

嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第1号）

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2013年7月12日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]917号）核准公开发售，本基金基金合同于2014年6月13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。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实守信、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，也不向投资者保证最低收益。

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。基金投资者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。基金投资者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。

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2015年6月13日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日（未经审计）。

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	上海浦东新区世纪大道150号国金中心二期4602-08单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街8号华润大厦9层
法定代表人	彭红武
总经理	赵学军
成立日期	1999年10月29日
控股股东	中国银河投资管理有限公司40%、德意志资产管理（亚洲）有限公司30%、立信投资有限公司10%
存续期间	持续经营
电话	(010) 66215588
传真	(010) 66418679
联系人	胡琴

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、ODII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何处罚记录。

（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

邓红武先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制改革司副处长；中国人保银行国际司、外资金融机构管理部、银行监管一局、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，经济学博士，中共党员。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，天津纺织原料交易所，商鼎国际经纪有限公司、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。

苗晋先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中诚信托有限责任公司国际业务部项目经理、投资管理部业务经理，2004年3月至今历任中诚信信托有限责任公司投资管理部业务经理、副经理、经理、投资总监兼投资管理部经理，现任中诚信托有限责任公司投资总监、副总经理、公司党委委员。

Bernd Amlung先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自1989年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

Mark 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。曾任达赖尔公司(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。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官，MD。

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，美国福特汉姆大学国际金融中心专业士。曾任教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。

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，清华大学法学院研究中心副主任，《清华法学》副主编，汤朔森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会委员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组委员会专家委员，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前任主任。

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，国债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总监。2001年11月至今任立信投资有限责任公司财务总监。

魏康先生，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政管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理有限公司总经理助理。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。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资管理事业部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团法律部审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司助理总经理，2008年7月起任公司副总经理。

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、新华保险北京分公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，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运营、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任元元证券深圳证券部信息总监，南方证券基金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金通证券部总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

何如女士，硕士研究生，9年证券从业经历。曾任职于IA克萊頓投资管理公司(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助理，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、基金经理助理。2014年5月9日至今任嘉实中创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，2014年6月13日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

元。

3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生、公司总经理赵学军先生、公司研究总监陈少女士、资深基金经理邵唯先生、邵涛涛先生，定量投资负责人张自力先生。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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟零玖拾玖元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：(010) 66594942

（二）基金托管部及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工140余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具备海外工作、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、OPFI、ROFII、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托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303只，ODII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数量等多种类型的基金，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。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.申购赎回代办券商

（1）国泰君安证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市浦东新区商城路181号	联系人	芮银
法定代表人	方建华	联系人	芮银
电话	021-38979666	传真	021-38979666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888999

（2）中信建投证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼	联系人	权毅
法定代表人	王常青	联系人	权毅
电话	010-65181888	传真	010-165182261
网址	www.citics.com	客服电话	400-888-1081

（3）国信证券股份有限公司

住所、办公地址	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	联系人	陈楚
法定代表人	何如	联系人	陈楚
电话	0755-82130333	传真	0755-82133962
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

（4）招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-40层	联系人	林思迎
法定代表人	李劲松	联系人	林思迎
电话	0755-82943666	传真	0755-82943636
网址	www.zhaosheng.com.cn	客服电话	4008881111, 95565

（5）中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区光华路10号中信证券大厦	联系人	陈忠
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	010-60833722	传真	010-16083379
网址	www.citics.com	客服电话	95558

（6）中国银河证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街33号国际企业大厦A座	联系人	田薇
法定代表人	陈有安	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66583900
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-888-888

（7）海通证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市广东路98号	联系人	余莹、李奕鸣
法定代表人	王开国	联系人	余莹、李奕鸣
电话	021-23213000	传真	021-23213000
网址	www.htsec.com	客服电话	95553或拨打各城市营业网点咨询电话

（8）申万宏源证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市徐汇区长乐路90号40层	联系人	陆晓达
法定代表人	李勇	联系人	陆晓达
电话	021-33389888	传真	021-33389224
网址	www.swhys.com.cn	客服电话	021-962260

（9）兴业证券股份有限公司

住所、办公地址	福州市湖东路268号	联系人	李静
法定代表人	兰荣	联系人	李静
电话	0591-38507739	传真	021-38569565
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

（10）长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路新锦江大酒店	联系人	李晔
法定代表人	胡松武	联系人	李晔
电话	102716278889	传真	1027168481000
网址	www.cjsc.com.cn	客服电话	95579

（11）中信证券（浙江）有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市解放东路29号黄龙世纪广场2楼	联系人	王瑞德
法定代表人	张炎	联系人	王瑞德
电话	0571-87927377	传真	0571-87190383
网址	www.bjztc.com	客服电话	0571-86480699

（12）华泰证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省南京市江东中路228号华泰证券大厦、深圳市深南大道4011号	联系人	陆晓达
法定代表人	吴万善	联系人	陆晓达
电话	0755-82481933	传真	025-51883223 / 0621-0765-52482662
网址	www.htsec.com.cn	客服电话	95597

（13）东方证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市中山南路181号2号楼22-28层	联系人	吴宇
法定代表人	陈耀军	联系人	吴宇
电话	021-63226888	传真	021-63226173
网址	www.dfsc.com.cn	客服电话	95503

（14）方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段200号	联系人	胡军瑞
法定代表人	邵洪	联系人	胡军瑞
电话	(0731) 88282600	传真	1862118622214
网址	www.fundao.com.cn	客服电话	95571

（15）长城证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道4000号广电国际大厦A座14、15、16层	联系人	李睿
法定代表人	黄耀华	联系人	李睿
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83516667
网址	www.ccw.com.cn	客服电话	4006968888、(0755) 33880000

（16）东北证券股份有限公司

住所、办公地址	长春市自由大路138号	联系人	潘楠
法定代表人	杨松岩	联系人	潘楠
电话	(0431) 85086789	传真	(0431) 85086736
网址	www.nesc.com.cn	客服电话	0431-18606733

（17）齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路86号	联系人	宋娟
法定代表人	李野	联系人	宋娟
电话	(0531) 68889199	传真	(0531) 68889762
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

（18）中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街5号新大厦大厦A座一层	联系人	李睿
法定代表人	赵大伟	联系人	李睿
电话	010-66550441	传真	010-10062791
网址	www.mzsc.com.cn	客服电话	400-300-5618

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在上海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）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海泰律律师事务所
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：廖海
经办律师：刘佳、张兰

（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
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：上海浦东新区湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：洪磊
经办注册会计师：许康洪、洪磊

四、基金的名称

本基金名称：嘉实中证主要消费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，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差率不超过2%。

本基金的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非现金基金资产的90%。

此外，为了更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（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、衍生品工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债、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）。

本基金的投资组合将严格按照标的指数的成份股及其权重进行构建，并定期对投资组合的权重进行跟踪调整，力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%，年化跟踪误差率不超过2%。

本基金的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非现金基金资产的90%。

此外，为了更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（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、衍生品工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债、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）。

本基金的投资组合将严格按照标的指数的成份股及其权重进行构建，并定期对投资组合的权重进行跟踪调整，力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%，年化跟踪误差率不超过2%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）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，基金管理人将采用其他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。

如因标的指数的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，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。

本基金投资于股指期货后，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。

本基金投资于股指期货、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
投资决策委员会负责决定有关指数的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；基金经理决定日常跟踪指数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。

（二）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。

（三）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件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