（上接A22版）

（29）上海利得基金销售有限公司

办公地址	上海宝山区蕴川路5475号1033室		
注册地址	中国上海宝山区蕴川路5475号1033室		
法定代表人	李兴春	联系人	曹怡晨
电话	021-50583533	传真	021-50583633
网址	http://www.leadfund.com.cn	客服电话	400-921-7755

（30）嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期53楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	http://www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

（31）南京苏宁基金销售有限公司

办公地址	南京市玄武区苏宁大道1-5号		
注册地址	南京市玄武区苏宁大道1-5号		
法定代表人	刘汉青	联系人	喻明明
电话	025-66996699-884131	传真	025-66008800-884131
网址	http://www.snjijin.com/	客服电话	95177

（32）北京植信基金销售有限公司

办公地址	北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67		
注册地址	北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67		
法定代表人	于龙	联系人	吴鹏
电话	010-56075718	传真	010-67767615
网址	http://www.zhixin-inv.com	客服电话	400-680-2123

（33）上海大智慧基金销售有限公司

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元		
法定代表人	申健	联系人	宋楠
电话	021-20219988-37492	传真	021-20219923
网址	https://www.wg.com.cn/	客服电话	021-20292031

（34）上海基煜基金销售有限公司

办公地址	上海昆明路518号北美广场A1002		
注册地址	上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）		
法定代表人	王翔	联系人	蓝杰
电话	021-65370077	传真	021-55085991
网址	http://www.jiyufund.com.cn	客服电话	4008-205-369

（35）上海陆金所基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元		
法定代表人	胡学勤	联系人	宁博宇
电话	021-20665952	传真	021-22066653
网址	http://www.lufunds.com	客服电话	4008219031

（36）国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路618号		
办公地址	上海市浦东新区银城路168号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号		
法定代表人	杨德红	联系人	芮敏祺
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	http://www.gtja.com	客服电话	4008888666

（37）长城证券股份有限公司

住所	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层		
注册地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层		
法定代表人	丁益	联系人	金夏
电话	(021)62821733	传真	(0755)83515567
网址	http://www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755)33680000

（38）光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
注册地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	周健男	联系人	刘晨、李芳芳
电话	（021）22169999	传真	（021）22169134
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

（39）民生证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层		
注册地址	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层--18层		
法定代表人	冯鹤年	联系人	赵明
电话	(010)85127766	传真	(010)85127917
网址	http://www.mszq.com/	客服电话	400-619-8888

（40）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

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

（二）注册登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	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53层09-11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	赵学军
联系人	彭鑫
电话	（010）6521558
传真	（010）65185678

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市源泰律师事务所		
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		
负责人	廖海	联系人	范佳斐
电话	（021）51150298-855	传真	（021）51150398
经办律师	刘佳、范佳斐		

（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（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

本基金名称：嘉实1个月理财债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金，契约型开放式，以定期开放方式运作。

六、基金的投资目标

在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的固定收益类工具，具体包括现金，协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单，债券回购，短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、中期票据等债券，资产支持证券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。

本基金将采用买入并持有策略，主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。

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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

在运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在运作期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。

本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具，如：银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等）等。在运作期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。

1、资产配置策略

每个运作期初，本基金首先对回购利率与短债收益率、存款利率进行比较，并在对运作期资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类货币市场工具在运作期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类货币市场工具的市场容量，确定配置比例。

2、银行定期存款及大额存单投资策略

运作期初，本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的几家银行进行存款投资，注重分散投资，降低交易对手风险。

3、债券回购投资策略

首先，基于对运作期内资金面走势的判断，确定回购期限的选择。在组合进行杠杆操作时，若判断资金面趋于宽松，则在运作初期进行短期限正回购操作；反之，则进行长期限正回购操作，锁定融资成本。若期初资产配置有逆回购比例，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行长期限逆回购配置；反之，则进行短期限逆回购操作。其次，本基金在运作期内，根据资金头寸，安排相应期限的回购操作。

4、短期信用债券投资策略

在运作期，基金管理人根据剩余期限、信用评级进行筛选，形成本基金的债券库；根据各短期信用债的到期收益率、剩余期限与运作期的匹配程度，挑选适当的短期债券进行配置，并持有到期。

5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

中小企业私募债收益率由基准收益率与信用利差叠加组成，信用风险表现在信用利差的变化上；信用利差主要受两方面影响，一是系统性信用风险，即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是非系统性信用风险，即该信用债本身的信用变化。

针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。针对非系统性信用风险，本基金通过“嘉实信用分析系统”，分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。针对流动性风险，本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债投资，主要采取分散投资，控制个债持有比例；采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售（first sale，best sale）”策略，控制投资风险。

6、投资决策

（1）决策依据

1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

2）宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

3）分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

（2）决策程序

1）投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

2）相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。

3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

4）交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。

5）监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

九、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十、基金的投资组合报告

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2018年1月17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2017年12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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	229,470,784.21	39.44
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	350,749,755.12	60.28
4	其他资产	1,648,311.38	0.28
5	合计	581,868,850.71	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	15
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	32
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	100.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.00	-

4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过240天。

5. 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。

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到0.5%。

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。

9. 投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

（2）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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,648,311.38
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,648,311.38

十一、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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实1个月理财债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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12月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日	-	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-	-
2016年	0.1251%	0.0041%	-	-	-	-
2017年	1.6334%	0.0047%				
2018年1月1日至2018年1月15日	0.1933%	0.0076%				

嘉实1个月理财债券E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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12月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日	0.1790%	0.0000%	-	-	-	-
2014年	0.4669%	0.0053%	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-	-
2016年	0.1313%	0.0044%	-	-	-	-
2017年	1.7184%	0.0047%				
2018年1月1日至2018年1月15日	0.2032%	0.0076%				

注：（1）2013年数据仅统计本基金第一个运作期（2013年12月24日至2014年1月22日），在2013年度的实际有效运作期间（2013年12月24日至2013年12月31日）。其中，嘉实1个月理财债券A份额未运作；（2）2014年数据仅统计本基金第一个运作期（2013年12月24日至2014年1月22日），在2014年度的实际有效运作期间（2014年1月1日至2014年1月22日）。其中，嘉实1个月理财债券A份额未运作；（3）2015年全年嘉实1个月理财债券未运作；（4）2016年数据仅统计本基金第二个运作期（2016年12月22日至2017年1月22日），在2016年度的实际有效运作期间（2016年12月22日至2016年12月31日）；（5）2017年数据统计本基金第二个运作期（2016年12月22日至2017年1月22日）在2017年度的实际有效运作期间（2017年1月1日至2017年1月22日）、第三个运作期（2017年3月22日至2017年4月21日）、第四个运作期（2017年6月21日至2017年7月20日）、第五个运作期（2017年9月13日至2017年10月12日）和第六个运作期（2017年12月14日至2018年1月15日）在2017年度的实际有效运作期间（2017年12月14日至2017年12月31日）。（6）2018年1月1日至2018年1月15日仅统计本基金第六个运作期（2017年12月14日至2018年1月15日），在2018年度的实际有效运作期间（2018年1月1日至2018年1月15日）。

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

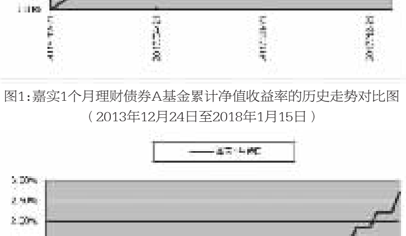

图1：嘉实1个月理财债券A基金累计净值收益率的历史走势对比图（2013年12月24日至2018年1月15日）

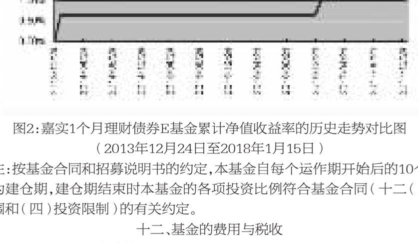

图2：嘉实1个月理财债券E基金累计净值收益率的历史走势对比图（2013年12月24日至2018年1月15日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自每个运作期开始后的10个工作日内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

十二、基金的费用与税收

（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）销售服务费；

（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、仲裁费和诉讼费；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）基金的开户费用、账户维护费用；

（10）基金的注册登记费用；

（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。

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

本基金的管理费采用浮动费率方式收取，具体规则如下：

1）本基金不收取固定管理费，以分档计提方式收取浮动管理费；

2）本基金A类、E类基金份额年化管理费费率上限为0.30%；

3）当期运作期期满时，基金管理人以各类基金份额的“运作期年化收益率”为基础分别分三档收取管理费；各类基金份额的具体档数、不同档数“运作期年化收益率”起止点、不同档数管理费率，具体如下：

档数	A类或E类基金份额运作期年化收益率RA/E	管理费率
第一档	RA/E≤3%	0
第二档	3%＜RA/E≤8%	0.20%
第三档	RA/E＞8%	0.30%

对于每一类别基金份额，在分档模式下，基金管理人将“运作期年化收益率”由低到高分档并设定不同等级的管理费率；“运作期年化收益率”越大的档，管理费率越高；管理费的提取将保证按高档数的管理费计提后计算的“运作期实际年化收益率”不低于按低档数的管理费计提后计算的“运作期实际年化收益率”。为保证上述安排，当运作期年化收益率落在第二档，且3%＜RA/E≤3.20%时，管理费率按RA/E-3%执行（实际执行管理费率≤该档位约定管理费率0.20%）；当运作期年化收益率落在第三档，且8%＜RA/E≤8.10%时，管理费率按RA/E-8.10%+0.30%执行（实际执行管理费率≤该档位约定管理费率0.30%）。

各类基金份额的“运作期年化收益率”、“运作期实际年化收益率”的计算方式详见本基金合同第十八部分的约定。

基金管理费以每个运作期最后一日各类基金份额的基金资产净值为基数，按相应类别基金份额“运作期年化收益率”对应档数的管理费率在运作期最后一日分别计提，当期运作期各类基金份额的管理费计算方法如下：

HA/E＝EA/E×FA/E×当期运作期合计日历日天数÷365

HA/E为A类基金份额或E类基金份额当期运作期应计提的管理费

EA/E为当期运作期最后一日A类基金份额的基金资产净值或E类基金份额的基金资产净值

FA/E为A类基金份额或E类基金份额根据基金合同约定适用的当期运作期管理费费率

管理费计提后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运作期最后一个工作日后的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、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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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，逐日累计至每个月月末，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2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）基金销售服务费

本基金E类基金份额的销售服务费年费率为0.01%，A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的该类别基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。

上述“一、基金费用的种类中第4－11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。

（二）与基金销售有关的费用

本基金不收取申购费用和赎回费用。

（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。

十三、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》、《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：更新了相关代销机构、会计师事务所办公地址信息。

5.在“八、基金份额的申购、与赎回”部分：更新了申购赎回的相关内容。

6.在“九、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、基金的业绩”：基金业绩更新至2018年1月15日。

8.在“二十二、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2017 年 12 月 24 日至2018年 6月 24 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1个月理财债券型证券投资基金基金合同及托管协议的公告》，更新了“基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产的估值、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6日

（上接A22版）

附件：

《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)基金合同》修订对照表

修改前	修改后
第一部分 前言和释义	
释义 上市交易：指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为。	释义 上市交易：指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖A类基金份额的行为。
无	基金份额净值：指基金资产净值除以基金份额总数；针对某一类基金份额，指计算日本类别基金份额的基金资产净值除以计算日该类别基金份额的基金份额余额； 销售服务费：指从相应类别基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用； 基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。
第二部分 基金的基本情况	
无	八、基金份额类别 本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书和相关公告中列示。 本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码，A类基金份额通过场外和场内两种方式销售，并在交易所上市交易（场内份额上市交易，场外份额不上市交易，下同），A类基金份额持有人可进行跨系统转登记；C类基金份额通过场外方式销售，不在交易所上市交易，C类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。由于两类份额的收费方式不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不能相互转换。 本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书和相关公告中列明。
第五部分基金份额的上市交易、申购与赎回	
…… 本基金为上市契约型开放式基金，投资者可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式，实现基金份额的日常交易。	…… 本基金为上市契约型开放式基金，投资者可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式，实现A类基金份额的日常交易；C类基金份额不上市交易。
第一节 基金份额的上市交易 三、上市交易的规则 本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 四、上市交易的费用 本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 五、上市交易的行情揭示 本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市 发生下列情形之一时，本基金应暂停上市： …… 暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请；经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市。 七、终止上市的情形和处理方式 发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易： …… 发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。	第一节 A类基金份额的上市交易 三、上市交易的规则 本基金A类基金份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 四、上市交易的费用 本基金A类基金份额上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 五、上市交易的行情揭示 本基金A类基金份额在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的A类基金份额的基金份额净值。 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市 发生下列情形之一时，本基金A类基金份额应暂停上市： …… 暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请；经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金A类基金份额上市。 七、终止上市的情形和处理方式 发生下列情况之一时，本基金A类基金份额应终止上市交易： …… 发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金A类基金份额的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。
第二节 基金份额的申购与赎回 本基金份额的申购与赎回包括场内申购赎回、场外申购赎回两种方式。	第二节 基金份额的申购与赎回 本基金份额的申购与赎回包括A类基金份额场内申购赎回、各类基金份额的场外申购赎回两种方式。
一、申购与赎回的场所 （二）基金份额的场内申购与赎回场所 深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单见本基金相关业务公告）。 基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的销售场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。	一、申购与赎回的场所 （二）A类基金份额的场内申购与赎回场所 深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单见本基金相关业务公告）。 基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的销售场所或按销售机构提供的其他方式办理各类别基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减各类别基金份额的基金代销机构，并予以公告。
五、申购与赎回的程序 （二）场内申购与赎回的程序 办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。 1.场内申购和赎回的申请方式 …… 投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时，其账户内必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。 3.场内申购和赎回的款项支付 …… 投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。	五、申购与赎回的程序 （二）场内申购与赎回的程序 办理本基金A类基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。 1.场内申购和赎回的申请方式 …… 投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时，其账户内必须有足够的A类基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。 3.场内申购和赎回的款项支付 …… 投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往A类基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。
七、申购费用和赎回费用 1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。 3、本基金申购费率最高不超过5%，赎回费率最高不超过5%。 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。…… 5、……在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。	七、申购费用和赎回费用 1、本基金A类基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用；C类基金份额不收取申购费用。赎回费用由基金赎回人承担。 3、本基金A类基金份额的申购费率最高不超过5%，本基金的赎回费率最高不超过5%。 4、本基金A类基金份额的申购费率、本基金的赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。…… 5、……在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金A类基金份额申购费率和基金赎回费率。
八、申购份额与赎回金额的计算 （一）场外申购份额与赎回金额的计算 1，本基金场外申购份额的计算： 基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中： …… 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值 2，本基金场外赎回金额的计算： 采用“份额赎回”方式，赎回金额以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式： 赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值 …… 3，申购份额、余额的处理方式： 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。 4，赎回金额的处理方式： 赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用来计算，赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。	八、申购份额与赎回金额的计算 （一）场外申购份额与赎回金额的计算 1，本基金场外申购份额的计算： 基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中： …… 申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额的基金份额净值 2，本基金场外赎回金额的计算： 采用“份额赎回”方式，赎回金额以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式： 赎回总金额=某类基金份额的赎回份额×T日该类基金份额的基金份额净值 …… 3，申购份额、余额的处理方式： 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额的基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。 4，赎回金额的处理方式： 赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值为基准并扣除相应的费用来计算，赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
（二）场内申购份额与赎回金额的计算 1，本基金场内申购份额的计算 基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中： …… 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值 2，本基金场内赎回金额的计算 具体计算公式为： 赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值 ……	（二）场内申购份额与赎回金额的计算 1，本基金场内申购份额的计算 基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中： …… 申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额的基金份额净值 2，本基金场内赎回金额的计算 具体计算公式为： 赎回总金额=赎回份额×T日A类基金份额的基金份额净值 ……
（三）本基金基金份额净值的计算： T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。	（三）本基金基金份额净值的计算： 本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
十三、重新开放申购或赎回的公告 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。	十三、重新开放申购或赎回的公告 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。
十五、转托管 2、跨系统转登记 （1）跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。	十五、转托管 2、跨系统转登记 （1）跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。本基金A类份额在交易所上市交易，A类基金份额持有人可进行跨系统转登记；C类基金份额不在交易所上市交易，C类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。
第六部分 基金合同当事人及权利义务	
一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定各类基金份额申购、赎回的价格；
二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；	二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额申购、赎回价格；
三、基金份额持有人 每份基金份额具有同等的合法权益。	三、基金份额持有人 本基金同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。
第七部分 基金份额持有人大会	
基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 一、召开事由 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金资产承担的费用；	基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。同一类别的基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 一、召开事由 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金资产承担的费用；
第十三部分 基金资产估值	
一、估值目的 基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。	一、估值目的 基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的各类别基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。
六、基金份额净值的确认和估值错误的处理 基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。 6 3、差错处理程序 （5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。	六、基金份额净值的确认和估值错误的处理 各类别基金份额净值的计算均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。当估值或任一类别基金份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过该类别基金份额净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到该类别基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。 …… 3、差错处理程序 （5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类别基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类别基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。
第十四部分 基金的费用与税收	
一、基金费用的种类 无	一、基金费用的种类 3、基金的销售服务费；
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 …… 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。	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 …… 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、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费 …… 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。	2、基金托管人的托管费 …… 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。
无	3、销售服务费 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下： H＝E×0.4%÷当年天数 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值 C类基金份额销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人分别支付给各个基金销售机构。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 …… 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。	4、基金合同生效后的指数许可使用费 …… 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10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。
上述一、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。	上述一、基金费用的种类中第5－9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。
四、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。	四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整 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、基金托管费率和/或销售服务费，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。
第十五部分 基金的收益与分配	
三、基金收益分配原则 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额； 场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值； 4、每一基金份额享有同等分配权；	三、基金收益分配原则 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应类别的基金份额； 场内认购、申购和上市交易的A类基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。 3、基金收益分配后各类基金份额的每份基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值； 4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；
六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。	六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为相应类别的基金份额。
第十七部分 基金的信息披露	
五、公开披露的基金信息 （四）基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。	五、公开披露的基金信息 （四）基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。
（七）临时报告 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；	（七）临时报告 16、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 17、任一类别基金份额净值计价错误达该类别基金份额净值百分之零点五；
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	
五、基金财产清算剩余资产的分配 依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。	五、基金财产清算剩余资产的分配 依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余资产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

《嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)托管协议》修订对照表

修改前	修改后
四、基金管理人对基金托管人的业务核查	
基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。	基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。
八、基金资产净值计算和会计核算	
（一）基金资产净值的计算 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。 基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并以加密传真或其他双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。	（一）基金资产净值的计算 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。某类基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日该类别基金份额总份额后的数值。各类基金份额净值的计算均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。 基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额净值并以加密传真或其他双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。
（三）估值差错处理 当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。	（三）估值差错处理 当基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、各类基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、各类基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。
九、基金收益分配	
（一）基金收益分配的原则 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额； 场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定； 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值； 4、每一基金份额享有同等分配权；	（一）基金收益分配的原则 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应类别的基金份额； 场内认购、申购和上市交易的A类基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定； 3、基金收益分配后各类基金份额的每份基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值； 4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；
十一、基金费用	
无	（三）基金销售服务费的计提比例和计提方法 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下： H＝E×0.4%÷当年天数 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值
（四）基金合同生效后的指数许可使用费的计提方法 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。	（四）基金合同生效后的指数许可使用费的计提方法 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10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。
（六）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。	（七）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整 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、基金托管费率和/或销售服务费，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。
（七）基金管理费、基金托管费和指数许可使用费的复核程序、支付方式和时间。基金托管人对不符合《基金法》、《运作办法》等有关规定以及《基金合同》的其他费用有权拒绝执行。 基金托管人对基金管理人计提的基金管理费、基金托管费、指数许可使用费，根据本托管协议和《基金合同》的有关规定进行复核。 基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。 基金托管费每日计提，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2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。	（八）基金管理费、基金托管费、销售服务费和指数许可使用费的复核程序、支付方式和时间。基金托管人对不符合《基金法》、《运作办法》等有关规定以及《基金合同》的其他费用有权拒绝执行。 基金托管人对基金管理人计提的基金管理费、基金托管费、销售服务费、指数许可使用费，根据本托管协议和《基金合同》的有关规定进行复核。 基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。 基金托管费每日计提，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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。 C类基金份额销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人分别支付给各个基金销售机构。 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10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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起10个工作日内或不可抗力情形消除之日起10个工作日内支付。
十六、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算	
（二）基金财产的清算 7、基金财产按下列顺序清偿： (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。	（二）基金财产的清算 7、基金财产按下列顺序清偿： (4) 按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。