嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2020年06月04日更新）

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

重要提示

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），根据2012年3月23日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]393号）和2012年3月26日《关于嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]189号）的核准公开发售。本基金基金合同于2012年5月7日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

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。

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2020年5月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2020年3月31日（未经审计），特别事项注明除外。

一、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27楼09－14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	经雷
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%，DWS Investments Singapore Limited 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、北京怀柔、武汉分公司。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、总经理及其他管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官。现任中诚信托有限责任公司业务总监兼国际业务部总经理，兼任中诚国际资本有限公司总经理、中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长及法人代表。

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。

Mark H.Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD，德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD，德意志银行（伦敦）首席运营官，德意志银行全球审计主管。现任DWS Management GmbH执行董事、全球首席运营官。

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。

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。

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。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任、商学院院长兼MBA教育中心主任。现任中央财经大学商学院教授。

经雷先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国组约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（上海）有限公司董事长。

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。

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。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监，现任基金运营总监。

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。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012年5月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

2、基金经理

（1）现任基金经理

何如女士，硕士研究生，14年证券从业经历，具有基金从业资格，加拿大籍。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，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。2014年5月9日至2016年3月24日任中创400交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2014年6月13日至2019年9月28日任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014年6月13日至2019年9月28日任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014年6月20日至2019年9月28日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2015年8月6日至2019年9月28日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016年1月5日至2017年12月26日任深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年1月5日至2019年9月28日任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016年1月5日至2017年12月26日任嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017年6月29日至2019年3月30日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017年7月3日至2019年3月30日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017年7月14日至2019年4月2日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金（LOF）基金经理、2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII－LOF）基金经理、2019年5月23日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年8月8日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年12月9日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2020年3月16日至今任嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

陈正宪先生，硕士研究生，15年证券从业经历，具有基金从业资格，中国台湾籍。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。2016年1月5日至2019年4月2日任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII－LOF）基金经理、2016年3月24日至2019年3月30日任中创400交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年3月24日至2019年3月30日任嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017年6月7日至2019年9月28日任嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017年6月29日至2019年9月28日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017年7月3日至2019年9月28日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017年7月15日至2019年9月28日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理、2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金联接基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016年1月5日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2016年3月24日至今任嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金（LOF）基金经理、2019年1月14日至今任嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金(LOF)基金经理、2019年5月23日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年8月8日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019年12月9日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2020年3月16日至今任嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

杨宇先生，管理时间为2012年5月7日至2016年1月5日；张宏民先生，管理时间为2012年5月7日至2013年1月25日。

3、Smart Beta及量化投资决策委员会

Smart Beta及量化投资决策委员会的成员包括：Smart－Beta和量化投资负责人张峰先生，Smart－Beta和量化投资首席投资官杨宇先生，公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生，部门负责人刘斌先生、陈正宪先生、何如女士。

4 上述人员之间不存在近亲属关系

二、基金托管人

（一）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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）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、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、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，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。

（三）证券投资基金托管情况

截至2020年3月31日，中国银行已托管780只证券投资基金，其中境内基金735只，QDII基金45只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（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》、《公开募集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，及时通知基金管理人，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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商

序号	代销机构名称	代销机构信息
1.	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号 办公地址：上海市静安区南京西路768号 法人代表：贺青 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 联系人：黄博明 客服电话：4008888666 网址：http://www.gtja.com
2.	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市东城区朝内大街188号 法人代表：王常青 电话：(010)65183880 传真：(010)65182261 联系人：权唐 客服电话：400－8888－108 网址：http://www.csc108.com
3.	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 法人代表：何如 电话：0755－82130833 传真：0755－82133952 联系人：李颖 客服电话：95536 网址：http://www.guosen.com.cn
4.	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号 办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层 法人代表：霍达 电话：(0755)82943666 传真：(0755)82943636 联系人：林生迎 客服电话：4008888111，95565 网址：http://www.cmschina.com
5.	广发证券股份有限公司	注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室 办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦 法人代表：孙树明 电话：(020)66338888 传真：(020)87555305 联系人：陈姗姗 客服电话：95575或致电各地营业网点 网址：http://www.gf.com.cn
6.	中信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法人代表：张佑君 电话：010－60838888 联系人：郑慧 客服电话：95558 网址：http://www.cs.ecitic.com
7.	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2－6层 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2－6层 法人代表：陈共炎 电话：010－83574507 传真：010－83574807 联系人：辛国政 客服电话：400－8888－888 网址：http://www.chinastock.com.cn
8.	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路689号 办公地址：上海市广东路689号 法人代表：周杰 电话：(021)23219000 传真：(021)23219100 联系人：金芸、李笑鸣 客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话 网址：http://www.htsec.com
9.	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号 法人代表：李梅 电话：021－33388214 传真：021－33388224 联系人：陈宇 客服电话：95523或4008895523 网址：http://www.swhysc.com
10.	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 法人代表：王连志 电话：(0755)82825551 传真：(0755)82558355 联系人：陈剑虹 客服电话：4008001001 网址：http://www.essence.com.cn
11.	华泰证券股份有限公司	注册地址：江苏省南京市江东中路228号 办公地址：江苏省南京市江东中路228号 法人代表：周易 电话：0755－82492193 传真：0755－82492962(深圳) 联系人：虞晓芸 客服电话：95597 网址：http://www.htsc.com.cn
12.	中信证券(山东)有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法人代表：姜晓林 电话：(0531)89606166 传真：(0532)85022605 联系人：焦刚 客服电话：95548 网址：http://sd.citics.com/
13.	中国中金财富证券有限公司	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 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 法人代表：高涛 电话：0755－88320851 传真：0755－82026539 联系人：胡艺珑 客服电话：400 600 8008 网址：http://www.china－invs.cn
14.	兴业证券股份有限公司	注册地址：福建省福州市湖东路268号 办公地址：福建省福州市湖东路268号 法人代表：杨华辉 电话：021－38565547 联系人：乔琳雪 客服电话：95562 网址：http://www.xyzq.com.cn
15.	东方证券股份有限公司	注册地址：中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼22层、23层、25－29层 办公地址：中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼5－6层、12层、13层、22层、25－27层、29层、32层、36层、38层 法人代表：潘鑫军 电话：(021)63325888 传真：(021)63327888 联系人：王凤 客服电话：95503 网址：http://www.dfzq.com.cn
16.	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701－3717 办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701－3717 法人代表：施华 电话：(010)59355997 传真：(010)56437013 联系人：丁敏 客服电话：95571 网址：http://www.foundersc.com
17.	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10－19层 办公地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10－19层 法人代表：曹宏 电话：(021)62821733 传真：(0755)83515567 联系人：金夏 客服电话：4006666888，(0755)33680000 网址：http://www.cgws.com
18.	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路1508号 办公地址：上海市静安区新闸路1508号 法人代表：周健男 电话：(021)22169999 传真：(021)22169134 联系人：刘晨、李芳芳 客服电话：4008888788，10108998 网址：http://www.ebscn.com
19.	中信证券华南股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层 办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层 法人代表：胡伏云 电话：020－88836999 传真：020－88836984 联系人：梁微 客服电话：95396 网址：http://www.gzs.com.cn
20.	东北证券股份有限公司	注册地址：吉林省长春市生态大街6666号 办公地址：长春市生态大街6666号 法人代表：李福春 电话：(0431)85096517 传真：(0431)85096795 联系人：安岩岩 客服电话：95360 网址：http://www.nesc.cn
21.	中泰证券股份有限公司	注册地址：山东省济南市市中区经七路86号 办公地址：济南市市中区经七路86号 法人代表：李玮 电话：021－20315290 联系人：许曼华 客服电话：95538 网址：http://www.zts.com.cn/
22.	华福证券有限责任公司	注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7－8层 办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7－8层 法人代表：黄金琳 电话：(0591)87383623 传真：(0591)87383610 联系人：张腾 客服电话：(0591)96326 网址：http://www.hfzq.com.cn/
23.	中国国际金融股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法人代表：丁学东 电话：(010)65051166 传真：(010)85679203 联系人：杨丽宇 客服电话：400 910 1166 网址：http://www.cicc.com.cn
24.	华创证券有限责任公司	注册地址：贵州省贵阳市中华北路216号 办公地址：贵州省贵阳市中华北路216号 法人代表：陶永泽 电话：0851－33223390 客服电话：4008666689 网址：http://www.hczq.com/
25.	宏信证券有限责任公司	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 办公地址：成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 法人代表：吴玉明 电话：028－86199278 传真：028－86199382 联系人：刘进海 客服电话：4008366366 网址：http://www.hx818.com
26.	长江证券股份有限公司	注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号 办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号 法人代表：降佳(代) 电话：(027)65799999 传真：(027)85481900 联系人：李良 客服电话：95579或4008－888－999 网址：http://www.cjsc.com
27.	湘财证券股份有限公司	注册地址：长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼 办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼 法人代表：孙永祥 电话：(021)38784580 传真：(021)68865680 联系人：李欣 客服电话：95351 网址：http://www.xcsc.com
28.	渤海证券股份有限公司	注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址：天津市南开区宾水西道8号 法人代表：王春峰 电话：(022)28451991 传真：(022)28451892 联系人：蔡宫 客服电话：4006515988 网址：http://www.bhzq.com
29.	新时代证券股份有限公司	注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 法人代表：叶顺德 电话：010983561146 联系人：田芳芳 客服电话：95399 网址：http://www.xsdzq.cn
30.	国联证券股份有限公司	注册地址：江苏省无锡市金融一街8号 办公地址：无锡市金融一街8号 法人代表：桂志勇 电话：0510－82831662 传真：0510－82830162 联系人：邝昊 客服电话：95570 网址：http://www.glsc.com.cn
31.	浙商证券股份有限公司	注册地址：浙江省杭州市五星路201号 办公地址：浙江省杭州市五星路201号 法人代表：吴承根 电话：(0571)87901912 传真：(0571)87901913 联系人：许嘉行 客服电话：(0571)967777 网址：http://www.stocke.com.cn
32.	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层－64层 办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层－64层 法人代表：何之江 电话：021－38637436 传真：021－58991896 联系人：周一涵 客服电话：95511－8 网址：stock.pingan.com
33.	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼 办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼 法人代表：徐丽峰 电话：(0791)86283372 传真：(0791)86281305 联系人：任文莺 客服电话：4008222111 网址：www.gszq.com
34.	德邦证券股份有限公司	注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心29楼 法人代表：武晓春 电话：(021)68761616 传真：(021)68767981 联系人：刘婧 客服电话：4008888128 网址：http://www.tebon.com.cn
35.	华鑫证券有限责任公司	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 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 法人代表：俞洋 电话：021－54967552 传真：021－54967032 联系人：杨莉娟 客服电话：021－32109999;029－68918888;4001099918 网址：http://www.cfsc.com.cn
36.	华宝证券有限责任公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层 法人代表：陈林 电话：(021)68777222 传真：(021)68777822 联系人：瞿元 客服电话：4008209898 网址：http://www.cnhbstock.com

2、二级市场交易代办证券公司

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二级市场交易。

（二）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	刘玉生
电话	（010）58598907	传真	（010）66213961

（三）律师事务所和经办律师

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楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	（021）31358666	传真	（021）31358600
经办律师	吕红、黎明		

（四）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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室		
办公地址	中国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	周玮
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	薛竞、周玮		

四、基金的名称

本基金名称：嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金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基金资产净值的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。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

八、基金的投资策略

本基金采取完全复制法，即完全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（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用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。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

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是基金管理人运用基金财产的决策依据。

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团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

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：指数投资研究小组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、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，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：根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，基金经理主要以指

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指数投资的方法，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：风险管理部门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。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：沪深300指数。

沪深300指数以调整股本为权数，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，无需召开基金份