保证对标的指数的有效跟踪。

2.股票组合构建

（1）股票投资原则：

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据恒生中国企业指数成份股的基准权重构造股票指数化投资组合。

（2）股票组合构建方法：

本基金原则上采用指数复制法，按照成份股在基准指数恒生中国企业指数的基准权重构建股票投资组合。如有(a)因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股，或(b)预期标的指数的成份股即将调整，或(c)其他影响指数复制的因素，基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，对本基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，获得更接近基准指数的收益率。

（3）本基金投资ETF主要基于以下策略：(a)根据ETF的折溢价情况，在标的指数成份股和ETF之间选择较优的方式实施组合构建；(b)根据ETF折溢价情况，参与ETF套利，以增加基金投资收益；(c)日常基金申购赎回通过ETF构造投资组合，以避免申购赎回而导致的成份股频繁交易所带来的交易成本和交易冲击。

（4）金融衍生产品投资

本基金部分投资于金融衍生产品，以降低跟踪成本和提高投资管理效率。

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与金融衍生产品投资。投资策略主要包括：利用汇率衍生产品，以降低基金汇率风险；利用指数衍生产品，以应对申购赎回对基金跟踪效果的影响和提高投资管理效率；等等。

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加投资收益。未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并按照相关规定发布临时公告。

（二）投资管理体制

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1.投资决策委员会

负责本基金的整体战略和原则审定；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

2.定量策略小组

跟踪并研究标的指数资料信息，计算标的指数的成份股基准权重、预测成份股调整清单，为本基金投资管理提供基础数据支持；根据基金投资组合与标的指数权重差异提出投资组合调整建议；定期提供基金风险控制报告和绩效评估报告；基金经理提出的其他技术需求支持。

3.基金经理

在定量策略小组的技术支持下，负责基金投资组合的构建与日常管理。

（二）投资程序

1.投资分析

定量策略小组根据标的指数的相关资料和数据，利用数量模型进行历史模拟和风险测算；行业分析师对标的指数成份股的基本面情况进行实时跟踪，对基本面恶化的上市公司提供及时的风险分析报告，在此基础上形成投资组合调整建议

在投资组合调整建议的基础上，基金经理结合本基金的投资总体目标和原则，以及本基金投资组合状况，确定投资组合调整方案。

投资决策委员会定期召开会议，审定基金经理提交的投资检讨报告，并提出指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见，在基金经理的权限内管理投资组合。对超出基金经理权限的投资指令须报投资决策委员会审议批准。

2.资产配置

本基金采取自上而下的资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，然后再分别确定下一层次股票资产和现金资产的配置。

本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%；权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在合理期限内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。

为尽可能降低本基金的跟踪误差，本基金在保证应对基金赎回和日常投资管理所必须的流动性需求的前提下，将尽量降低现金资产的持有比例。

3.组合构建

在股票资产配置上，本基金首先按照基准指数的行业权重，确定各行业的资产配置比例，然后按照行业内各个股的成份股权重，确定各个股的资产配置比例。对于因股票停牌、流动性和其他因素而无法投资的个股，本基金将尽量用本行业的个股或个股组合进行替代，以保证各行业的资产配置比例和基准指数的行业权重保持一致。如有(a)因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素，使基金管理人人无法依指数权重购买某成份股，或(b)预期标的指数的成份股即将调整，或(c)其他影响指数复制的因素，基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，对本基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，获得更接近基准指数的收益率。

4.交易执行

基金经理在定量策略小组和行业分析师报告的基础上，结合市场情况和本基金的风险状况，进行投资组合的日常管理，向基金交易部下达投资指令。

基金交易部执行投资指令的同时对交易执行情况进行监控，并将最终的完成情况及时向基金经理汇报。

基金经理交易结果进行评估并形成报告。

5.风险绩效评估

本基金的投资评价指标有两个：跟踪误差和累计偏差。跟踪误差衡量本基金与标的指数的拟合偏离程度，力争控制本基金的净值增长率与基准指数增长率之间的日平均跟踪误差小于0.3%，年跟踪误差不超过4%；累计偏差是指衡量期间内本基金相对于标的指数的累计收益率，在相同跟踪误差水平的情况下，累计偏差的正收益比负收益好。

6.投资组合调整

本基金以拟合基准指数为基本原则，股票指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、基金合同中的资产配置比例约定、申购赎回情况、新股等因素，对股票指数化投资组合进行适当调整，以保证基金对基准指数的有效跟踪。

六、基金的业绩比较基准

本基金标的指数是恒生中国企业指数。

本基金的业绩基准为：人民币/港币汇率×恒生中国企业指数

七、基金的风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

八、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月17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2017年6月30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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	721,352,483.61	64.73
	其中：普通股	721,352,483.61	64.73
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	344,398,429.77	30.91
8	其他资产	48,624,953.93	4.36
9	合计	1,114,375,867.31	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 26,290,914.60元，占基金资产净值的比例为3.45%。

2.报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	721,352,483.61	94.75
合计	721,352,483.61	94.75

3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

(1)报告期末按照行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	22,440,479.52	2.95
必需消费品	–	–
能源	82,566,144.38	10.85
金融	518,361,931.50	68.09
医疗保健	11,029,527.36	1.45
工业	40,967,455.69	5.38
原材料	8,777,600.43	1.15
房地产	7,611,033.50	1.00
电信服务	12,809,093.17	1.68
公用事业	16,789,218.06	2.21
合计	721,352,483.61	94.75

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类。

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票及存托凭证。

5.报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

9.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基金投资明细

报告期末，本基金未持有基金。

10.投资组合报告附注

(1)

报告期内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)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	2,041.58
2	应收证券清算款	28,564,014.95
3	应收股利	19,883,982.75
4	应收利息	52,679.94
5	应收申购款	122,234.71
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	48,624,953.93

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(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

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

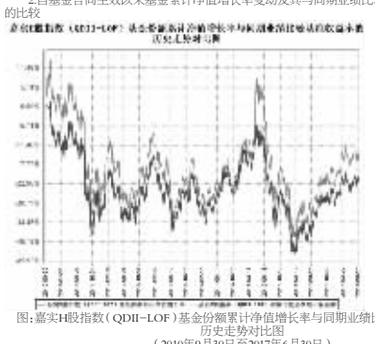
九、基金的业绩

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。

1. 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
自基金合同生效日至2010年12月31日	-9.96%	0.98%	0.71%	1.39%	-10.67%	-0.41%
2011年	-23.03%	1.86%	-25.41%	1.95%	2.38%	-0.09%
2012年	15.44%	1.22%	15.11%	1.30%	0.33%	-0.08%
2013年	-6.00%	1.30%	-8.29%	1.39%	2.29%	-0.09%
2014年	14.88%	1.11%	11.18%	1.18%	3.70%	-0.07%
2015年	-19.79%	1.63%	-14.39%	1.79%	-5.40%	-0.16%
2016年	3.56%	1.32%	3.83%	1.42%	-0.27%	-0.10%
2017年上半年	7.94%	0.84%	7.05%	0.86%	0.89%	-0.02%

2.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



图：嘉实H股指数（QDII-LOF）基金份额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

（2010年9月30日至2017年6月30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个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十四（二）投资范围和Ⅰ(六)1、组合投资比例限制）的有关约定。

十、基金管理人

（一）基金管理人概况

1.基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	邓红国
总经理	赵学军
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%，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%。
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

（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

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月2日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010年11月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。2016年8月至今任中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长。

Jonathan Paul Eilbeck先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问，JP Morgan固定收益亚太区CFO、COO，JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，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。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事，中共党员，教授，加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授，清华大学商法研究中心副主任，《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

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。

穆胖先生，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。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

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，历任督察员和公司副总经理。

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。

邵捷先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

陈正宪先生，12年证券从业经历。曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。2016年1月5日至今任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理,2016年3月24日至今任嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实中创400ETF及其联接基金经理，2017年6月7日至今任嘉实中关村A股ETF基金经理，2017年6月29日至今任嘉实富时中国A50ETF联接基金经理，2017年7月3日至今任嘉实富时中国A50ETF基金经理，2017年7月15日至今任嘉实创业板ETF基金经理。2016年1月5日至今任本基金基金经理。

何如女士，硕士研究生，12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，现任指数投资部执行副总监及基金经理。2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理。2014年6月13日至今任嘉实中证主要消费ETF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，2015年8月6日至今任嘉实中证金融地产ETF联接基金经理，2016年1月5日任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、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）,嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接以及本基金基金经理。2017年6月29日至今任嘉实富时中国A50ETF联接基金经理，2017年7月3日至今任嘉实富时中国A50ETF基金经理，2017年7月14日至今任嘉实创业板ETF基金经理。

（2）历任基金经理：

张宏民先生自2010年9月30日至2013年1月25日任本基金基金经理。

杨阳先生自2013年1月25日至2014年3月11日任本基金基金经理。

杨宇先生自2013年2月6日至2016年1月5日任本基金基金经理。

3.海外投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，海外投资决策委员会的成员包括：嘉实国际行政总裁Peng Wah Choy、嘉实国际首席投资官 Thomas Kwan、高级基金经理Yi Qian Jiang,June Chua,风险管理经理 Patrick Chan。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

资产负债稳步增长。2016年末，本集团资产总额20.96万亿元，较上年增加2.61万亿元，增幅14.25%，其中客户贷款总额11.76万亿元，较上年增加1.27万亿元，增幅12.13%。负债总额19.37万亿元，较上年增加2.47万亿元，增幅14.61%，其中客户存款总额15.40万亿元，较上年增加1.73万亿元，增幅12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润2,323.89亿元，较上年增长1.53%。手续费及佣金净收入1,185.09亿元，在营业收入中的占比较上年提升0.83个百分点。平均资产回报率1.18%，加权平均净资产收益率15.44%，净利息收益率2.20%，成本收入比为27.49%，资本充足率14.94%，均居同业领先水平。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在美国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部、下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年一季度末，中国建设银行已托管719只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

十二、境外资产托管人

（一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Joseph L. Hooley

成立时间：1891年4月13日。

最近一个会计年度（截止到2017年6月30日）所有者权益（Shareholders’ Equity）：220.68亿美元

（二）托管资产规模、国际信用评级和托管业务

道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于1891年，自1924年成为美国第一个共同基金的托管人后，道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至2017年6月30日，托管和行政管理资产总额已达到31.04万亿美元，一级资本比率为15.2%。道富银行长期存款信用评级为AA-（标准普尔）及Aa1（穆迪投资）。道富银行在全球30多个国家或地区设有办事处，2016年12月31日道富拥有超过3万3千多名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务。在亚洲开设了四个全方位的营运中心：香港、新加坡、东京及悉尼，提供全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

（三）境外托管人的职责

1.安全保管受托财产；

2.计算境外受托资产的资产净值；

3.按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；

4.按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；

5.按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；

6.保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；

7.其他由基金托管人委托其履行的职责。

十三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街7号万豪中心D座 12层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	赵佳		

（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2期53层09-11单元		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	邵琦		

（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元		
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	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦16层		
电话	(0755)84362200	传真	(0755)25870663
联系人	陈寒梦		

（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室		
电话	(0532)66777766	传真	(0532)66777676
联系人	胡洪峰		

（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城2幢1001A室		
电话	(0571)88061392	传真	(0571)88021391
联系人	王振		

（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137号信合广场801A单元		
电话	(0591)88013670	传真	(0571)88021391
联系人	吴志锋		

（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	徐莉莉		

（9）嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心50层05-06A单元		
电话	(020)88832125	传真	(020)81552120
联系人	周祎		

2.场外代销机构

（1）中国工商银行股份有限公司

住所,办公地址	北京市西城区复兴门内大街55号		
法定代表人	易会满	联系人	杨菲
传真	010-66107914		
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

（2）中国农业银行股份有限公司

住所,办公地址	北京市东城区建国门内大街69号		
法定代表人	周慕冰		
电话	(010)85108227	传真	(010)85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

（3）中国银行股份有限公司

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		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街1号		
法定代表人	田国立		
电话	(010)66596688	传真	(010)66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

（4）中国建设银行股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街25号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心		
法定代表人	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

（5）交通银行股份有限公司

办公地址	上海市银城中路188号		
注册地址	上海市银城中路188号		
法定代表人	牛锦明	联系人	张宏革
电话	(021-58781234	传真	(021-58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

（6）中信银行股份有限公司

住所,办公地址	北京市东城区朝阳门北大街9号		
法定代表人	李庆萍	联系人	兰荣超峰
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

（7）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址	上海市中山东一路12号		
注册地址	上海市中山东一路12号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	高天,虞谷云
电话	(021)61618888	传真	(021)63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

（8）中国光大银行股份有限公司

注册地址	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦		
法定代表人	唐双宁	联系人	朱红
电话	(010)63636153	传真	010-63639709
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595

（9）中国民生银行股份有限公司

住所,办公地址	北京市西城区复兴门内大街2号		
法定代表人	洪崎	联系人	王志刚
电话	(010)58560666