(上接 B77 版)

住所	杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心		
办公地址	浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201,501,502,1103,1601–1615,1701–1716 室		
注册地址	浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201,501,502,1103,1601–1615,1701–1716 室		
法定代表人	陆建强	联系人	陶志华
电话	0571 – 87789160	传真	0571–87818329
网址	http://www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336、962336(上海地区)

(109)上海华信证券有限责任公司

办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼		
法定代表人	陈灿辉	联系人	倪丹
电话	021–38784818?	传真	021–68775878
网址	http://www.shhxzq.com/	客服电话	68777877

(110)华鑫证券有限责任公司

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元		
办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元		
注册地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元		
法定代表人	俞洋	联系人	杨莉娟
电话	021–54967552	传真	021–54967032
网址	http://www.cfsc.com.cn	客服电话	021 –32109999;029 –68918888;4001099918

(111)瑞银证券有限责任公司

住所	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12、15 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
法定代表人	钱于军	联系人	牟冲
电话	(010)58328112	传真	(010)58328748
网址	http://www.ubssecurities.com	客服电话	400–887–8827

(112)中国中投证券有限责任公司

住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层–21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元		
办公地址	深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18–21 层		
注册地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18–21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元		
法定代表人	高涛	联系人	胡芷境
电话	0755–88320851	传真	0755–82026539
网址	http://www.china–invs.cn	客服电话	400 600 8008

(113)中山证券有限责任公司

办公地址	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层		
注册地址	深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层		
法定代表人	黄扬录	联系人	罗艺琳
电话	0755–82570586	传真	0755–82960582
网址	http://www.zszq.com.cn	客服电话	95329

(114)国融证券股份有限公司

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	呼和浩特市新城区锡林南路 18 路		
注册地址	内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼		
法定代表人	张智河	联系人	董晶姗
电话	(010)83991737	传真	(010)66412537
网址	http://www.grzq.com	客服电话	4006609839

(115)联讯证券股份有限公司

办公地址	广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层		
注册地址	广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层		
法定代表人	徐刚	联系人	彭莲
电话	0755–83331195		
网址	http://www.lxsec.com	客服电话	95564

(116)江海证券有限公司

办公地址	哈尔滨市松北区创新三路 833 号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊
电话	0451–85863726	传真	0451–82337279
网址	http://www.jhzq.com.cn/	客服电话	400–666–2288

(117)国金证券股份有限公司

办公地址	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼		
注册地址	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	刘婧漪、贾鹏
电话	028 –86690057、028 –86690058	传真	028–86690126
网址	http://www.gjzq.com.cn	客服电话	95310

(118)中国民族证券有限责任公司

住所	北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层		
办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层–43 层		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼		
法定代表人	何亚刚	联系人	齐冬妮
电话	(010)59355807	传真	(010)56437013
网址	http://www.e5618.com	客服电话	400–889–5618

(119)华宝证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	http://www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

(120)长城国瑞证券有限公司

住所	厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼		
办公地址	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼		
注册地址	厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼		
法定代表人	王勇	联系人	林丹
电话	(0592)2079259	传真	(0592)2079602
网址	https://www.gwgsc.com/	客服电话	400–0099–886

(121)爱建证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼(陆家嘴商务广场)		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
法定代表人	祝健	联系人	陈敏
电话	(021)32229888	传真	021– 68728782
网址	http://www.ajzq.com	客服电话	(021)63340678

(122)英大证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	吴骏	联系人	杨洪飞
电话	0755–83007323	传真	0755–83007034
网址	http://www.vsun.com	客服电话	4000–188–688

(123)华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 8 号		
办公地址	北京朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 18 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 8 号		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010–85556100	传真	010–85556088
网址	http://www.hrsec.com.cn	客服电话	400–898–4999

(124)天风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼		
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼		
法定代表人	余磊	联系人	岑妹妹
电话	027–87617017	传真	027–87618863
网址	http://www.tfzq.com	客服电话	4008005000

(125)宏信证券有限责任公司

办公地址	成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼		
注册地址	成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028–86199278	传真	028–86199382
网址	http://www.hx818.com	客服电话	4008366366

(126)泉州银行股份有限公司

办公地址	泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
注册地址	泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
法定代表人	傅子能	联系人	董培姗、王燕玲
电话	0595–22551071	传真	0595–22578871
网址	http://www.qzccbank.com/	客服电话	4008896312

(127)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006		
注册地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋 10 层 1006		
法定代表人	马勇	联系人	文雯
电话	010–83363101	传真	010–83363072
网址	http://www.xinlande.com.cn	客服电话	400–118–1166

(128)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

办公地址	杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室		
注册地址	浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室		
法定代表人	陈柏青	联系人	韩爱彬
电话	021–60897840	传真	0571–26697013
网址	http://www.fund123.cn	客服电话	4000–766–123

(129)北京汇成基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室		
注册地址	北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号		
法定代表人	王伟刚	联系人	丁向坤
电话	010–56282140	传真	010–62680827
网址	http://www.hcjijin.com/	客服电话	400–619–9059

(130)北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室		
注册地址	北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室		
联系人	付文红		
电话	010–62676405	传真	010–62676582
网址	http://www.xincai.com	客服电话	010–62675369

(131)上海万得基金销售有限公司

办公地址	中国(上海)浦东新区福山路 33 号 9 楼		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座		
法定代表人	王廷富	联系人	姜吉灵
电话	021–68882280	传真	021–68882281
网址	https://www.520fund.com.cn/	客服电话	400–821–0203

(132)凤凰金信(银川)基金销售有限公司

办公地址	宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路 142 号 14 层办公房		
注册地址	宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房		
法定代表人	程刚	联系人	张旭
电话	010–58160168	传真	010–58160173
网址	http://www.fengfd.com/	客服电话	400–810–55919

(133)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址	北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603–06		
注册地址	北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401–15		
法定代表人	江卉	联系人	江卉
电话	4000988511	传真	010–89188000
网址	https://keterui.jd.com/	客服电话	400–088–8816

(134)北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507		
注册地址	北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507		
法定代表人	钟斐斐	联系人	袁永姣
电话	010–61840688	传真	010–61840699
网址	http://www.ncfjj.com	客服电话	4000–618–518

(135)深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址	广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座		
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)经营场所:深圳市南山区田厦国际中心 36 楼、37 楼		
法定代表人	顾敏	联系人	苏豪
电话	13469952231	传真	0755–86700688
网址	http://www.webank.com/	客服电话	400–999–8877

(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。

(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		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号		
法定代表人	金颖	联系人	程爽
电话	(010)59378982	传真	(010)58598907

(四)律师事务所和经办律师

名称	北京市金杜律师事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层		
负责人	王玲	联系人	彭晋
电话	(010)5878 5588	传真	(010)58785566
经办律师	彭晋、唐丽子		

(五)会计师事务所和经办注册会计师

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	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021)23238888	传真	(021)23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

四、基金的名称

嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

本基金类型:上市契约型开放式,股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股、备选股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、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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 10 个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

八、基金的投资策略

本基金采取完全指数复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不超过 4%。在跟踪误差允许的情况下,本基金投资于标的指数成份股、备选股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、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。本基金的固定收益类证券投资范围包括国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、短期融资券、回购(包括正回购和逆回购)、资产支持证券等。

如果未来法律法规或监管机构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。

本基金投资将遵照:

1.决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作,基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

3.投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究:指数投资研究人员依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:基金经理根据标的指数相关信息,结合内部指数投资研究,以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的投资方法,以降低投资成本、控制投资风险。

(4)交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:投资流程与风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

九、基金的业绩比较基准

95% × 中证锐联基本面 50 指数收益率 + 5% × 银行同业存款收益率

十、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。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 7 月 16 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 2018 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,557,167,880.62	93.46
	其中:股票	1,557,167,880.62	93.46
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	30,069,000.00	1.80
	其中:债券	30,069,000.00	1.80
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	68,464,402.08	4.11
8	其他资产	10,382,852.93	0.62
9	合计	1,666,084,135.63	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末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	–	–
B	采矿业	91,163,745.28	5.54
C	制造业	246,314,439.18	14.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,601,145.12	3.92
E	建筑业	158,689,474.35	9.64
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	25,192,861.44	1.53
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,561,722.08	1.61
J	金融业	866,419,247.44	52.64
K	房地产业	77,881,005.00	4.73
L	租赁和商务服务业	–	–
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	1,556,823,639.89	94.58

(2)报告期末积极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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	191,454.74	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
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	344,240.73	0.02

3.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股票投资明细

(1)报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	601318	中国平安	2,020,882	118,383,267.56	7.19
2	601328	交通银行	14,153,595	81,241,635.30	4.94
3	601166	兴业银行	5,413,405	77,953,032.00	4.74
4	601668	中国建筑	14,193,710	77,497,656.60	4.71
5	600016	民生银行	11,050,706	77,354,942.00	4.70
6	600036	招商银行	2,730,051	72,182,548.44	4.39
7	601288	农业银行	19,555,729	67,271,707.76	4.09
8	600104	上汽集团	1,551,449	54,285,200.51	3.30
9	600000	浦发银行	5,506,376	52,640,954.56	3.20
10	601398	工商银行	9,769,595	51,974,245.40	3.16

(2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
2	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
3	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
4	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
5	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	30,069,000.00	1.83
	其中:政策性金融债	30,069,000.00	1.83
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	30,069,000.00	1.83

5.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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170413	17农发 13	300,000	30,069,000.00	1.83

注:报告期末,本基金仅持有上述 1 支债券。

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。

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五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1)2018 年 1 月 19 日,上海浦东发展银行股份有限公司发布《上海浦东发展银行股份有限公司关于成都分行行政处罚事项公告》,公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书(川银监罚决字【2018】2 号),对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款 46,175 万元人民币。 2018 年 5 月 4 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕4 号),对上海浦东发展银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,通过资管计划投资分行协议存款、虚增一般存款等违规事实,于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定,罚款 5845 万元,没收违法所得 10.927 万元,罚没合计 5855.927 万元。

2018 年 5 月 4 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1 号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定,罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。

2018 年 5 月 4 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕1 号),对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产等违规事实,于 2018 年 4 月 19 日作出行政处罚决定,罚款 5870 万元。

本基金投资于"浦发银行(600000)","招商银行(600036)","兴业银行(601166)"的决策程序说明:本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,浦发银行,招商银行,兴业银行为标的指数的成份股,本基金投资于"浦发银行","招商银行","兴业银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他七名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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(元)
1	存出保证金	436,601.78
2	应收证券清算款	5,301,720.14
3	应收股利	–
4	应收利息	782,089.63
5	应收申购款	3,862,441.38
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,382,852.93

(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

5.1 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。

5.2 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603693	江苏新能	48,456.00	0.00	未上市
2	603706	东方环宇	23,103.85	0.00	未上市

十二、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
基金合同生效日(2009 年 12 月 30 日)–2009 年 12 月 31 日	0.00%	0.00%	3.04%	1.79%	–3.04%	–1.79%
2010年	–26.11%	1.42%	–27.49%	1.45%	1.38%	–0.03%
2011年	–14.56%	1.12%	–14.65%	1.12%	0.09%	0.00%
2012年	11.28%	1.01%	9.81%	1.02%	1.47%	–0.01%
2013年	–10.82%	1.39%	–12.34%	1.38%	1.52%	0.01%
2014年	77.24%	1.33%	72.20%	1.34%	5.04%	–0.01%
2015年	5.21%	2.38%	5.10%	2.35%	0.11%	0.03%
2016年	3.87%	1.11%	1.04%	1.04%	2.83%	0.07%
2017年	28.12%	0.65%	24.91%	0.65%	3.21%	0.00%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	–10.28%	1.12%	–11.04%	1.12%	0.76%	0.00%

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

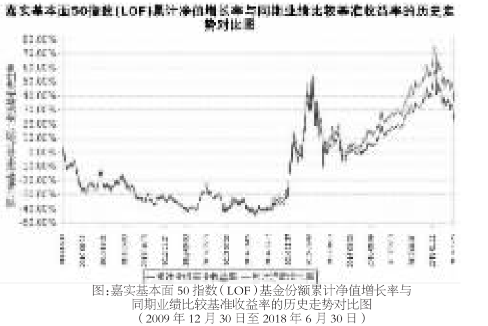

图:嘉实基本面 50 指数(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 12 月 30 日至 2018 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(十一(三)投资范围和(七)2、基金投资组合限制)的有关约定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金合同生效后的指数许可使用费;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(8)基金的银行汇划费用;

(9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(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 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等,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 0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.18%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 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每日计提指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用,不列入基金费用;基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支,按前一日基金资产净值及指数许可使用费年费率每日计提,逐日累计。计算方法如下:

H=E×I÷当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

I 为基金管理人与本基金的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年费率。

根据指数使用许可协议,标的指数许可方收取的指数许可使用费年费率设定如下:

如果本基金前一季度日均基金资产净值超过或等于 40 亿元,则指数许可基点费按照万分之九的年费率计提;如果前一季度日均基金资产净值不足 40 亿元,则指数许可基点费按照万分之十的年费率计提。

基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币伍万元(5 万元)的收取下限,则该下限超出当季累计指数使用费的部分(即:每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费)由基金管理人自行承担,不作为基金费用从基金财产中列支。

基金合同生效后的指数许可使用费按季支付,由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述 1、基金费用的种类中第(4)–(8)项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%,具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<100 万元	1.2%
100万元≤M<200 万元	0.8%
200万元≤M<500 万元	0.4%
M≥500 万元	单笔 1000 元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的 0.6%,但中国银行长城借记卡、中国农业银行借记卡持卡人,申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行;机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%,则按 0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6%时,按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的,前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

注:2013 年 4 月 9 日,本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》,自 2013 年 4 月 12 日起,在本公司基金网上直销系统开通旗下部分基金产品的后端收费模式(包括申购、定期定额投资、基金转换等业务),并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、赎回费

(1)本基金的场内赎回费率具体如下:

持有期限(M)	赎回费率
M<7 天	1.50%
M≥7 天	0.50%

(2)本基金的场外赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,具体如下:

持有期限(M)	赎回费率
M<7 天	1.50%
7天≤M<365 天	0.50%
365天≤M<730 天	0.25%
M≥730 天	0

(3)赎回费用由基金份额持有人承担,其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;除此之外的赎回费 25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、转换费

(1)嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)与嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)场外基金份额、嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)A/C 类场外份额之间互相转换时,基金转换费率采用"赎回费 + 申购费率补差"算法,计算公式如下:

净转入金额 = B×C×(1–D)/(1+G)

转换补差费用 = [B×C×(1–D)/(1+G)]×G

转入份额 = 净转入金额 / E

其中,B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

G 为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率时,则申购补差费率 G 为零;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;除此之外的赎回费的 25%归入转出基金资产(嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 除外);根据嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同的约定,对于持有期限少于 30 日的 C 类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

(2)通过直销(直销柜台及网上直销)办理基金转换业务("前端转前端"的模式)

转出基金有赎回费用的,收取该基金的赎回费用。从 0 申购费用基金向非 0 申购费用基金转换时,每次按照非 0 申购费用基金申购费用收取申购补差费;非 0 申购费用基金互转时,不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的,转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

基金转换份额的计算方式如下:

转出基金金额 = 转出份额 × 转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用 = 转出基金金额 × 转出基金赎回费率

转换费用 = 转出基金赎回费用 + 申购补差费用

净转入金额 = 转出基金金额 – 转换费用

转入份额 = 净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

其中:① 若转出基金为 0 申购费用基金,则申购补差费用 = 转入基金申购费用,即:

申购补差费用 =(转出基金金额 – 转出基金赎回费用)× 转入基金申购费率 ÷(1+ 转入基金申购费率)

② 若转出基金为非 0 申购费用基金,则申购补差费用 =0

(3)通过网上直销系统办理基金转换业务("后端转后端"模式)

① 若转出基金有赎回费,则仅收取转出基金的赎回费;

② 若转出基金无赎回费,则不收取转换费用。

转出基金有赎回费用的,收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率,调整后的基金转换费率应及时公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易等)或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注:嘉实安心货币、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实信用债券、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实超短债、嘉实多元收益债券、嘉实周期优选混合、嘉实逆向策略股票、嘉实快线货币基金 A、嘉实货币、嘉实新兴产业股票、嘉实优化红利混合有单日单个基金账户的累计申购(转入)限制,嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购和转入业务,具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。定期开放类基金在封闭期内无法转换。

(三)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:

1. 在"重要提示"部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在"三、基金管理人"部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在"四、基金托管人"部分:更新了基金托管人的相关信息。

4.在"五、相关服务机构"部分:更新了代销机构、经办注册会计师的相关信息。

5.在"九、基金份额的申购、赎回"更新了申购赎回的相关内容,并根据相关公告更新了赎回费的相关内容。

6. 在"十二、基金的投资"部分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

7.在"十三、基金的业绩"部分:基金业绩更新至 2018 年第一季度末。

8.在"二十六、其他应披露事项"部分:列示了本基金自 2017 年 12 月 30 日至 2018 年 6 月 30 日相关临时公告事项。

9.根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人 2018 年 3 月 22 日发布的《关于修改嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)基金合同及托管协议的公告》,更新了"基金份额的申购、赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露、风险揭示"等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司
2018 年 8 月 11 日

股票代码:000526　　股票简称:紫光学大　　公告编号:2018–095

厦门紫光学大股份有限公司
关于召开 2018 年度第四次临时股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

厦门紫光学大股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")于 2018 年 8 月 1 日召开第八届董事会第三十一次会议,审议通过《关于公司召开 2018 年第四次临时股东大会的议案》。公司于 2018 年 8 月 2 日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上披露了《关于公司召开 2018 年第四次临时股东大会的通知》(公告编号:2018–091)。公司 2018 年第四次临时股东大会将采用现场表决和网络投票相结合的方式召开。现将有关事项再次提示如下:

一、召开会议的基本情况

1.股东大会届次:2018 年第四次临时股东大会;

2.股东大会的召集人:公司董事会,本公司 2018 年 8 月 1 日召开的第八届董事会第三十一次会议审议通过了《关于召开 2018 年度第四次临时股东大会的议案》;

3.会议召开的合法、合规性:本次股东大会的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所相关业务规则和《公司章程》的规定;

4.会议召开的日期、时间:

现场会议召开的时间:2018 年 8 月 17 日(星期五)14:30 起;

网络投票时间:2018 年 8 月 16 日–8 月 17 日。其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为 2018 年 8 月 17 日 9:30–11:30 和 13:00–15:00 的任意时间;通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的具体时间为 2018 年 8 月 16 日 15:00–2018 年 8 月 17 日 15:00 的任意时间。

5.会议的召开方式:现场表决和网络投票相结合的方式;

6.会议的股权登记日:2018 年 8 月 9 日;

7.出席对象:

(1)截至 2018 年 8 月 9 日下午 3 时交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东。上述本公司全体股东均有权出席股东大会,并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该股东代理人不必是本公司股东;(2)公司全体董事、监事和高级管理人员;(3)公司聘请的律师;(4)根据相关法规应当出席股东大会的其他人员。

8.会议地点:北京市海淀区中关村东路 1 号院清华科技园科技大厦 D 座 5 层会议室。

二、会议审议事项

1.本次临时股东大会将审议表决如下议案:

序号	议案名称	是否为特别决议事项
1	《关于增选严乐平先生为公司第八届董事会董事的议案》	否

2.上述议案内容详见公司于 2018 年 8 月 2 日登载于《证券时报》、《中国证券报》、巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《第八届董事会第三十一次会议决议公告》及《关于增选第八届董事会董事候选人及聘任公司总经理的公告》。

3.上述议案为普通决议事项,须经出席股东大会的股东(包括股东代理人)所持有效表决权股份总数的二分之一以上通过。

本次股东大会审议的议案将对中小投资者的表决单独计票并披露投票结果。

三、提案编码

提案编码	提案名称	备注 该列打勾的栏目可以投票
1.00	《关于增选严乐平先生为公司第八届董事会董事的议案》	√

四、会议登记等事项

(一)登记手续:

1、符合出席会议资格的股东可以亲自到公司证券事务部办理登记,也可以用信函或传真方式登记。

股东办理参加现场会议登记手续时应提供下列材料:

(1)个人股东:本人亲自出席的,出示本人有效身份证件、证券账户卡、持股凭证;委托代理人出席的,代理人出示本人有效身份证件、股东授权委托书、证券账户卡、持股凭证。

(2)法人股东:法定代表人亲自出席的,出示本人有效身份证件、法定代表人资格证书、证券账户卡、持股凭证;委托代理人出席的,代理人出示本人有效身份证件、法定代表人资格证书、法定代表人出具的书面授权委托书、证券账户卡、持股凭证。

(3)外地股东可通过传真或信函方式办理登记手续(信函到达时间应不迟于 2018 年 8 月 14 日下午 17:00)。

授权委托书模版详见附件二。

(二)登记时间:2018 年 8 月 14 日(星期二)9:00–17:00;

(三)登记地点:

联系地址:北京市海淀区中关村东路 1 号院清华科技园科技大厦 D 座 5 层;

邮政编码:100084。

联系电话:010–82151909。

传　　真:010–82158922。

联 系 人:刁月霞

(四)会议费用:出席现场会议股东的食宿、交通等费用自理。

(五)本次股东大会网络投票期间,如网络投票系统遇不可抗力影响而无法正常进行,则本次会议的进程按当日通知进行。

五、参加网络投票的具体操作流程

本次股东大会向全体股东提供网络形式的投票平台,股东可以通过深交所交易系统或互联网投票系统(地址为 http://wltp.cninfo.com.cn)参加投票,网络投票的相关事宜请见附件一。

六、备查文件

《厦门紫光学大股份有限公司第八届董事会第三十一次会议决议》。

厦门紫光学大股份有限公司
董事会
2018 年 8 月 11 日

附件一:

参加网络投票的具体操作流程

一.网络投票的程序

1. 普通股的投票代码与投票简称:投票代码为"360526",投票简称为"紫学投票"。

2. 填报表决意见。

本次审议提案为非累积投票提案,填报表决意见:同意、反对、弃权。

二. 通过深交所交易系统投票的程序

1. 投票时间:2018 年 8 月 17 日的交易时间,即 9:30 一 11:30 和 13:00 一 15:00。

2. 股东可以登录证券公司交易客户端通过交易系统投票。

三. 通过深交所互联网投票系统投票的程序

1. 互联网投票系统开始投票的时间为 2018 年 8 月 16 日(现场股东大会召开前一日)下午 3:00,结束时间为 2018 年 8 月 17 日(现场股东大会结束当日)下午 3:00。

2. 股东通过互联网投票系统进行网络投票,需按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务指引(2016 年修订)》的规定办理身份认证,取得"深交所数字证书"或"深交所投资者服务密码"。具体的身份认证流程可登录互联网投票系统 http://wltp.cninfo.com.cn 规则指引栏目查阅。

3. 股东根据获取的服务密码或数字证书,可登录 http://wltp.cninfo.com.cn 在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

附件二:

授权委托书

兹委托　　　　(先生、女士)代表本人/本单位参加厦门紫光学大股份有限公司 2018 年度第四次临时股东大会,对会议审议的各项议案,按本授权委托书投票,并代为签署相关会议文件:

提案编码	提案名称	备注	同意	反对	弃权
		该列打勾的栏目可以投票			
1.00	《关于增选严乐平先生为公司第八届董事会董事的议案》	√			

注:1、委托人可在上述审议事项的同意、反对、弃权栏内划"√",作出投票表示。

委托人姓名或名称(签章或签字):　　委托人持股数:

委托人身份证号码(营业执照号码):　　委托人股东账号:

受托人签名:　　受托人身份证号:

委托有效期限:　　委托日期:　　年　　月　　日

(注:法人股东须加盖公章,本授权委托书复印件、剪报或自行打印均有效。股东授权委托书复印或按样本自制有效)

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第三十四次风险提示公告

根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")中关于不定期份额折算的相关规定,当长盛中证申万一带一路 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下(含 0.250 元)时,长盛中证申万一带一路份额(场内简称:一带一路,基金代码:502013)、长盛中证申万一带一路 A 份额(场内简称:一带一 A,基金代码:502014)、长盛中证申万一带一路 B 份额(场内简称:一带一 B,基金代码:502015)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2018 年 8 月 10 日,长盛中证申万一带一路 B 份额的基金份额参考净值接近《基金合同》规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注长盛中证申万一带一路 B 份额近期的基金份额参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于长盛中证申万一带一路 A 份额、长盛中证申万一带一路 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,长盛中证申万一带一路 A 份额、长盛中证申万一带一路 B 份额的折溢价率可能发生较大变化,特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价交易所带来的风险。

二、长盛中证申万一带一路 B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阀值当日,长盛中证申万一带一路 B 份额的参考净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,因此折算基准日长盛中证申万一带一路 B 份额的参考净值可能与折算阀值 0.250 元有一定差异。

四、长盛中证申万一带一路 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后长盛中证申万一带一路 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征的长盛中证申万一带一路 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的长盛中证申万一带一路 A 份额与较高风险收益特征的长盛中证申万一带一路份额,因此长盛中证申万一带一路 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

五、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买长盛中证申万一带一路 A 份额,在不定期份额折算后,则折算新增的长盛中证申万一带一路份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将长盛中证申万一带一路 A 份额卖出,或者在折算后将新增的长盛中证申万一带一路份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据上海证券交易所的相关业务规则,场外份额经折算后的份额数保留到小数点后 2 位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;场内份额折算后的份额数将取整计算(最小单位为 1 份),不足 1 份的零碎份额,按照投资者零碎份额数量大小顺序排列,零碎份额数量相同的,则随机排列,按照排列顺序,依次均登记为 1 份,直至完成全部折算。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路 A 份额与长盛中证申万一带一路 B 份额的上市交易和长盛中证申万一带一路份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的《基金合同》及《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》或通过本基金管理人网站(www.csfunds.com.cn)、客户服务电话(400–888–2666 或 010–62350088)咨询。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长盛基金管理有限公司
2018年 8 月 11 日

长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第三十八次风险提示公告

根据《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")中关于不定期份额折算的相关规定,当长盛中证证券公司 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下(含 0.250 元)时,长盛中证证券公司份额(场内简称:券商分级,基金代码:502053)、长盛中证证券公司 A 份额(场内简称:券商 A,基金代码:502054)、长盛中证证券公司 B 份额(场内简称:券商 B,基金代码:502055)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2018 年 8 月 10 日,长盛中证证券公司 B 份额的基金份额参考净值接近《基金合同》规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注长盛中证证券公司 B 份额近期的基金份额参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于长盛中证证券公司 A 份额、长盛中证证券公司 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,长盛中证证券公司 A 份额、长盛中证证券公司 B 份额的折溢价率可能发生较大变化,特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价交易所带来的风险。

二、长盛中证证券公司 B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阀值当日,长盛中证证券公司 B 份额的参考净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,因此折算基准日长盛中证证券公司 B 份额的参考净值可能与折算阀值 0.250 元有一定差异。

四、长盛中证证券公司 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后长盛中证证券公司 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征的长盛中证证券公司 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的长盛中证证券公司 A 份额与较高风险收益特征的长盛中证证券公司份额,因此长盛中证证券公司 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

五、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买长盛中证证券公司 A 份额,在不定期份额折算后,则折算新增的长盛中证证券公司份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将长盛中证证券公司 A 份额卖出,或者在折算后将新增的长盛中证证券公司份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据上海证券交易所的相关业务规则,场外份额经折算后的份额数保留到小数点后 2 位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;场内份额折算后的份额数将取整计算(最小单位为 1 份),不足 1 份的零碎份额,按照投资者零碎份额数量大小顺序排列,零碎份额数量相同的,则随机排列,按照排列顺序,依次均登记为 1 份,直至完成全部折算。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司 A 份额与长盛中证证券公司 B 份额的上市交易和长盛中证证券公司份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的《基金合同》及《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》或通过本基金管理人网站(www.csfunds.com.cn)、客户服务电话(400–888–2666 或 010–62350088)咨询。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长盛基金管理有限公司
2018年 8 月 11 日