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

（2014年第2号）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

重要提示

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，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。基金投资人放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。

本摘要所载内容截止日为2014年9月30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2014年6月30日（未经审计）。

一、基金的名称

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03%，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，同一标的指数的股票、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%。

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，按照成份股在指数中恒定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预期的范围之内。

本基金可以投资于同一标的指数的ETF，基金管理人可在有利于恒生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。

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。如有如因受投资限制等情况限制，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，或如预期标的指数的成份股调整调整，或如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效益率。

（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，以避免申购赎回市场成份成份股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，以降低跟踪成本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：利用汇率衍生产品，以降低基金汇率风险；利用指数衍生产品，以应对申购赎回对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，预测成份股调整病单，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跟踪评估报告；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地摸察，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

在投资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。

基金经理根据投决委会会议的指导性意见，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指令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%。

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。

3.组合构建

在股票资产配置上，本基金首先按照基准指数的行业权重，确定各行业的资产配置比例，然后按照行业内各个股的成份股权重，确定各个股的资产配置比例。对于因股票停牌、流动性不其他因素而无法投资的个股，本基金将尽量用本行业的个股或个股组合进行替代，以保证各行业的资产配置比例和基准指数的行业权重保持一致。如有如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，或如预期标的指数的成份股调整病单，或如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。

4.交易执行

基金经理在定量策略小组和行业分析师报告的基础上，结合市场情况和本基金的风险状况，进行投资组合的日常管理，并基金交易部下达投资指令。

基金交易部执行投资指令的同时对交易执行情况进行监控，并将最终的完成情况及时向基金经理汇报。

5.风险绩效评估

本基金的投资绩效评价指标有两个：跟踪误差和累计偏差。跟踪误差衡量本基金与标的指数的组合偏离程度，力争控制本基金的净值增长率与基准指数增长率之间的日平均跟踪误差小于03%，年跟踪误差不超过4%；累计偏差是指衡量期间内本基金相对于标的指数的累计收益率，在相同跟踪误差水平的情况下，累计偏差的正收益比负收益好。

6.投资组合调整

本基金以指数编制的基本原则，股票指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、基金合同中的资产配置比例约定、申购赎回情况、新股等因素，对股票指数化投资组合进行适当调整，以保证基金对基准指数的有效跟踪。

六、基金的业绩比较基准

本基金标的指数是恒生中国企业指数。

本基金的业绩基准为：人民币/港币汇率×恒生中国企业指数

七、基金的风险收益特征

本基金属于被动式指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

八、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16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2014年6月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,568,008.16	92.54
	其中：普通股	62,568,008.16	92.54
	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：买断式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	3,603,295.41	5.33
8	其他资产	1,437,941.83	2.13
9	合计	67,609,245.40	100.00

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	62,568,008.16	93.47
合计	62,568,008.16	93.47

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	2,908,831.81	4.35
必需消费品	577,215.00	0.86
能源	13,927,934.43	20.81
金融	37,975,105.85	56.73
医疗保健	925,782.38	1.38
工业	1,651,277.81	2.47
电信服务	1,383,823.75	2.07
原材料	1,814,290.25	2.71
公用事业	1,403,746.88	2.10
合计	62,568,008.16	93.47

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

(2)报告期末非指投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末，本基金未持有非指投资股票及存托凭证。

4.前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	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	1,537,000	5,977,969.38	8.93
2	Bank of China Ltd	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	2,124,000	5,850,159.75	8.74
3	PetroChina Co. Ltd.	中国石油股份	857 HK	香港证券交易所	中国香港	700,000	5,439,568.75	8.13
4	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份	386 HK	香港证券交易所	中国香港	845,600	4,960,131.05	7.41
5	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	1,036,400	4,401,137.38	6.57
6	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	247,000	3,979,941.88	5.95
7	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	67,500	3,214,687.50	4.80
8	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	259,350	3,145,526.48	4.70
9	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行	998 HK	香港证券交易所	中国香港	778,000	2,902,426.25	4.34
10	Agricultural Bank of China Ltd.	农业银行	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	765,000	2,076,688.13	3.10

注：（1）根据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

报告期末，本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

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

报告期末，本基金未持有基金。

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，没有超出基金合同约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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	1,403,045.57
4	应收利息	380.34
5	应收申购款	4,268.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	30,247.10
8	其他	–
9	合计	1,437,941.83

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(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

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

②报告期末非指投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金非指投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

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。

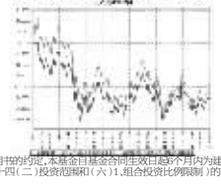
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效日至2010年12月31日	-9.96%	0.98%	0.71%	1.39%	-10.67%	-0.41%
2011年	-23.03%	1.86%	-25.41%	1.95%	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年上半年	-1.54%	0.97%	-3.53%	1.05%	1.99%	-0.08%

2.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2014年6月30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3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）1.组合投资比例限制）的有关约定。

十、基金管理人

（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	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	安波
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
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]第号文批准，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。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

（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基本情况

安金先生，董事长，大学本科。中共党员，曾任吉林农业机械研究所主任；吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理；吉林省证券公司总经理；东北证券有限责任公司监事长；吉林天信投资公司总经理；中诚信托有限责任公司副总经理。2011年8月5日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，中国国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士，管理新干大津通信广德公司、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月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长、外企服务总公司宏图实业公司副总经理，1996年6月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司董事。

Bernd Amlung先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士，自1989年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

Mark 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。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官，MD。

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。

王梅先生，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，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟投资管理有限公司董事。

张维炯先生，独立董事，中共党员，教授，加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

涂欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。曾任大学教法研究中心副主任，清华大学法学院副教授，担任中国证券法学研究会常务理事，中国商法学研究会理事，北京市经济法学会常务理事，中国法学会检察学研究会金融检察专业委员会委员。曾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，现任上海证券交易所第三届上市委员会委员。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官，北京代表处首席代表，董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司审计业务部总经理。

杨明先生，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，北京搜狐有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限责任公司财务总监。

王利刚先生，监事，经济学学士，2001年2月至今，就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部、历任人力资源部副总监、总监。

曾宪宏先生，监事，法学硕士，1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国药控股集团（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。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中少警卫局。1996年11月至1999年7月于中国证券监督管理委员会证券管理部工作。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员，硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴宗南女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

王连女士，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。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券有限责任公司投行业务部经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2.基金经理

（1）现任基金经理

杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有16年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师，中银平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部副总经理、2003年3月至2004年7月任万家（原天同）180指数证券投资基金基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司指数投资部总监。2012年3月22日至2014年5月9日任嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接基金经理，2013年2月5日至2014年6月20日任嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接基金经理，2005年8月29日至今任嘉实沪深300ETF联接基金（LOF）（原嘉实沪深300指数LOF）基金经理，2012年5月7日至今任嘉实沪深300ETF基金经理，2013年3月22日至今任嘉实中证500ETF联接基金经理，2013年7月6日至今任嘉实中证500ETF基金经理，2014年3月11日至今任嘉实基本面50指数LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）及本基金基金经理。杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。

（2）历任基金经理：张宏民先生自2010年9月30日至2013年1月25日任本基金基金经理。杨国纬先生自2013年1月25日至2014年3月11日任本基金基金经理。

3.海外投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，海外投资决策委员会的成员包括：海外业务首席投资官Andrew Tan，嘉实国际行政总裁Peng Wah Choy，固定收益投资总监Thomas Kwan，高级基金经理Yi Qian Jiang，Alan Zhong，基金经理June Chua，风险管理经理 Patrick Chan。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、基金托管人

（一）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：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：或任何区间不零攻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：01065759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一，中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行在资信状况、中国建设银行在股票代码：939于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国第八家被银行中资家在海外公开上市的银行。2006年09月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司普身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股。

截至2013年12月31日，中国建设银行资产总额153,632.10亿元，较上年增长695%；客户贷款和垫款总额85,900.57亿元，增长1435%；客户存款总额122,230.37亿元，增长776%。营业收入5,086.08亿元，较上年增长1039%，其中，利息净收入增长1029%，净利息收益率(NIM)为274%；手续费及佣金净收入1,042.83亿元，增长115.2%，占营业收入比为2.05%。成本费用扩支到到有效控制，成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元，增长1.2%，其中，税前利润增长11.28%；净利润2,151.22亿元，增长1.12%。资产质量保持稳定，不良贷款率0.99%，拨备覆盖率268.22%；资本充足率与核心一级资本充足率分别为1334%和1075%，保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个，服务于30654万公司客户、291亿个人客户，与中国经济战略性行业的大型企业集团保持紧密的合作关系；在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年，本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外102项奖项，多项综合排名进一步提高，在美国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5，较上年上升2位；在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中，位列第2，较上年上升13位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行设有投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220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实践工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户管理、客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

刘桓平，投资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，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。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，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。

（三）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、QFII、企业年金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2013年12月31日，中国建设银行三大托管3种证券投资基金、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。中国建设银行自2009年至2012年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

十二、境外资产托管人

（一）境外托管人的基本情况

美国道富集团（State Street Corporation）是遵照马萨诸塞联邦法律成立并于纽约股票交易所挂牌的金融控股公司。美国道富集团主要通过其全资子公司美国道富银行（State Street Bank and Trust Company）开展业务。道富银行在1924年成为美国第一只共同基金托管银行，从此开始履行合法托管人的职责，并一直在金融服务领域处于领先地位。特别是在过去的三十年多里，其从一家美国地区性的商业银行逐步演变成为在全球范围内为机构投资者提供金融资产服务的专业机构。截止2013年底，道富银行的托管及行政管理资产总额逾274万亿美元。

	全球托管及行政管理资产总额(美元十亿)	占总托管及行政管理资产的%
共同基金	6,811	24.83%
集体投资基金	6,428	23.44%
养老金产品	5,851	21.33%
保险和其他投资产品	8,337	30.40%
总 计	27,427	3

全球托管是道富银行最主要的业务，道富致力于为机构投资者服务。道富银行仅为机构投资者提供托管服务，这一使命是其在业内保持领先者地位的重要原因。道富银行在全球29个国家设有分事处，托管网络覆盖全世界超过100个市场，拥有庞大的专业投资服务团队。道富银行在国为共同基金客户提供广泛而综合的托管和会计服务，包括基金会计、每日定价和基金行政管理。道富银行服务于公司和公众养老金负税资产，并为每日估值投资组合提供信托和估值服务。

道富银行同时是美国以外国家和地区的领先金融服务商。在德国、意大利、法国和爱尔兰，道富银行向零售和机构基金客户提供depotbank服务，向养老金和其他机构客户提供托管和其他服务；在英国，道富银行向养老金提供托管服务并为共同基金提供基金行政管理服务；截止2013年12月31日，道富银行在爱尔兰，卢森堡，开曼群岛和加拿大为约12,600亿美元的离岸资产提供服务；在亚太地区，道富银行为11,500多亿美元资产提供行政服务；在日本非本土信托银行当中，道富银行服务超过97%的信托资产。

（二）境外资产托管人职责

1.安全保管基金的境外资产，及时办理清算、交割事宜；

2.根据境外资产托管人的指令及时通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入；

3.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）基金份额发售机构

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)65215588	传真	(010)65185577
联系人	赵佳		
（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8号上海国金中心二期23楼01-03单元		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	鲍东		
（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司			
办公地址	成都市人民南路一段86号城市之心30H嘉实基金		
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	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场T1-1202		
电话	(0755)25870686	传真	(0755)25870663
联系人	周炜		
（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司			
办公地址	青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室		
电话	(0532)66777766	传真	(0532)66777676
联系人	陈建林		
（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司			
办公地址	杭州市西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室		
电话	(0571)87759328	传真	(0571)87759331
联系人	章文蕾		
（7）嘉实基金管理有限公司福州分公司			
办公地址	福州市鼓楼区五四路158号环球广场25层04单元		
电话	(0591)88013673	传真	(0591)88013670
联系人	吴志锋		
（8）嘉实基金管理有限公司南京分公司			
办公地址	南京市白下区中山东路288号新世纪广场A座4202室		
电话	(025)66671118	传真	(025)66671100
联系人	徐莉莉		
（9）嘉实基金管理有限公司广州分公司			
办公地址	广州市天河区天河北路183号大都会广场2415-2416室		
电话	(020)87555163	传真	(020)81552120
联系人	汪文胜		

2.场外代销机构

（1）中国银行股份有限公司			
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号楼长安兴融中心		
法定代表人	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533
（2）中国农业银行股份有限公司			
住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街69号		
法定代表人	蒋超良	联系人	滕涛
电话	(010)85108227	传真	(010)85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599
（3）中国银行股份有限公司			
办公地址	北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街1号		
法定代表人	田国立		
电话	(010)66596688	传真	(010)66