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05月08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）核准进行募集。本基金基金合同于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。

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。

本摘要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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2020年4月5日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日（未经审计），特别事项注明除外。

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

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束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跟踪，给投资者提供一个投资恒生中国企业指数的有效投资工具。

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、固定收益类证券、现金、短期金融工具、同一标的指数的股指期货、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。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。

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以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

（一）投资策略

本基金为被动式指数基金，按照成份股在恒生中国企业指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金可以投资于同一标的指数的ETF，基金管理人可在香港恒生国企指数成份股和同一标的指数的ETF之间选择较优的方式实施组合构建，以达到节约成本和更好地跟踪标的指数的目的。

基金管理人应当在基金合同生效后6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

1、资产配置策略

作为被动式指数基金，本基金主要投资于恒生中国企业指数成份股和备选成份股。本基金将根据市场的实际情况，投资于金融衍生产品，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票组合构建

（1）股票投资原则：

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

（2）股票组合构建方法：

本基金原则上采用指数复制法，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。如有(a)因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股，或(b)预期标的指数的成份股调整将调整，或(c)其他影响指数复制的因素，基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，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之间选择较优的方式实施组合构建；(b)根据ETF折溢价情况，参与ETF套利，以增加基金投资收益；(c)日常基金申购赎回通过ETF构造投资组合，以避免申购赎回而导致的成份股频繁交易所带来的交易成本和交易冲击。

（4）金融衍生产品投资

本基金部分投资于金融衍生产品，以降低跟踪误差和提高投资管理效率。

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与金融衍生产品投资。投资策略主要包括：利用期货、期权等衍生品工具，以降低基金汇率风险；利用指数衍生产品，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；等等。

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加投资收益。未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并按照相关规定发布临时公告。

（二）投资管理体制

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制

1、投资决策委员会

负责本基金的整体战略和原则审定；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

2、定量策略小组

跟踪并研究标的指数资料信息，计算标的指数的成份股基准权重、预测成份股调整清单，为本基金投资管理提供基础数据支持；根据基金投资组合与标的指数的权重差异提出投资组合调整建议；定期提供基金风险控制报告和绩效评估报告；基金经理提出的其他技术需求支持。

3、基金经理

在定量策略小组的技术支持下，负责基金投资组合的构建与日常管理。

（三）投资程序

1、投资分析

定量策略小组根据标的指数的相关资料和数据，利用数量模型进行历史模拟和风险测算；行业分析师对标的指数成份股的基本面情况进行实时跟踪，对基本面恶化的上市公司提供及时的风险分析报告，在此基础上形成投资组合调整建议

在约束组合调整建议的基础上，基金经理结合本基金的投资总体目标和原则，以及本基金投资组合状况，确定投资组合调整方案。

投资决策委员会定期召开会议，审定基金经理提交的投资检讨报告，并提出指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见，在基金经理的权限内管理投资组合。对超出基金经理权限的投资组合须报投资决策委员会审议批准。

2、资产配置

本基金采取自上而下的资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，然后再分别确定下一层次股票资产和现金资产的配置。

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以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

六、基金的投资组合限制

1、基本投资组合

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	224,510,466.33	93.81
	其中：普通股	224,510,466.33	93.81
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：交易所回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,954,872.06	5.41
8	其他资产	1,868,751.07	0.78
9	合计	239,334,079.46	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为318,091.48元，占基金资产净值的比例为0.13%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为36,435,017.55元，占基金资产净值的比例为15.37%。

2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	224,510,466.33	94.73

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

(1) 报告期末按指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	12,164,400.85	5.13
必需消费品	6,609,011.10	2.79
能源	21,085,643.69	8.90
金融	90,681,831.96	38.26
医疗保健	8,583,292.30	3.62
工业	6,897,989.72	2.91
原材料	3,078,268.29	1.30
房地产	18,748,583.82	7.91
公用事业	9,381,263.13	3.96
通信服务	47,280,101.47	19.95
合计	224,510,466.33	94.73

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类。

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

4. 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股票及存托凭证投资明细

(1) 报告期末按指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属证券市场（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	72,900	24,527,567.16	10.26
2	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	263,000	20,872,838.51	8.81
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	3,593,000	19,311,225.24	8.15
4	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港证券交易所	中国香港	299,500	17,572,740.21	7.41
5	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	3,869,000	11,541,023.49	4.87
6	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	870,000	10,100,098.65	4.26
7	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	363,000	7,039,890.23	2.97
8	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	190,350	6,828,994.51	2.88
9	China Petroleum & Chemical Corp	中国石化	386 HK	香港证券交易所	中国香港	1,181,600	4,964,147.61	2.09
10	Sunac China Holdings Ltd	融创中国	1918 HK	香港证券交易所	中国香港	119,000	4,962,128.52	2.09

注：(1) 报酬本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，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%。（2）本表所使用的证券代码为彭博代码。

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

6. 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债券投资明细

无。

7. 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

无。

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五名金融衍生品投资明细

无。

9. 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基金投资明细

无。

10. 投资组合报告附注

(1)

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。

(2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	337.42
2	应收证券清算款	1,336,839.76
3	应收股利	39,078.93
4	应收利息	2,351.88
5	应收申购款	496,143.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,868,751.07

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

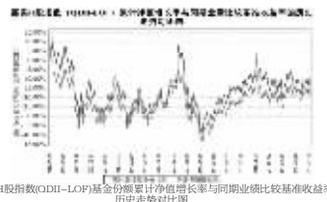
九、基金的业绩

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。

（一）基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
2010年9月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日	-9.96%	0.98%	0.71%	1.39%	-10.67%	-0.41%
2011年	-23.03%	1.16%	-25.41%	1.06%	2.38%	-0.09%
2012年	15.44%	1.22%	15.11%	1.30%	0.33%	-0.08%
2013年	-6.00%	1.30%	-8.29%	1.39%	2.29%	-0.09%
2014年	14.88%	1.11%	11.18%	1.18%	3.70%	-0.07%
2015年	-19.79%	1.63%	-14.39%	1.75%	-5.40%	-0.16%
2016年	3.56%	1.32%	3.83%	1.42%	-0.27%	-0.10%
2017年	16.78%	0.92%	16.47%	0.96%	0.31%	-0.04%
2018年	-8.52%	1.28%	-9.36%	1.37%	0.84%	-0.09%
2019年	14.54%	0.94%	12.77%	0.99%	1.77%	-0.05%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图：嘉实H股指数(QDII-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年9月30日至2019年12月31日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起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（十四（二）投资范围和（六）投资限制）的有关约定。

十、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1. 基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14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	经理
成立日期	1999年5月25日
注册资本	15亿元
股权结构	中国银行有限责任公司40%、DWS Investments Singapore Limited 30%、立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）68215688
传真	（010）68185678
联系人	胡勇钦

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、北京外资、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

（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情况

朱证立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行（香港）有限公司（以下简称“中国银行业监督管理委员会（下称‘银监会’）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长、党委书记，经济学博士。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、天津纺织原材料交易所、商品期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

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。

Mark H.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。曾任达灵顿商品(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，德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD，德意志银行（伦敦）首席运营官，德意志银行全球审计主管。现任DWS Management GmbH执行董事、全球首席运营官。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息证券品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职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，万丽投资管理有限公司董事长。2004至今任万丽并购集团董事长。

涂欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编、两届奥运选派“中国商法”丛书编辑委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，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百任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士、会计学教授、注册会计师、中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学财政学院长兼MBA教育中心主任。

经雷先生，董事，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长、中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

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主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾晓发先生，监事，经济学硕士。1990年7月至2003年6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。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京光维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平安人寿保险股份有限公司（券）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理，2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部内行总监，现任基金运营总监。

宋振韬女士，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12月任职于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年9月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察负责人兼稽核组组长、监察稽核部总监。

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、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2、基金经理

（1）现任基金经理

高峰先生，硕士研究生，5年证券从业经历，具有基金从业资格，北京大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA），曾任中国工商银行股份有限公司金融市场部外汇及衍生品交易员。2015年加入嘉实基金管理有限公司所属投资部，现任指数投资部基金经理。2019年4月2日至今任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年4月2日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，2019年9月26日至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月28日至今任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月28日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理，2019年9月28日至今任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年9月28日至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年11月1日至今任嘉实中证新兴科技100策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年12月5日至今任嘉实中证光谱制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

何如女士，硕士研究生，14年证券从业经历，具有基金从业资格，加拿大籍。曾任职于IA宏英灵顿投资管理公司（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，先后任职产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014年6月13日至2019年9月28日任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2014年6月13日至2019年9月28日任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2014年9月20日至2019年9月28日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年8月6日至2019年9月28日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016年1月5日至2017年12月26日任深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年1月5日至2019年9月28日任嘉实深证基本面指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016年1月5日至2017年12月26日任嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2017年6月29日至2019年3月30日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2017年7月3日至2019年3月30日任嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017年7月14日至2019年4月2日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016年1月5日至今任嘉实中证能源基本面50指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016年1月5日至今任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年1月5日至今任嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年1月5日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，2019年5月23日至今任嘉实中证能源基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年8月8日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年12月9日至今任嘉实沪深300红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年3月16日至今任嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

张宏民先生，管理时间为2010年9月30日至2013年1月25日；杨阳先生，管理时间为2013年1月25日至2014年3月11日；杨宇先生，管理时间为2014年3月11日至2016年1月5日；陈正宪先生，管理时间为2016年1月5日至2019年4月2日。

3、海外投资决策委员会

海外投资决策委员会成员包括：嘉实国际首席投资官 Thomas Kwan、资深基金经理Eric Liu、Yiqian Jiang、Chenye Yannan、June Chua、Ching Yin Fung、Kevin Sung,风险管理部 Ray Li、Mengxiao Yu。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

十一、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25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：或折在岗亿元人民币

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)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、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939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年末，集团资产规模23,22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国金融风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球资产管理业务最佳创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年全球最佳银行”、《亚洲银行家》“2018年中国最佳银行”、《证券时报》“2018年度最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年全球最佳银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽省设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心，上海分中心，托管人员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

蔡亚萍，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郎红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管证券投资基金、中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后获20次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”，在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务配配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章设置保管、存放、使用、账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作，利用自行开发的“新一代托管业务监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督程序

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易、电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

十二、境外资产托管人

（一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Ronald P. O' Hanley

成立时间：1891年4月13日

截止到2019年12月31日，所有者权益（Shareholders' Equity）：245.71亿美元

（二）托管资产规模、国际信用评级和托管业务

道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于1891年，目1924年成为美国第一个共同基金的托管人后，道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。2019年12月31日，托管和行政管理资产总额已达到34.36万亿美元，一级资本比率为15.7%。道富银行长期存款信用评级为AA-（标准普尔）及Aa1（穆迪投资），道富银行在全球30多个国家或地区设有分事处，截至2019年12月31日道富拥有约4万名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务，包括全球托管、基金会计、绩效评估、投资纠纷监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

（三）境外托管人的职责

1、安全保管受托财产；

2、计算境外受托资产的资产净值；

3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；

4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；

5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；

6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；

7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

十三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层
电话	（010）68215688
传真	（010）68215677
联系人	黄娜

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
电话	（021）38789068
传真	（021）68880023
联系人	邵琦

（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177号中南国际中心A座2单元21层04-06单元
电话	（028）86202100
传真	（028）86202100
联系人	王启明

（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6001号太平金融大厦16层
电话	0755-84362200
传真	（0755）25870663
联系人	陈寒梦

（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室
电话	（0532）66777997
传真	（0532）66777676
联系人	胡凯峰

（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城2幢1001A室
电话	（0571）88061