

中创400交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2013年第2号)

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

中创400交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金或基金”)根据2012年1月6日中国证券监督管理委员会《关于核准中创400交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2012]201号)核准进行募集。本基金基金合同于2012年3月22日生效,自即日起基金管理人正式开

重要提示
投资者认购、申购本基金会应认真阅读本基金的招募说明书。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书所载基金合同和招募说明书摘要,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系具有法律约束力的文件,投资者在认购、申购基金前应仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金投资运作规则等法律文件,并仔细阅读《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》及其他相关法律法规,了解基金的风险和收益特征,并自行承担投资风险。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证投资者最低收益。
本招募说明书所载基金合同于2013年9月22日(特别事项注明截止日除外),有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人概况
1.基本情况
名称:嘉实基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址:北京市朝阳区光华路甲8号华润大厦A座15层
法定代表人:魏臻
总经理:魏臻
成立日期:1999年3月25日
注册资本:1.5亿元人民币

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准,于1999年3月25日成立,是中国首批基金管理公司之一,也是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并覆盖成都、杭州、青岛、福州、广州、重庆。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理资格, QDII资格和特定资产管理业务资格。
嘉实基金管理有限公司无任何处罚记录。

二、基金托管人概况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街26号
法定代表人:姜建清
行长:姜建清
成立时间:1985年10月1日
注册资本:人民币419,018,545,827元
联系人:赵会军
电话:010-61051079

三、基金投资目标
本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,追求跟踪标的指数并力求跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差率不超过2%。
此外,为了更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票),衍生品工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债、可分离债、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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。

四、基金投资策略
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。但在特殊情况下,如流动性原因导致无法获得足够数量的股票时,或因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投资策略进行适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。
在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差率不超过2%。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时,基金管理人应采取合理措施降低跟踪误差,力争使跟踪偏离度和跟踪误差控制在合理范围之内。

五、基金投资组合
本基金投资组合的构建原则如下:
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资产的决策依据。
2. 投资管理目标
本基金管理人投资运作基金管理人领导下的基金跟踪组合。投资决策委员会负责制定有关跟踪组合的投资策略,其他相关部门根据投资决策委员会以及授权范围内的授权,负责跟踪组合的日常投资管理,并定期向投资决策委员会报告跟踪组合的投资情况。
3. 投资策略
研究、决策、组合构建、评估、组合维护等有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的

2009.10.20, 2011年5月顺利通过评级组织内部控制规范实施类第SA400《审计标准》第7号)修订后,2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402(前SA70)审阅获得无保留意见的控制及有效性评价,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行履行受托职责的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅范围已年度化、常规化的工作手段。

一、内部控制控制目标
内部业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规定,规范运作,防范和化解经营风险,保证基金资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。
二、内部控制控制组织架构
中国工商银行资产托管部内部风险控制架构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。资产托管部内设风险控制处负责全行资产托管业务,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部还设置专门负责跟踪组合工作的内部控制控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律法规,对业务的运行执行内部控制控制。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

三、内部控制控制原则
1. 合法性原则:内部控制应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
2. 完整性原则:托管业务的所有经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约,监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。
3. 及时性原则:托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录,按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到有章可循、有据可依。
4. 审慎性原则:各项业务经营活动必须规范运作,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

四、内部控制控制措施
1. 有效性原则:内部控制应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面有效执行,不得有任意例外、时限及人员的例外。
2. 独立性原则:设立专门履行托管人职责的管理部门,直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当交叉;内部控制措施、评价部门必须独立于内部控制制定和执行部门。
3. 审慎性原则:资产托管业务与传统的业务严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册,严格的人员行为规范等一系列规章制度,建立了完善的内部授权制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和流程独立、网络独立。

五、内部控制控制评价
1. 内部控制控制评价:资产托管部通过制定计划、编制预算等方式开展各种业务经营活动,处理各项事务,从而有效控制和降低风险,保障资产的安全完整。
2. 内部控制控制评价:资产托管部建立了完善的内部控制制度,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的内部控制评价标准,并定期开展评价工作,使内部控制制度更加完善,资产托管部不断提高风险管理标准,从宏观到微观,从制度到执行,从业务与业务的衔接,从流程到流程,从跟踪组合到跟踪组合,资产托管部完全有能力在发生突发性事件时两个小时内恢复业务。

六、数据安全控制
我们通过业务操作区相对独立、数据备份增加、数据备份传输线路的冗余备份、监控设备的运用等措施来保障数据安全。
七、业务连续性保障
资产托管部建立了完善的灾备系统,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的业务连续性保障计划,并定期开展评价工作,使业务连续性保障标准不断提高,资产托管部不断提高风险管理标准,从宏观到微观,从制度到执行,从业务与业务的衔接,从流程到流程,从跟踪组合到跟踪组合,资产托管部完全有能力在发生突发性事件时两个小时内恢复业务。

八、基金投资组合
本基金投资组合的构建原则如下:
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资产的决策依据。
2. 投资管理目标
本基金管理人投资运作基金管理人领导下的基金跟踪组合。投资决策委员会负责制定有关跟踪组合的投资策略,其他相关部门根据投资决策委员会以及授权范围内的授权,负责跟踪组合的日常投资管理,并定期向投资决策委员会报告跟踪组合的投资情况。
3. 投资策略
研究、决策、组合构建、评估、组合维护等有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的百分比(%)

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。
9. 研究:指数投资研究小组依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、跟踪及归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。
10. 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,定期召开投资决策大会,对重大资产配置决策,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理日常工作。

11. 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跟踪法构建组合。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,控制跟踪误差。
12. 跟踪偏离度控制:基金经理负责具体的交易执行,同时履行一线跟踪职责,并提供相关报告,确保投资组合跟踪标的指数,跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。
13. 风险控制:基金经理定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告,确保投资组合跟踪标的指数,跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

14. 风险监控与调整:基金经理将根据标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流情况等因素对投资组合进行动态调整,并定期对基金投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
15. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
16. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

17. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
18. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
19. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
20. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

21. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
22. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
23. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
24. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

25. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
26. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
27. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
28. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

29. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
30. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
31. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
32. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

33. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
34. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
35. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
36. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

37. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
38. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
39. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
40. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

41. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
42. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
43. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
44. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

45. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
46. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
47. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
48. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

49. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
50. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
51. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
52. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

53. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
54. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
55. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
56. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

57. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
58. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
59. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
60. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

61. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
62. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
63. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
64. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

65. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
66. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
67. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
68. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

69. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
70. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
71. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
72. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

73. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
74. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
75. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
76. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

77. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
78. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
79. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。
80. 基金管理人将根据基金合同及相关法律法规的要求,对投资组合进行跟踪和评估,密切跟踪标的指数。

报告期末,本基金未持有有限售权股票。
6. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
7. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
8. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
9. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
10. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
11. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
12. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
13. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
14. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
15. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
16. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
17. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
18. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
19. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
20. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
21. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
22. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
23. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
24. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
25. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
26. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
27. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
28. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
29. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
30. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
31. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
32. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
33. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
34. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
35. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
36. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
37. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
38. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
39. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
40. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
41. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
42. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
43. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
44. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
45. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
46. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
47. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
48. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
49. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
50. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
51. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
52. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
53. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
54. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
55. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
56. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
57. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
58. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
59. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
60. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
61. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
62. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
63. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
64. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
65. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
66. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
67. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
68. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
69. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
70. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
71. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
72. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
73. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
74. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
75. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
76. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
77. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
78. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
79. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
80. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
81. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
82. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
83. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
84. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
85. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
86. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
87. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
88. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
89. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
90. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
91. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
92. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
93. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
94. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
95. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
96. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
97. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
98. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
99. 报告期末本基金未持有有限售权股票。
100. 报告期末本基金未持有有限售权股票。

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)