

嘉实中关村A股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15日更新)

办公地址	北京市西城区复兴门大街2号嘉实基金总部4层401室	邮编	100048
电话	010-59323888	传真	010-65015577
联系人			

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道1610号上海国金中心二期27层02单元	邮编	200120
电话	021-68899898	传真	021-38899893
联系人			

（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1777号中融国际金融中心22层02单元	邮编	610044
电话	028-85062200	传真	028-85062205
联系人			

（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4069号平安金融大厦1012	邮编	518048
电话	0755-83983390	传真	0755-22670923
联系人			

（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区江苏路1号海信广场B座1203室	邮编	266011
电话	0532-85977797	传真	0532-16677606
联系人			

（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区钱江新城新业路1396号12楼1201室	邮编	311101
电话	0571-88002202	传真	0571-88002201
联系人			

（7）嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区江滨大道127号中融国际金融中心4101室	邮编	350001
电话	0591-88003390	传真	0591-88003393
联系人			

（8）嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市江宁区中山东路388号南京新城大厦1803室	邮编	211105
电话	025-84891118	传真	025-16997150
联系人			

（9）嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江新城华夏路10号富力盈信商务中心301室	邮编	510623
电话	020-65503666	传真	020-65503666
联系人			

2.销售机构:

(1)中信建投证券股份有限公司

名称	北京市西城区复兴门内大街2号4层	联系人	
办公地址	北京市西城区复兴门内大街158号	联系人	
法定代表人	王常青	联系人	魏欣
电话	010-60833888	传真	010-60833222
网址	http://www.citics.com	客服电话	400-8888-108

(2)招商证券股份有限公司

名称	深圳市福田区福田街道福安社区深业大厦4-02	联系人	
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区益田路5013号113	联系人	
法定代表人	秦晓	联系人	魏刚
电话	0755-84880666	传真	0755-84880600
网址	http://www.newchina.com.cn	客服电话	95565

(3)中信证券股份有限公司

名称	北京市朝阳区光华路10号院2号楼16层1601-1602	联系人	
办公地址	北京市朝阳区光华路10号院2号楼16层1601-1602	联系人	
法定代表人	王常青	联系人	魏欣
电话	010-59323888	传真	010-59323888
网址	http://www.citics.com	客服电话	95558

(4)中国银河证券股份有限公司

名称	北京市西城区金融大街50号大成大厦6层	联系人	
办公地址	北京市西城区金融大街50号大成大厦6层	联系人	
法定代表人	陈共炎	联系人	中国银河
电话	010-66568887	传真	010-66568888
网址	http://www.chinasec.com	客服电话	400-8888-100

(5)南通证券股份有限公司

名称	上海浦东新区世纪大道1500号14楼	联系人	
办公地址	上海浦东新区世纪大道1500号14楼	联系人	
法定代表人	周俊	联系人	李海荣
电话	021-52321888	传真	021-52321828
网址	http://www.ntsec.com.cn	客服电话	400-8888-100

(6)申万宏源证券有限公司

名称	上海市浦东新区世纪大道1600号	联系人	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号	联系人	
法定代表人	李巍	联系人	陈宇
电话	021-38931314	传真	021-38931324
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	95523

(7)中信证券(山东)有限责任公司

名称	青岛市市南区江苏路122号1号楼3001	联系人	
办公地址	青岛市市南区江苏路122号1号楼3001	联系人	
法定代表人	姜晓林	联系人	魏欣
电话	0531-16010066	传真	0531-16010066
网址	http://www.citics.com	客服电话	95548

(8)兴业证券股份有限公司

名称	福州市城街86号	联系人	
办公地址	福建省福州市城街86号	联系人	
法定代表人	高建平	联系人	孙伟
电话	0591-28393338	传真	0591-28393328
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	96321

(9)东方财富证券股份有限公司

名称	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际商会大厦2-1001	联系人	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1500号东方财富大厦2009	联系人	
法定代表人	陈涛	联系人	王斌
电话	021-68327000	传真	021-68327000
网址	http://www.eastmoney.com	客服电话	95051

(10)方正证券股份有限公司

名称	吉林省长春市净月大街1566号方正证券大厦	联系人	
办公地址	吉林省长春市净月大街1566号方正证券大厦	联系人	
法定代表人	孙建	联系人	王斌
电话	0431-22080000	传真	0431-22080000
网址	http://www.fundao.com.cn	客服电话	96071

(11)光大证券股份有限公司

名称	上海市浦东新区世纪大道1800号	联系人	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1800号	联系人	
法定代表人	薛峰	联系人	刘冰
电话	021-22168888	传真	021-22168888
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	95595

(12)申万宏源西部证券有限公司

名称	新疆乌鲁木齐市文晖路2号宏源大厦	联系人	
办公地址	新疆乌鲁木齐市文晖路2号宏源大厦	联系人	
法定代表人	李琦	联系人	王斌
电话	0991-2397700	传真	0991-2397700
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	96088、96021

(13)中泰证券股份有限公司

名称	山东省济南市经二路纬三路	联系人	
办公地址	济南市市中区经二路纬三路	联系人	
法定代表人	李玮	联系人	孙伟
电话	0531-21610000	传真	0531-21610000
网址	http://www.ztsec.com	客服电话	95538

（二）注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区大街2号A座17号
法定代表人:周明
电话:010-59378888
传真:010-59378907
联系人:朱立元

（三）律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19和16楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19和16楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华
联系人:陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)	联系人	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号原环球金融中心40楼4002单元	联系人	
法定代表人	李丹	联系人	陈颖
电话	021-22122000	传真	010-22122000
注册会计师	陈颖、陈颖	注册会计师	陈颖、陈颖

四、基金的名称

本基金名称:嘉实中关村A股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

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。本基金力争日跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过3%。

六、基金的投资目标

本基金的投资范围主要为标的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的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、金融债、企业债、可转债、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)、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)。

如法律法规及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%,且不低于非现金基金资产的80%,因法律法规的规定而受限制的情况除外。

七、基金的投资策略

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。

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。

八、基金的费用率

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正常

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。

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。

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 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

③ 资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款支持资产的构成及质量等因素,主要从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例、证券的信用增级方式、利率补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估,在严格控制风险的情况下,确定资产合理配置比例,在保证资产安全性的前提下操作,以期获得长期稳定收益。

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

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数基金重大调整的对决策,其重大组合投资决策以及重大的单项投资决策;基金投资决策日常跟踪监控过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3.投资管理

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机结合共同构成了本基金的投资管理体系。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。

(1)研究:指数投资研究小组依托公司整体研究平台,整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展标的指数的跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)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项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委员会的决议,每日进行基金投资组合的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数相关信息,结合内部指数投资研究,基金经理主要以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当指数投资的方法,以降低投资成本、控制投资组合风险。

(4)交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资组合绩效:风险管理部定期和不定期对基金进行投资组合绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将根据标的指数的变动情况,并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效变动的结果等,对投资组合进行动态调整,密切跟踪业绩比较基准。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资组合做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中关村A股指数,业绩比较基准为中关村A股指数收益,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替代,或由于指数编制方法变更导致变更上述指数不继续作为标的指数,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),无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金份额持有人同意后变更标的指数,报中国证监会备案并及时公告。若变更标的指数对投资组合表现和投资策略有实质性影响,且对基金份额持有人利益造成实质性影响,则需召开持有人大会,并报证监会备案。

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,债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年3月31日(“报告期末”),本报告所列财务报表数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	19,089,233.08	97.17
	其中:股票	19,089,233.08	97.17
2	债券投资	14,300.00	0.07
	其中:国债	14,300.00	0.07
	其中:金融债	14,300.00	0.07
	其中:企业债	-	-
3	货币资金	949,009.92	4.76
4	其他金融资产	28.26	0.00
5	合计	19,089,233.08	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退偿贷款的估值增值。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数股按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	176,250.00	0.89
B	制造业	97,267,043.84	49.40
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,023.00	0.61
D	建筑业	2,377,199.00	12.09
E	金融业	366,475.00	1.86
F	信息技术业	253,022.00	1.31
G	房地产业	253,022.00	1.31
H	批发和零售业	400,470.00	2.06
I	交通运输、仓储和邮政业	227,202.00	1.16
J	住宿和餐饮业	272,761.00	1.41
K	综合类	203,300.00	1.05
L	医疗保健业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
合计		19,089,233.08	97.17

注:股票投资的公允价值包含可退偿贷款的估值增值。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数股按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	176,250.00	0.89
B	制造业	97,267,043.84	49.40
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,023.00	0.61
D	建筑业	2,377,199.00	12.09
E	金融业	366,475.00	1.86
F	信息技术业	253,022.00	1.31
G	房地产业	253,022.00	1.31
H	批发和零售业	400,470.00	2.06
I	交通运输、仓储和邮政业	227,202.00	1.16
J	住宿和餐饮业	272,761.00	1.41
K	综合类	203,300.00	1.05
L	医疗保健业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
合计		19,089,233.08	97.17

(2)报告期末积极股按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资股票。