深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第1号）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

深证基本面120交易型开放式指数证券投资（以下简称"本基金或基金）根据2011年6月9日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实深证基本面120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[2011]906号）核准进行募集。本基金基金合同于2011年8月1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，也不向投资者保证最低收益。

本摘要所载内容截止日为2015年2月1日，有关财务数据和净值表现(未经审计)截止日为2014年12月31日（特别事项注明截止日除外）。

一、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	安奎
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]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

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月2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，中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、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、商鼎期货经纪有限公司、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。

苗菁先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中煤信托有限责任公司国际业务部项目经理、投资管理部业务经理；2004年3月至今历任中诚信托有限责任公司投资管理部业务经理、副经理、经理、投资总监兼投资管理部经理；现任中诚信托有限责任公司投资总监、公司党委委员。

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，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

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。

汤欣先生，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，汤姆森路透集团"中国商法"丛书编辑咨询委员会成员。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首任主任。

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综合管理部总经理。

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责任公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，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。

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月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3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。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿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曾任公司总经理助理，现任公司副总经理。

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。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，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、中国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部门经理，2003年3月15日至2004年7月7日任万家（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，2012年3月22日至2014年5月9日任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理，2013年2月5日至2014年6月20日任嘉实中证中期企业债指数（LOF）基金经理，2013年5月10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（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2月6日至今任嘉实中证500ETF基金经理，2013年3月22日至今任嘉实中证500ETF联接基金经理， 2014年3月11日至今任嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实基本面50、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）和本基金基金经理。

（2）历任基金经理：

2011年8月1日至2014年3月11日，杨阳先生任本基金基金经理。

3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生，公司总经理赵学军先生，公司研究总监陈勤先生，资深基金经理邹唯先生、张弢先生，定量投资部负责人张自力先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60％以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2014年12月31日，中国银行已托管307只证券投资基金，其中境内基金282只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1.申购赎回代办券商

(1) 中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010)60833722	传真	(010)60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

(2) 广发证券股份有限公司

住所	广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)		
办公地址	广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼		
法定代表人	孙树明	联系人	黄岚
电话	(020)87555888	传真	(020)87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575或致电各地营业网点

(3) 中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
办公地址	北京市朝阳门内大街188号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010)65183880	传真	(010)65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

(4) 海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路98号		
办公地址	上海市广东路689号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021)23219000	传真	(021)23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553或拨打各城市营业网点咨询电话

(5) 申银万国证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市常熟路171号		
法定代表人	储晓明	联系人	李清怡
电话	(021)54033888	传真	(021)54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(021)962505

(6) 中国银河证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座		
法定代表人	陈有安	联系人	田薇
电话	(010)66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

(7) 兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路268号		
办公地址	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层		
法定代表人	兰荣	联系人	雷宇钦
电话	(0591)38507679	传真	(021)38565955
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

(8) 招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

(9) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021)22169999	传真	(021)22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

(10) 渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022)28451861	传真	(022)28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(11) 湘财证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
法定代表人	林俊波	联系人	钟康莺
电话	(021)68634518	传真	(021)68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

(12) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层		
法定代表人	沈强	联系人	王霈霈
电话	(0571)87112507	传真	(0571)85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571)95548

(13) 齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路86号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531)68889155	传真	(0531)68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

(14) 华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

(15)国信证券股份有限公司

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

（二）注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	丁志勇
电话	(010)59378982	传真	(010)58598907

（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、办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021)31358666	传真	(021)31358600
经办律师	吕红、黎明		

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼		
办公地址	上海黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	洪磊
电话	(021)23238888	传真	(021)23238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

四、基金的名称

本基金名称：深证基本面120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

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购等固定收益类资产、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）。

如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，可以将其纳入投资范围。

本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于标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%。

八、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。但在因特殊情况（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。

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的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。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、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，每日进行基金投资管理的日常决策。

（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）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，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：基金经理将跟踪标的指数变动，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量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：深证基本面120指数。

深证基本面120指数在深圳证券交易所上市公司中，以 4 个基本面指标来衡量上市公司的经济规模，并选取其中最大的120 家公司作为样本，且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数不仅具有良好的基本面、市场代表性和流动性，且打破了样本股价格与其权重之间的联系，使得基本面经济规模大的股票可以获得较高的权重，并在一定程度上减少了高估股票在组合中权重过高的现象，因此可以为投资者提供另一个投资深圳市场的业绩比较基准和投资分析工具，适合作为本基金的标的指数。

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代替，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托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月20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12月31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

名称	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	236,199,372.09	99.23
	其中：股票	236,199,372.09	99.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	1,544,878.49	0.65
7	其他资产	290,949.61	0.12
	合计	238,035,200.19	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,887,135.10	4.17
C	制造业	133,250,259.24	56.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,020,479.14	3.38
E	建筑业	2,112,787.10	0.89
F	批发和零售业	8,499,858.60	3.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,191,504.58	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,304,728.00	0.55
J	金融业	32,861,569.66	13.84
K	房地产业	34,773,750.67	14.65
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,297,690.00	1.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	236,199,762.09	99.51

（2）报告期末积极投资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。

3.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投资明细

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	1,428,449	19,855,441.10	8.37
2	000651	格力电器	250,097	9,283,600.64	3.91
3	000001	平安银行	543,424	8,607,836.16	3.63
4	000776	广发证券	318,231	8,258,094.45	3.48
5	000157	中联重科	994,800	7,023,288.00	2.96
6	000333	美的集团	249,932	6,858,134.08	2.89
7	000709	河北钢铁	1,683,584	6,448,126.72	2.72
8	000825	太钢不锈	1,070,159	5,639,737.93	2.38
9	000402	金 融 街	437,438	5,393,610.54	2.27
10	000783	长江证券	312,500	5,256,250.00	2.21

（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投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.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。

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。

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五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11.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(元)
1	存出保证金	1,479.42
2	应收证券清算款	289,176.24
3	应收股利	-
4	应收利息	293.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	290,949.61

（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报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

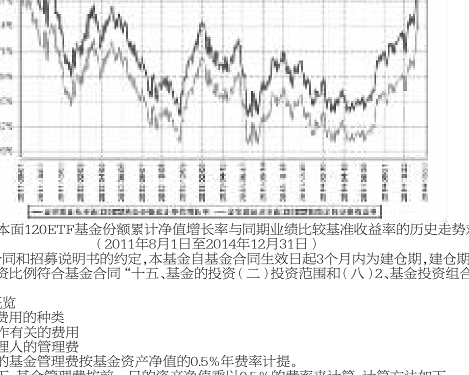
十二、基金的业绩

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
基金合同生效日(2011年8月1日)-2011年12月31日	-19.24%	1.18%	-26.10%	1.45%	6.86%	-0.27%
2012年	0.97%	1.37%	0.83%	1.39%	0.14%	-0.02%
2013年	-5.49%	1.43%	-6.42%	1.44%	0.93%	-0.01%
2014年	53.32%	1.26%	52.22%	1.27%	1.10%	-0.01%

2.自基金合同生效以来基金份额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：嘉实深证基本面120ETF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

（2011年8月1日至2014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"十五、基金的投资（二）投资范围和（八）2、基金投资组合比例限制"的有关约定。

十三、费用概览

（一） 基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的资产净值乘以0.5％的费率来计算，计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

在本基金基金合同生效之后的前四个年度，指数许可使用基点费分别按前一日的基金资产净值的万分之四（第一年度）、万分之六（第二年度）、万分之八（第三年度）、万分之十（第四年度）的年费率计提。从本基金基金合同生效后的第五个年度起，如果本基金资产净值超过或等于40亿元，指数许可基点费继续按照万分之十的年费率计提；如果不足40亿元，则指数许可基点费按照万分之十二的年费率计提。指数许可使用基点费按照前述标准每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

H=E×指数许可使用基点费/当年天数

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

指数许可使用费收取下限为每季度人民币拾伍万元（15万元），即不足拾伍万元时按照拾伍万元收取。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

（4）与基金运作有关的其他费用

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金合同生效以后的会计师费和律师费、基金的资金汇划费用等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（二）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失等不列入基金费用。

（三）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在"重要提示"部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2.在"三、基金管理人"部分：更新了基金管理人的相关信息。
3.在"四、基金托管人"部分：更新了基金托管人的相关信息。
4.在"九、基金份额的申购、赎回"部分：更新T日申购赎回清单的格式举例。
5.在"十一、基金的投资"部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
6.在"十二、基金的业绩"：基金业绩表现更新至2014年12月31日。

嘉实基金管理有限公司
2015年3月14日

嘉实基金管理有限公司关于旗下基金持有的"鹏博士"股票估值调整的公告

根据中国证券监督管理委员会公告[2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，以及2015 年2月11日《鹏博士电信传媒集团股份有限公司重大事项停牌公告》，"鹏博士"股票自2015年2月12日开市起停牌。嘉实基金管理有限公司与基金托管人协商一致，自2015年3月13日起，对嘉实基金管理有限公司旗下证券投资基金持有的"鹏博士"股票(代码：600804)采用"指数收益法"予以估值。

投资者可登录基金管理人网站(www.jsfund.cn)或拨打客户服务电话400-600-8800了解、咨询有关信息。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2015年3月14日

嘉实基金管理有限公司关于旗下基金持有的"东方通"股票估值调整的公告

根据中国证券监督管理委员会公告[2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，以及2015 年1月6日《北京东方通科技股份有限公司重大事项停牌公告》，"东方通"股票自2015年1月7日开市起停牌。嘉实基金管理有限公司与基金托管人协商一致，自2015年3月13日起，对嘉实基金管理有限公司旗下证券投资基金持有的"东方通"股票(代码：300379)采用"指数收益法"予以估值。

投资者可登录基金管理人网站(www.jsfund.cn)或拨打客户服务电话400-600-8800了解、咨询有关信息。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2015年3月14日

证券代码：002423　　证券简称：中原特钢　　公告编号：2015-009

中原特钢股份有限公司第三届董事会第二十一次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

中原特钢股份有限公司（以下简称"公司"）第三届董事会第二十一次会议于2015年3月13日以通讯方式召开。本次董事会的会议通知和议案已于2015年3月8日按《公司章程》规定以电子邮件的方式发给了全体董事。

本次会议应出席董事9人，亲自出席本次会议的董事共计9人。

本次会议由董事长李宗樵先生主持，会议的召开符合《公司章程》规定的程序，并达到了《公司法》及《公司章程》规定的召开董事会会议的法定表决权数。

二、董事会会议审议情况

本次董事会会议以通讯投票表决的方式通过以下决议：

1、《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》；

同意9票；反对0票；弃权0票。本议案以9票同意获得通过。

根据《企业会计准则》的相关规定及公司目前固定资产的实际使用情况，并参考其他相近可比公司折旧情况，公司对固定资产进行了认真复核，决定对部分固定资产折旧年限进行调整。公司独立董事对该事项发表了同意的独立意见。具体内容详见2015年3月14日刊登于巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《关于调整部分固定资产折旧年限的的公告》、《独立董事关于公司调整部分固定资产折旧年限事项的独立意见》。

2、《关于召开2015年第一次临时股东大会的议案》。

同意9票；反对0票；弃权0票。本议案以9票同意获得通过。

具体内容详见2015年3月14日刊登于巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《关于召开2015年第一次临时股东大会的通知》。

三、备查文件

1、经与会董事签字并加盖董事会印章的董事会决议。

2、独立董事的独立意见。

特此公告。

中原特钢股份有限公司董事会
2015年3月14日

证券代码：002423　　证券简称：中原特钢　　公告编号：2015-011

中原特钢股份有限公司第三届监事会第十六次会议决议公告

本公司及监事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、监事会会议召开情况

中原特钢股份有限公司（以下简称"公司"）第三届监事会第十六次会议于2015年3月13日以通讯方式召开。本次会议的通知及会议资料已于2015年3月8日以电子邮件方式发送各位监事。

本次会议应出席监事5人，实际出席监事5人。

本次会议由监事会主席张守启先生主持。本次会议的召开符合《公司法》、《公司章程》的有关规定。

二、监事会会议审议情况

本次监事会会议以通讯投票表决方式通过以下议案：

《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》。

同意5票；反对0票；弃权0票。本议案以5票同意获得通过。

经审核，监事会认为：公司本次调整部分固定资产折旧年限，是根据公司目前固定资产的实际使用情况，并对照其他相近可比公司的固定资产折旧情况后作出的，调整后能够更加客观地反映公司固定资产的实际情况，不存在损害股东利益的情形。监事会同意公司本次调整部分固定资产折旧年限的事项。

具体内容详见2015年3月14日刊登于巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《关于调整部分固定资产折旧年限的公告》。

三、备查文件

经与会监事签字并加盖监事会印章的监事会决议。

特此公告。

中原特钢股份有限公司监事会
2015年3月14日

证券代码：002423　　证券简称：中原特钢　　公告编号：2015-010

中原特钢股份有限公司关于调整部分固定资产折旧年限的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

中原特钢股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年3月13日召开了第三届董事会第二十一次会议，会议审议通过了《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》。根据《企业会计准则》的相关规定以及公司目前固定资产的实际使用情况，为更加客观真实地反映公司的财务状况和经营成果，公司拟对部分固定资产的折旧年限进行调整。现将相关情况公告如下：

一、本次调整部分固定资产折旧年限的情况概述

根据《企业会计准则》的相关规定及公司目前固定资产的实际使用情况，并参照其他相近可比公司折旧情况，公司对固定资产使用状况进行了认真复核，决定对部分固定资产折旧年限进行调整。具体调整如下：

1、固定资产折旧年限调整前后比较表

资产类别	调整前折旧年限	调整后折旧年限
房屋及建筑物	5~30年	5~40年
机器设备	10~20年	10~25年
其中：径向精锻机	按生产量计提	按生产量计提
电子设备	5~10年	5~15年
运输设备	5~10年	5~10年

2、折旧年限调整后，固定资产的净残值率不变，净残值率为3%。

3、本次调整的固定资产折旧年限从2015年1月1日起开始执行。

二、关于调整部分固定资产折旧年限合理性的说明

公司近年来不断加强对固定资产的维护维修，定期对生产线进行全面点检和定修，对房屋建筑物等进行定期修缮，有效延长了相关资产的使用寿命，部分固定资产已提足折旧仍在继续使用，资产的实际使用年限长于调整前的固定资产折旧年限。同时，近年来公司新建项目较多，目前所拥有的房屋建筑物、机器设备和电子设备较之过去发生了较大变化，房屋建筑物大多为钢架结构和钢筋混凝土框架结构，机器设备和电子设备大多达到先进水平。由此，公司之前的房屋建筑物、机器设备和电子设备的折旧年限，一定程度上已不能真实反映相关资产的实际使用状况。

根据公司固定资产的实际使用情况，同时参照其他相近可比公司的固定资产折旧情况，为真实反映固定资产为企业提供经济利益的期间及每期实际的资产消耗，使公司的财务信息更客观真实地反映公司的财务状况和经营成果，经过对固定资产使用寿命进行复核，公司决定对部分固定资产折旧年限进行调整。

三、本次调整部分固定资产折旧年限对公司的影响

根据《企业会计准则第28号——会计政策、会计估计变更和差错更正》的相关规定，本次调整部分固定资产折旧年限属于会计估计变更，应当采用未来适用法进行会计处理，不进行追溯调整，不会对公司以前各年度的财务状况和经营成果产生影响。

本次调整部分固定资产折旧年限对公司的业务范围无影响，对公司2014年度的财务状况和经营业绩无影响。经初步测算，本次调整部分固定资产折旧年限预计将减少计提2015年度折旧额2,910万元左右，假设上述折旧额全部结转当期损益，且不考虑公司在2015年度增减变动的固定资产，在扣除企业所得税的影响后，预计将增加公司2015年度净利润2,183万元左右，增加公司2015年末所有者权益2,183万元左右。

根据《中小企业板信息披露业务备忘录第13号：会计政策及会计估计变更》规定，本次会计估计变更的影响超过公司2013年度经审计净利润的50%，需提交公司股东大会审议。

四、独立董事意见

公司本次调整部分固定资产折旧年限（会计估计变更）符合国家相关法规及规则的要求，符合公司固定资产的实际使用情况，不存在损害股东利益的情形。调整后能够更为客观地反映公司固定资产的实际情况，有利于公司的稳健经营。公司董事会对本次会计估计变更事项的审议和表决符合相关法律、法规和《公司章程》的规定。因此，同意公司本次调整部分固定资产折旧年限的事项，并提交公司股东大会审议。

五、监事会意见

公司第三届监事会第十六次会议审议通过了《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》。经审核，公司监事会就本次调整部分固定资产折旧年限事项发表如下意见：公司本次调整部分固定资产折旧年限，是根据公司目前固定资产的实际使用情况，并对照其他相近可比公司的固定资产折旧情况后作出的，调整后能够更加客观地反映公司固定资产的实际情况，不存在损害股东利益的情形。监事会同意公司本次调整部分固定资产折旧年限的事项。

六、备查文件

1、第三届董事会第二十一次会议决议；

2、第三届监事会第十六次会议决议；

3、独立董事的独立意见；

4、大信会计师事务所（特殊普通合伙）出具的《关于中原特钢股份有限公司会计估计变更专项说明的审核报告》。

特此公告。

中原特钢股份有限公司董事会
2015年3月14日

证券代码：002423　　证券简称：中原特钢　　公告编号：2015-012

中原特钢股份有限公司关于召开2015年第一次临时股东大会的通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、召开会议的基本情况

（一）股东大会届次：2015年第一次临时股东大会。

（二）股东大会的召集人：公司董事会。2015年3月13日，公司第三届董事会第二十一次会议审议通过了《关于召开公司2015年第一次临时股东大会的议案》。

（三）会议召开的合法、合规性

召开本次股东大会会议的通知符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的相关规定。

（四）会议召开日期和时间：

1、现场会议召开时间：2015年3月31日（星期二）下午14：00。

2、网络投票时间：2015年3月30日—2015年3月31日

其中，通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为：2015年3月31日上午9：30至11：30，下午13：00 至15：00；通过深圳证券交易所互联网投票的具体时间为：2015年3月30日下午15：00至2015年3月31日下午15：00期间的任意时间。

（五）会议的召开方式：

现场投票表决与网络投票表决相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn)向公司全体股东提供网络形式的投票平台，股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

（六）投票规则

公司股东应严肃行使表决权，投票表决时，同一股份只能选择现场投票、深圳证券交易所交易系统投票、深圳证券交易所互联网系统投票中的一种，不能重复投票。具体规则为：

如果同一股份通过现场、交易系统和互联网重复投票，以第一次投票为准；

如果同一股份通过交易系统和互联网重复投票，以第一次投票为准；

如果同一股份通过交易系统或互联网多次重复投票，以第一次投票为准。

（七）出席对象：

1、在股权登记日持有公司股份的股东。本次股东大会的股权登记日为2015年3月24日（星期二），于股权登记日下午收市时在中国结算深圳分公司登记在册的公司全体股东均有权出席股东大会，并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是本公司股东。

2、公司董事、监事和高级管理人员。

3、公司聘请的见证律师。

（八）现场会议召开地点：河南省济源市承留镇中原特钢股份有限公司第二会议室

二、会议审议事项

（一）提案名称

《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》

该议案内容详见2015年3月14日刊登于巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《第三届董事会第二十一次会议决议公告》及《关于调整部分固定资产折旧年限的公告》。

根据《公司章程》的规定，上述议案公司将对中小投资者的表决单独计票，并披露投票结果。

（二）特别强调事项

公司股东既可参与现场投票，也可通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统参加网络投票。

三、现场股东大会会议登记方法

（一）登记方式：

1、法人股东由法定代表人出席会议的，须持加盖公司公章的营业执照复印件、法定代表人证明书和本人身份证办理登记手续；委托代理人出席的，还须持本人身份证和法人代表授权委托书办理登记手续。

2、自然人股东须持股东帐户卡、本人身份证进行登记；委托代理人出席的，还须持本人身份证、授权委托书、委托人身份证、委托人股东帐户卡办理登记手续。

（二）登记时间：2015年3月27日【上午9：00-11：30、下午14：30-17：00】。

（三）登记地点：河南省济源市承留镇中原特钢股份有限公司董事会办公室。

（四）委托他人出席股东大会的有关要求：

1、自然人股东委托他人出席会议的，代理人应出示本人有效身份证件、股东授权委托书。

2、法定代表人委托代理人出席会议的，代理人应出示本人身份证、法人股东单位的法定代表人依法出具的书面授权委托书。

3、委托人为法人的，由其法定代表人或者其董事会、其他决策机构决议授权的人作为代表出席公司的股东大会。

4、委托人以其所代表的有表决权的股份数额行使表决权，每一股份享有一票表决权。

授权委托书应当注明在委托人不作具体指示的情况下，委托人或代理人是否可以按自己的意思表决。

（五）其他事项

异地股东可采用信函或传真的方式登记(登记时间以收到传真或信函时间为准)。传真登记请发送传真后电话确认。

四、参加网络投票的股东的身份认证与投票程序

（一）通过深交所交易系统投票的程序

1、本次临时股东大会通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2015年3月31日上午9：30至11：30，下午13：00至15：00，投票程序比照深圳证券交易所新股申购业务操作。

2、投票代码：362423；投票简称：中原投票。

3、在投票当日，"中原投票""昨日收盘价"显示的数字为本次股东大会审议的议案总数。

4、股东投票的具体程序为：

（1）进行投票时买卖方向应选择"买入"；

（2）在"委托价格"项下填报本次股东大会的议案序号。本次会议只有一项议案，1.00元即代表该议案。

以相应的价格申报，具体如下表所示：

	议案名称	对应申报价格
议案1	《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》	1.00

（3）在"委托数量"项下填报表决意见。

1股代表同意，2股代表反对，3股代表弃权。具体如下表所示：

表决意见类型	委托数量
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

（4）如股东对所有议案均表示相同意见，则可以只对"总议案"进行投票。

如股东通过网络投票系统对"总议案"和单项议案进行了重复投票的，以第一次有效投票为准。即如果股东先对相关议案投票表决，再对总议案投票表决，则以已投票表决的相关议案的表决意见为准，其它未表决的议案以总议案的表决意见为准；如果股东先对总议案投票表决，再对相关议案投票表决，则以总议案的表决意见为准。

（5）对同一议案的投票只能申报一次，不能撤单。

（6）不符合上述规定的投票申报无效，深圳证券交易所交易系统作自动撤单处理，视为未参与投票。

（二）通过互联网投票系统的投票程序

1、互联网投票系统开始投票的时间为2015年3月30日下午15：00，结束时间为2014年3月31日下午15：00。

2.股东通过互联网投票系统进行网络投票，需按照《深交所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定办理身份认证，取得"深交所数字证书"或"深交所投资者服务密码"。

股东获取身份认证的具体流程：按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定，股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。申请服务密码的，请登陆网址：http://www.szse.cn 或http://wltp.cninfo.com.cn 的密码服务专区注册，填写相关信息并设置服务密码，如服务密码激活指令上午11：30前发出，当日下午13：00即可使用；如服务密码激活指令上午11：30后发出，次日方可使用。申请数字证书的，可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。

3.股东根据获取的服务密码或数字证书，可登录http://wltp.cninfo.com.cn在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

（三）投票注意事项

1、网络投票不能撤单；

2、对同一表决议案的投票只能申报一次，多次申报的以第一次有效申报为准。

3、同一表决权既通过交易系统又通过互联网投票系统投票，以第一次有效投票结果为准。

4、如需查询投票结果，请于投票当日下午18：00以后登录深圳证券交易所互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn），点击"投票查询"功能，可以查看个人网络投票结果，或通过投票委托的证券公司营业部查询。

五、其他事项

（一）会议联系方式：

联系人：王小宇

联系电话：0391-6099031

传　　真：0391-6099019

通讯地址：河南省济源市承留镇中原特钢股份有限公司董事会办公室

邮　　编：459008

（二）与会股东或代理人的交通、食宿等费用自理。

（三）网络投票系统异常情况的处理方式：网络投票期间，如网络投票系统遇到突发重大事件影响，则本次股东大会的进程按当日通知进行。

六、备查文件

公司第三届董事会第二十一次会议决议。

特此公告。

附件：授权委托书

中原特钢股份有限公司董事会
2015年3月14日

附件：

授 权 委 托 书

致：中原特钢股份有限公司

兹授权委托＿＿＿＿＿＿先生/女士代表本公司/本人出席2015年3月31日召开的中原特钢股份有限公司2015年第一次临时股东大会，并代表本公司/本人依照以下指示对下列议案投票。本公司/本人对本次会议表决事项未作具体指示的，受托人可代为行使表决权，其行使表决权的后果均由我单位（本人）承担。

会议议案表决情况

审 议 事 项	同意	反对	弃权
《关于调整部分固定资产折旧年限的议案》			

注：请在表决栏的"同意"、"反对"或"弃权"栏内划"√"，填写其它标记、漏填或重复填写的无效。

委托人/单位签字（盖章）：　　受托人签字：

委托人身份证明号码/营业执照号码：　　受托人身份证号码：

委托人股东账号：　　委托日期：　年　月　日

委托人持股数量：　　股

有效期限：自签署日至本次股东大会结束

（注：委托授权书以剪报、复印或按以上格式自制均有效）