嘉实中证新兴科技100策略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1月18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

本基金经2019年7月22日中国证券监督管理委员会《关于准予嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》(证监许可1327号)注册募集。本基金基金合同于2019年9月26日正式生效,自该日起本基金管理人开始管理本基金。

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。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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则(2020年修订)》《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》中对上交所跨市场股票型交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式的调整优化指引,本次更新招募说明书更新与修订基金合同、托管协议相关的内容,包括"重要提示"、"释义"、"基金份额的申购与赎回"、"基金的收益与分配"、"基金的会计与审计"、"基金的信息披露"、"基金合同的内容摘要"、"基金托管协议的内容摘要"等章节,并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、基本信息

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、北京怀柔和武汉分公司。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、总经理及其他高级管理人员基本情况

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总裁助理兼国际业务部总经理;兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

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年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。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。

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)国际投资公司美国纽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(北京)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责任公司财务总监。

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。

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。

2、基金经理

(1)现任基金经理

李直先生,硕士研究生,5年证券从业经历,具有基金从业资格。2014年7月加入嘉实基金,从事指数基金投资研究工作。2017年12月26日起担任深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017年12月26日起担任嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年3月30日起任中创400交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年3月30日起任嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年9月26日起任嘉实中证新兴科技100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起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。2019年9月28日起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。2019年9月28日起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。2019年9月28日起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。2019年9月28日起任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年11月1日起任嘉实新兴科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年12月5日起任嘉实先进制造100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

金猛先生,硕士研究生,7年证券从业经历,具有基金从业资格。曾任职于安信基金管理有限责任公司,从事风险控制工作。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于量化投资部。2018年9月20日至今任嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金基金经理。2018年9月20日至今任嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年9月20日至今任嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月26日至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年11月1日至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年11月28日至今任嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年12月5日至今任嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

高峰先生,硕士研究生,5年证券从业经历,具有基金从业资格,北京大学金融学硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任中国工商银行金融市场部外汇与衍生品交易员。2015年加入嘉实基金管理有限公司,现任指数投资部基金经理。2019年4月2日起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4月2日起任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月26日起任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起任嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年9月28日起任嘉实黄金证券投资基金(LOF)基金经理。2019年9月28日起任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年9月28日起任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年11月1日起任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年12月5日起任嘉实中证先进制造100策略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

无。

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、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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2019年12月31日,中国银行已托管764只证券投资基金,其中境内基金722只,QDII基金42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)募集期间基金份额发售机构

1、发售协调人

详见基金份额发售公告。

2、网下现金和网下股票认购发售直销机构:嘉实基金管理有限公司

(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号北京万豪中心D座12层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	黄娜		

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	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		
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)25870686	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)66777997	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	(0591)88013670
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裙楼103、203单元单元		
电话	(020)62305005	传真	(020)62305005
联系人	周炜		

3、网下现金和网下股票认购发售代理机构

详见基金份额发售公告。

4、网上现金认购发售代理机构

投资者可直接通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上交所会员可通过上交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,并在基金管理人网站列示。

(二)申购赎回代理券商、二级市场交易代办证券公司

详见本基金管理人网站的列示。

(三)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任

地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话: 010 -59378856

传真: 010 -59378907

联系人:崔巍

(四)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

住所、办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话:(021)5115 0298

传真:(021)5115 0398

负责人:廖海

联系人:范佳斐

经办律师:刘佳、范佳斐

(五)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法定代表人:毛鞍宁

联系人:王珊珊

电话:(010)58152145

传真:(010)85188298

经办注册会计师:王珊珊、贺耀

四、基金的名称

本基金名称:嘉实中证新兴科技100策略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、股票型指数证券投资基金

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,力争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%。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。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上市的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等),债券资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、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、同业存单、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。

本基金投资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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八、基金的投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法,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。但因特殊情况(如流动性原因等)导致无法完全投资于标的指数成分股时,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。

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投资目标所述范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

2、金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标,本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,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。

本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

①股指期货投资策略

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。

②股票期权投资策略

本基金投资股票期权,将根据风险管理的原则,充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

3、资产支持证券投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具,本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略,结合定量分析和定性分析的方法,综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素,选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

4、随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金管理人可在不改变投资目标的前提下,根据法律法规的有关规定,在履行适当程序后相应调整或更新投资策略,并公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中证新兴科技100策略指数,业绩比较基准为中证新兴科技100策略指数收益率。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)且在不损害持有人利益的前提下,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数,而无需召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的费用与税收

(一)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》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼或仲裁费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、因基金的证券、期货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、券商佣金及其他类似性质的费用等);

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的开户费用、账户维护费用;

9、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数许可使用费;

10、基金的上市初费和年费;

11、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。

(二)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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.50\% \div$ 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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.10\% \div$ 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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

3、基金合同生效后标的指数许可使用费

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。

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可使用协议的规定,基金合同生效后,在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.03\% \div$ 当年天数

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币50,000元(大写:伍万圆),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。若一个季度累计计提指数许可使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限,则基金于季度末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于次季前10个工作日内从基金财产中一次性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。

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。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议,但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,按费用实际支出金额,列入或摊入当期基金费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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;

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。

(四)基金税收

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格,具体税率适用中国税务主管机关的规定。

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。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》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:明确本次更新招募说明书更新的主要内容。

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:更新了直销中心的相关信息。

5.在"六、基金的募集"部分:更新了基金募集的相关信息。

6.在"七、基金合同的生效"部分:更新了基金合同生效日期。

7.在"八、基金份额的上市交易"部分:更新了基金份额上市交易的相关信息。

8. 在"二十、基金托管协议的内容摘要"部分:更新了基金管理人的住所信息。

9. 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则(2020年修订)》《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》中对上交所跨市场股票型交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式的调整优化指引,本次更新招募说明书更新与修订基金合同、托管协议相关的内容,包括"重要提示"、"释义"、"基金份额的申购与赎回"、"基金的收益与分配"、"基金的会计与审计"、 "基金的信息披露"、"基金合同的内容摘要"、"基金托管协议的内容摘要"等章节。

嘉实基金管理有限公司
2020年1月18日

(上接C69版)

(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	-	-
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	-	-
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	3,795.00	0.02
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	-	-
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	3,795.00	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

5.3.1 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	600276	恒瑞医药	26,734	1,748,938.28	11.08
2	000538	云南白药	7,053	603,031.50	3.82
3	000661	长春高新	1,810	573,751.90	3.64
4	600436	片仔癀	4,125	473,962.50	3.00
5	002044	美年健康	25,240	469,211.60	2.97
6	300015	爱尔眼科	12,799	435,166.00	2.76
7	300142	沃森生物	16,600	423,300.00	2.68
8	600518	康美药业	40,100	419,045.00	2.66
9	600196	复星医药	13,600	405,008.00	2.57
10	300003	乐普医疗	14,400	381,600.00	2.42

注:本基金采取完全复制法,完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合。?

5.3.2 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	002958	青农商行	500	3,795.00	0.02

注:报告期末,本基金仅持有上述1支积极投资股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

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12月29日,?康美药业股份有限公司发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知的公告》。2018年12月28日,康美药业股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(编号:粤证调查通字180199号),公司因涉嫌信息披露违法违规被中国证券监督管理委员会立案调查。@????本基金投资于"康美药业(600518)"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,康美药业为标的指数的成份股,本基金投资于"康美药业"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,其他九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	1,289.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,339.07

(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

5.11.5.1 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。?

5.11.5.2 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

报告期末,本基金积极投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

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。

(一) 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
2014年6月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日	14.51%	0.98%	16.70%	1.04%	-2.19%	-0.06%
2015年	40.22%	2.43%	42.72%	2.61%	-2.50%	-0.18%
2016年	-12.95%	1.61%	-12.12%	1.65%	-0.83%	-0.04%
2017年	12.85%	0.76%	13.75%	0.77%	-0.90%	-0.01%
2018年	-26.75%	1.67%	-25.97%	1.69%	-0.78%	-0.02%
2019年1月1日至3月31日	28.38%	1.77%	29.03%	1.78%	-0.65%	-0.01%

(二) 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

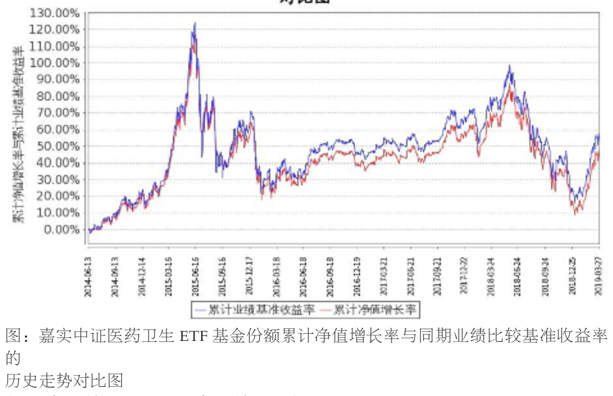

图:嘉实中证医药卫生ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的
历史走势对比图
(2014年6月13日至2019年3月31日)

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(十三(二)投资范围和(七)投资限制)的有关约定。

十三、基金的费用与税收

(一)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》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼仲裁费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、因基金的证券、期货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);

7、基金资产的资金汇划费用;

8、基金的开户费用、账户维护费用;

9、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费;

10、基金的上市初费和月费;

11、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。

(二)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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.5\% \div$ 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:

$H = E \times 0.1\% \div$ 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。

在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.03\% \div$ 当年天数

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提,按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币10,000元,计费区间不足一季度的,以一季度计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

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。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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;

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。

(四)基金税收

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》、《公开募集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:本次更新招募说明书更新的主要内容。

2、在"三、基金管理人"部分:更新了基金管理人的相关内容。

3、在"四、基金托管人"部分:更新了基金托管人的相关内容。

4、在"五、相关服务机构"部分:更新相关直销机构、会计师事务所的信息。

5、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则(2020年修订)》《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》中对上交所跨市场股票型交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式的调整优化指引,本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容,包括"重要提示"、"释义"、"基金份额的申购与赎回"、"基金的收益与分配"、"基金的会计与审计"、"基金的信息披露"、"基金合同的内容摘要"、"基金托管协议的内容摘要"等章节。

嘉实基金管理有限公司
2020年1月18日