

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

[illegible]

序号	名称	净值(元)
1	转出基金费	2,503.03
2	应收申购费	--
3	应收赎回费	--
4	赎回费	296.0453
5	赎回费	2,503.03
6	赎回费	--
7	赎回费	--
8	其他	--
9	合计	300.46715

(4) 报告期末持有处于受限期的可转换债券质押担保情况

报告期末基金未持有处于受限期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票持有在流通受限情况下的明细

报告期末,本基金未持有股票。

十二、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资有风险,投资者在做出投资决策前应先仔细阅读本基金的相关资料。

(一) 本基金组合业绩与比较基准的比较

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准标准差	1-3	2-4
自基金合同生效日起至2013年12月31日	-2.11%	0.05%	0.17%	0.05%	-2.28%	0.07%
2014年	0.19%	0.11%	0.04%	0.10%	-2.01%	0.01%
2015年	10.00%	0.09%	8.8%	0.07%	1.6%	0.02%
2016年	0.61%	0.15%	2.31%	0.08%	-1.88%	0.07%
2017年	-1.08%	0.10%	-0.18%	0.08%	-0.9%	0.02%
2018年	6.12%	0.05%	7.3%	0.07%	-0.66%	0.01%
2019年1月1日至2019年12月31日	1.77%	0.05%	2.80%	0.07%	-0.65%	0.01%

图2: 嘉实中证中期企业债指数(LOP)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势对比图

(2013年12月31日至2019年12月31日)

图2: 嘉实中证中期企业债指数(LOP)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势对比图

(2013年12月31日至2019年12月31日)

注: 按基金合同和招募说明书约定,本基金基金合同生效之日起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“第十五部分(二)投资组合限制”及“七) 投资禁止行为”及“基金的投资”章节中有关基金投资比例和投资禁止行为的有关规定。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1. 费用的种类

(1) 基金管理人管理费;

(2) 基金托管人托管费;

(3) 基金管理人向标的指数供应商支付的相应收取许可协议下的指数使用费;

(4) 基金管理人向标的指数供应商支付的其他相关费用,如版权费、印花税、证券费、过户费、手续费、券商佣金、权益处分的相关税费及其他类似性质的费用;

(5) 基金合同生效日后的信息披露费;

(6) 基金销售服务费;

(7) 基金上市费及上市费;

(8) 基金销售服务费;

(9) 基金管理人审计费;

(10) 按照国家有关规定计提的以列人的其他费用。

2. 基金费用的计提方法

(1) 基金管理人管理费

本基金管理人管理费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理人管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付管理费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人托管费

本基金托管人托管费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.005\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管人托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人应于每月末支付托管费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(4) 基金上市费及上市费

本基金上市费及上市费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金上市费及上市费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付上市费及上市费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(5) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(6) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(7) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(8) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(9) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(10) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(11) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(12) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(13) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(14) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(15) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(16) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(17) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(18) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(19) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人应于每月末支付销售服务费,经基金管理人向基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月月初3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(20) 基金销售服务费

本基金销售服务费按基金资产净值的一定比例计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费