

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII-LOF 更新招募说明书摘要

(2020年1月23日更新)

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示

嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(“QDII-LOF”)(以下简称“本基金”)根据2010年4月19日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2010]479号文)批准进行募集。本基金合同自2010年9月30日起生效,自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

本基金的投资风险、投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

本产品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,其持有基金份额的为自身即为基金合同的当事人和接受人,并按照《证券投资基金管理暂行办法》、《运作办法》、基金合同及其他相关约定享有权利、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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定,本次更新招募说明书更新与修订基金合同、托管协议相关内容,包括“重要提示”、“释义”、“基金的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、“基金合同的内含摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节,并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

一、基金名称

本基金名称:嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)

二、基金的类型

上市契约型开放式,股票型证券投资基金

三、基金的投资目标

本基金进行被动指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%,年跟踪误差不超过4%,以实现对恒生中国企业指数的有效投资。

四、基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股、备选股,同一标的指数的ETF,以及依法发行或上市的其他股票、固定收益证券、现金、短期金融工具、同一标的指数的期货期权、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%;权证市值不超过基金资产净值的3%;现金及到期日在一年内的政府债券不高于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金,存入保证金,申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在合理期限内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

五、基金的投资策略

本基金将采取被动指数化投资,在恒生中国企业指数成份股和备选成份股中,选取具有代表性的成份股,并根据市场情况选择不同的方式实施组合构建,以达到节约的成本和更好地跟踪标的指数的目的。

六、资产配置策略

如果因股票停牌的限制,股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依据权重重购买入某只成份股,或因标的指数成份股将调整,或(其他)影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,经综合判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

七、基金的投资策略

(1) 投资决策原则:

本基金原则上按指数复制法进行被动指数化投资,根据恒生中国企业指数成份股的基准权重构造股票投资组合。

如果因股票停牌的限制,股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依据权重重购买入某只成份股,或因标的指数成份股将调整,或(其他)影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,经综合判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

(2) 基金组合构建:

本基金原则上按指数复制法,按照成份股在基准指数恒生中国企业指数中的基准权重构建股票投资组合。

如果因股票停牌的限制,股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依据权重重购买入某只成份股,或因标的指数成份股将调整,或(其他)影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,经综合判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

(3) 本基金投资ETF主要基于以下策略:(a)根据ETF的折溢价情况,在标的指数成份股和ETF之间选择投资的方式及构建组合;(b)根据ETF的溢价情况,参与ETF套利,以增加基金投资收益;(c)日常基于申购赎回ETF进行套利操作,从而避免申购赎回而形成的成份股频繁交易所带来的交易成本和交易冲击。

八、基金的衍生品投资

本基金部分投资于金融衍生品,投资策略主要包括:利用衍生品生产,以降低基金汇率风险;利用指数衍生品,以应对申购赎回时基金跟踪效果的影响和提高投资管理效率等。

本基金将积极投资衍生品或有效管理,在基金风险承受能力许可的范围内,本着谨慎原则,适度参与金融衍生品投资,利用衍生品生产,以降低基金汇率风险;利用指数衍生品,以应对申购赎回时基金跟踪效果的影响和提高投资管理效率等。

九、基金的组合构建:

本基金原则上按指数复制法,按照成份股在基准指数恒生中国企业指数中的基准权重构建股票投资组合。

如果因股票停牌的限制,股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依据权重重购买入某只成份股,或因标的指数成份股将调整,或(其他)影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,经综合判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

十、投资决策体制

本基金原则上按指数复制法进行被动指数化投资,根据恒生中国企业指数成份股的基准权重构造股票投资组合。

如果因股票停牌的限制,股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依据权重重购买入某只成份股,或因标的指数成份股将调整,或(其他)影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,经综合判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近基准指数的收益率。

十一、基金托管人

(一) 基金托管人情况:

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市东城区金融大街2号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:田国立

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币伍佰零玖亿零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田青

联系电话:(010)656759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家全国领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码0939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年度,集团实现净利润2,556.26亿元,较上年增长4.93%,资产负债率和平均净资产收益率分别为11.3%和14.04%;不良贷款率为1.46%,保持同业中有明显优势。

在所有合法合规的前提下,中国建设银行严格按照国家有关规定,坚持稳健经营,坚持审慎经营原则,遵循批量转让以个人为主的基本户为主的原则,对恶意逃废债客户,坚持依法合规处置,确保债权安全。

在所有合法合规的前提下,中国建设银行严格按照国家有关规定,坚持稳健经营,坚持审慎经营原则,遵循批量转让以个人为主的基本户为主的原则,对恶意逃废债客户,