嘉实美国成长股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020 年 06 月 30 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

嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据 2013 年 1 月 5 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可 [2013]14 号文)核准募集公开发售,本基金基金合同于 2013 年 6 月 14 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 27 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、基金名称

本基金名称:嘉实美国成长股票型证券投资基金

二、基金的类型

本基金类型:契约型开放式股票型

三、基金的投资目标

本基金主要投资于美国大盘成长型股票,在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段,力争获取长期资本增值。

四、基金的投资范围

本基金可投资于下列金融产品或工具:银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金;中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品;法律、法规或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要求)。

本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 90%;现金或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。本基金主要投资于美国发行、上市的大盘成长型股票,所投资比例不低于权益类资产的 80%。一般来说,大盘股票是指市值超过 20 亿美元的股票;成长型股票是指市净率、中期预期盈利增长率、最近 5 年收入增长率等指标均较高的股票。权益类资产是指普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可相应调整本基金的投资比例限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。

在保证流动性的前提下,本基金现金头寸可存放于境内,满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要,并可以投资境内货币市场工具。

五、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金不尝试进行择时操作。在正常的市场条件下,本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内,最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时,本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。

2. 股票投资策略

本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统,构建投资组合。其中,核心模型包括成长性模型、多因子 Alpha 模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势,定期或不定期地对模型进行复核,并做出相应调整,以不断改善模型的适用性。

本基金主要投资于市值超过 20 亿美元的美国大盘股票;在此基础上,本基金将通过成长性模型挑选出足够数量的最具成长性的股票(一般来说为 1000~1500 只,基金经理可根据实际市场情况对此进行调整)作为股票选择的样本空间。

在选择股票方面,本基金运用量化投资技术分两步进行:首先,基金经理通过多因子 Alpha 模型对样本空间中股票的预期超额收益由高到低进行排序、打分。第二步,基金经理将综合利用风险预测模型、交易成本模型以及投资组合优化器对第一步所甄选的股票进行投资组合的最优化,使最终的投资组合能够在预期收益、预期风险以及交易成本等方面达到最优的平衡。目标是在不承担更多风险的前提下,使基金获得高于业绩比较基准的收益。

在卖出股票方面,基金经理将主要考虑以下几点:

1)某只股票的投资机会是否逊于其它股票;

2)某只股票的潜在风险是否高于其预期收益;

3)特殊事件是否影响了对股票的原有预期。

本基金所应用的核心模型具体如下:

1)成长性模型

成长性模型主要用来衡量股票的潜在增长能力和持续盈利能力。其中潜在增长能力主要通过公司收入增长率、预期收入的变化等指标衡量;持续盈利能力主要通过公司营业利润的变化等指标衡量。

2)多因子 Alpha 模型

嘉实多因子 Alpha 模型是嘉实量化投资团队经过严密的现代行为金融理论指导以及长时间的实践经验总结而研发的,用精选的多个因子准确捕捉市场中非理性投资所带来的 Alpha 投资机会,深入挖掘预期产生超额回报的个股。该模型的因子可归为如下几类:估值(Valuation)、成长(Growth)、质量(Quality)、分析师情绪(Sentiment)、动量(Momentum)、市场因素(Market)。这些类别综合了来自市场各类投资者,公司各类报表,分析师及监管政策等各方面信息。该模型利用嘉实长期积累并不断扩展的强大的数据库,科学客观地综合了大量的各类信息。嘉实量化投资团队根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适时调整各因子类别的具体组成及权重。

3)风险预测模型

在追求超额收益的同时,投资也需要适度风险预算的支持。该多因子模型将帮助基金经理有效的控制投资组合的风险预算。

4)交易成本模型

本基金的交易成本模型既考虑固定成本,也考虑交易的市场冲击效应,在控制成本最低的基础上减少交易造成的负业绩影响。

5)投资组合优化器

本基金通过投资组合优化器的应用,对所甄选的股票进行投资组合的最优化,使最终的投资组合能够在预期收益、预期风险以及交易成本等方面达到最优的平衡。

3. 固定收益投资策略

本基金的固定收益投资主要用于基金流动性管理。

固定收益投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同固定收益品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,采取以久期管理策略为主,辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等,确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

4. 衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用衍生工具。投资原则为有利于基金资金的风险管理及流动性管理,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

衍生产品的使用好处是低成本,可对冲风险。本基金将投资于流动性好的股指期货为主。投资流程如下:基金经理提交投资衍生品的建议报告,其中应包括宏观分析、市场分析、决策依据(结合定量部门计算的组合 beta 值)、采用的具体合约种类、数量、到期日、合约的流动性分析等。风险控制部门根据报告计算相应的指标,包括在险价值分析、情景分析、压力测试等,并对基金经理的投资建议表示意见。投资决策委员会根据内部流程进行最终决策。在投资策略实施后,基金经理根据市场状况和组合股票仓位情况作出期货合约的平仓或加仓决定,同时报投资决策委员会批准。风险控制部门每日须对组合头寸和保证金情况进行监控,以确保流动性足够以及符合基金合同规定的投资限制,发现问题立即向投资决策委员会报告。

六、基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

95%×罗素 1000 成长指数收益率 +5%×境内银行活期存款税后利率;

如果今后法律法规发生变化,或者由于罗素 1000 成长指数发生重大变更等原因导致罗素 1000 成长指数不宜继续作为业绩比较基准,或者市场上出现更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准,基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

七、基金的风险收益特征

本基金主要投资于美国大盘成长型股票,属于主动投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

八、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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 4 月 20 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 2020 年 3 月 31 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	678,187,399.10	83.62
	其中:普通股	660,052,466.05	81.39
	优先股	–	–
	存托凭证	1,756,374.75	0.22
	房地产信托凭证	16,378,558.30	2.02
2	基金投资	2,040,098.22	0.25
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	89,623,991.51	11.05
8	其他资产	41,172,318.41	5.08
9	合计	811,023,807.24	100.00

2. 报告期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	678,187,399.10	93.45

3. 报告期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
股票通信服务	74,052,293.68	10.20
股票非必需消费品	79,355,670.86	10.93
股票必需消费品	41,401,535.86	5.70
股票能源	1,425,950.62	0.20
股票金融	23,149,594.44	3.19
股票医疗保健	104,082,187.62	14.34
股票工业	46,483,515.62	6.40
股票信息技术	280,530,088.83	38.65
股票原材料	5,626,254.61	0.78
股票公用事业	3,945,373.91	0.54
房地产信托医疗保健类	99,022.07	0.01
房地产信托住宅类	983,151.50	0.14
房地产信托特殊类	15,196,855.72	2.09
房地产信托抵押类	99,529.01	0.01
存托凭证非必需消费品	829,501.97	0.11
存托凭证信息技术	926,872.78	0.13
合计	678,187,399.10	93.45

注:本基金持有的权益投资采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

4. 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权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Microsoft-Corp	微软	MSFTUW	纳斯达克证券交易所	美国	51,648.00	57,711,016.62	7.95
2	AppleInc	苹果公司	AAPLUW	纳斯达克证券交易所	美国	29,898.00	53,866,332.02	7.42
3	Amazon.comInc	亚马逊公司	AMZNUW	纳斯达克证券交易所	美国	2,968.00	40,999,836.76	5.65
4	Alphabet-Inc	Alphabet 公司	GOOGLUW	纳斯达克证券交易所	美国	3,330.00	27,414,331.38	3.78
5	Face-bookInc	Facebook 公司	FBUW	纳斯达克证券交易所	美国	15,163.00	17,919,552.73	2.47
6	NVIDIA-Corp	英伟达	NVDAUW	纳斯达克证券交易所	美国	9,130.00	17,051,483.45	2.35
7	VisaInc	维萨公司	VUN	纽约证券交易所	美国	11,710.00	13,367,565.86	1.84
8	CostcoW-holesaleCorp	好市多批发	COSTUW	纳斯达克证券交易所	美国	5,508.00	11,127,121.49	1.53
9	United-HealthGroupInc	联合健康	UNHUN	纽约证券交易所	美国	6,171.00	10,903,430.29	1.50
10	NetflixInc	奈飞公司	NFLXUW	纳斯达克证券交易所	美国	4,034.00	10,732,275.67	1.48

注:本表所使用的证券代码为彭博代码。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	VanEck Vectors Gold Miners ETF	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	[illegible],115,550.42	0.14
2	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	[illegible],[illegible]	0.06
3	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	307,[illegible]	0.04
4	iShares S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc.	1[illegible]	0.01
5	iShares Russell 2000 ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	1,050.93	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述 5 支基金。?

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	应收证券清算款	–
3	应收股利	303,511.91
4	应收利息	14,669.89
5	应收申购款	40,854,136.61
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	41,172,318.41

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名权益投资中存在流通受限情况的说明

无。

九、基金业绩

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) 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

嘉实美国成长股票(QDII)- 人民币

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
2013 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	12.60%	0.61%	16.27%	0.64%	-3.67%	-0.03%
2014 年	6.84%	0.77%	10.75%	0.69%	-3.91%	0.08%
2015 年	6.98%	0.99%	3.91%	0.96%	3.07%	0.03%
2016 年	10.88%	0.82%	5.13%	0.80%	5.75%	0.02%
2017 年	15.91%	0.62%	26.81%	0.46%	-10.90%	0.16%
2018 年	1.39%	1.30%	-2.55%	1.19%	3.94%	0.11%
2019 年	29.76%	0.86%	32.78%	0.85%	-3.02%	0.01%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日	-12.32%	3.39%	-13.53%	3.46%	1.21%	-0.07%

嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇

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
2013 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	13.30%	0.60%	16.27%	0.64%	-2.97%	-0.04%
2014 年	6.53%	0.76%	10.75%	0.69%	-4.22%	0.07%
2015 年	0.75%	0.98%	3.91%	0.96%	-3.16%	0.02%
2016 年	3.78%	0.81%	5.13%	0.80%	-1.35%	0.01%
2017 年	22.90%	0.58%	26.81%	0.46%	-3.91%	0.12%
2018 年	-3.80%	1.27%	-2.55%	1.19%	-1.25%	0.08%
2019 年	27.48%	0.84%	32.78%	0.85%	-5.30%	-0.01%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日	-13.67%	3.36%	-13.53%	3.46%	-0.14%	-0.10%

(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 1:嘉实美国成长股票(QDII)人民币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

(2013 年 6 月 14 日至 2020 年 3 月 31 日)

图 2:嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇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

(2013 年 6 月 14 日至 2020 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“第十四部分(三)投资范围和(九)投资限制”的有关约定。

十、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)因基金的开户、证券交易、证券清算交收、证券登记存管而产生的各项费用;

(4)基金合同生效以后的信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(7)基金的资金汇划费用;

(8)外汇兑换交易的相关费用;

(9)与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等;

(10)代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用;

(11)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

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

本基金的管理费自基金合同生效日(含基金合同生效日)起按前一日基金资产净值的 1.8%年费率计提,即本基金的年管理费率为 1.8%。计算方法如下:

H=E×1.8%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

本基金的管理费每日计提,逐日累计,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配;如果委托境外投资顾问,基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用,具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费自基金合同生效日(含基金合同生效日)起按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提,即本基金的年托管费率为 0.35%。计算方法如下:

H=E×0.35%÷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

本基金的托管费每日计提,逐日累计,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配;如果委托境外托管人,其中可以部分作境外托管人的费用,具体支付由中国银行与境外托管人在有关协议中进行约定。

(3)本条“1.基金费用的种类”中第(3)至第(10)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(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 5%,具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<50 万元	1.5%
50 万元≤M<200 万元	1.2%
200 万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	单笔 1000 元

对于人民币份额,可直接依照上述申购费率结构;对于美元份额,需首先将美元申购资金按有效申购申请日的汇率折算为人民币(折算结果保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去),然后依照上述申购费率结构以确定所适用的申购费率。

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。

2020 年 4 月 2 日,本基金管理人发布了《关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告》,自 2020 年 4 月 3 日起,对通过本公司直销中心(包括直销中心柜台及网上直销)申购本基金人民币份额的养老金客户实施特定申购费率:通过公司直销中心申购本基金人民币份额的,适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的 10%;申购费率为固定金额的,则按原费率执行,不再享有费率折扣。其中,养老金客户包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、基本养老保险基金、符合人社部规定的养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

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。2013 年 9 月 13 日,本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》,自 2013 年 9 月 17 日起,嘉实美国成长股票(QDII)人民币开通网上直销后端收费模式,并执行上述优惠费率和业务规则。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

本基金的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,不列入基金资产。

2、赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额的持有时间越长,所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过 5%,具体如下:

持有期限	赎回费率
T<7 天	1.50%
7 天≤T<365 天	0.50%
365 天≤T<730 天	0.30%
T≥730 天	0

本基金的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,除此之外的赎回费中 25%的部分归入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率等。费率如发生变更,基金管理人应于调整实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,经代销机构同意后,针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

本基金人民币份额的申购、赎回的币种为人民币,美元份额的申购、赎回币种为美元。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下,设立以其它币种计价的基金份额以及接受其它币种的申购、赎回,其他外币基金份额申赎的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

十一、基金管理人

(一) 基金管理人基本情况

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	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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
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

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,总经理及其他高级管理人员情况

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。

郭松先生,督察长,硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司,现任公司督察长。

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

张自力先生,理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学,24 年证券从业经历,曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。2017 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 20 日任嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 4 日至 2018 年 9 月 20 日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。2013 年 6 月 14 日至今任嘉实美国成长股票型证券投资基金基金经理、2015 年 6 月 9 日至今任嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理。

(2)历任基金经理

本基金无历任基金经理。

3、海外投资决策委员会

海外投资决策委员会的成员包括:嘉实国际首席投资官 Thomas Kwan,资深基金经理 Eric Liu, Yiqian Jiang, Chenye Yannan, June Chua, Ching Yin Fung, Kevin Sung,风险管理部 Ray Li, Mengxiao Yu。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

十二、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