嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2017年第2号）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经2013年7月12日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]917号）核准公开发售，本基金基金合同于2014年6月13日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

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。基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。

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。

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2017年12月13日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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53层09-11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	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。

（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

牛成立先生，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；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；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，代任公司总经理，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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

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。

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衍生品副总裁，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。

Jonathan Paul Eilbeck先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问，JP Morgan固定收益亚太区CFO、COO，JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

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。

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。

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商学院院长兼MBA教育中心主任。

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副董事长、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。

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。

宋振如女士，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月任博时基金管理有限公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

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

何如女士，硕士研究生，11年证券从业经历。曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(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，任产品管理部高级产品经理职位，负责指数产品及ETF创新产品的设计与开发、指数研究及产品管理工作；2012年9月加入指数投资部，先后担任基金经理助理、基金经理职位。2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理。2014年6月13日至今任嘉实中证医药卫生ETF基金经理，2014年6月20日至今任嘉实中证金融地产ETF基金经理，2015年8月6日至今任嘉实中证金融地产ETF联接基金经理，2016年1月5日至今任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实黄金（QDII-FOF-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120ETF及其联接基金基金经理，2017年6月29日至今任嘉实富时中国A50ETF联接基金经理，2017年7月3日至今任嘉实富时中国A50ETF 基金经理。2017年7月14日至今任嘉实创业板ETF 基金经理。2014年6月13日至今任本基金基金经理。

刘加吟女士，硕士研究生，8年证券从业经历。2009 年加入嘉实基金管理有限公司，任指数投资部指数研究员一职。2016年3月24日至今担任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实中证医药卫生ETF基金经理。2017年月7日至今任嘉实中关村A股ETF基金经理，2017年6月7日至今任嘉实中关村A股ETF基金经理。2016年3月24日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

无。

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：公司副总经理兼股票投资业务联席CIO邵健先生，公司代总经理赵学军先生，股票投资业务联席CIO兼研究总监陈少平女士，助理CIO兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理胡涛先生。

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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（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2017年09月30日，中国银行已托管637只证券投资基金，其中境内基金600只，QDII基金37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）国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路618号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号		
法定代表人	杨德红	联系人	芮敏祺
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

（2）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

（3）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	周杨
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

（4）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

（5）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

（6）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	张佑君	联系人	郑慧
电话	010-60834817		
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

（7）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	陈共炎	联系人	辛国政
电话	010-83574507	传真	010-83574807
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

（8）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	周杰	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

（9）申万宏源证券有限公司

住所、办公地址	上海市徐汇区长乐路989号45层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路989号45层		
法定代表人	李梅	联系人	钱达琛
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	www.swhysc.com	客服电话	021-962505

（10）华泰证券股份有限公司

办公地址	江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场		
注册地址	江苏省南京市江东中路228号		
法定代表人	周易	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	0755-82492962(深圳)
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

（11）中信证券（山东）有限责任公司

住所、办公地址	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼		
法定代表人	杨宝林	联系人	吴忠超
电话	（0532）85022326	传真	（0532）85022605
网址	www.citicssd.com	客服电话	95548

（12）中国中投证券有限责任公司

住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元		
办公地址	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层		
法定代表人	高涛	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

（13）兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路268号		
办公地址	上海市浦东新区长柳路36号		
法定代表人	杨华辉	联系人	乔琳雪
电话	021-38565547		
网址	www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

（14）东方证券股份有限公司

办公地址	上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32 层、36 层、39层、40 层		
注册地址	上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	孔亚楠
电话	(021)63325888	传真	(021)63326729
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

（15）方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	高利	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

（16）长城证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华	联系人	金夏
电话	(021)62821733	传真	(0755)83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、（0755）33680000

（17）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	薛峰	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

（18）广州证券股份有限公司

住所、办公地址	广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼		
法定代表人	邱三发	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	（020）961303

（19）东北证券股份有限公司

办公地址	长春市生态大街6666号		
注册地址	长春市生态大街6666号		
法定代表人	李福春	联系人	安岩岩
电话	(0431)85096517	传真	(0431)85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	95360

（20）申万宏源西部证券有限公司

住所、办公地址	新疆乌鲁木齐市天山区文艺路233号宏源大厦8楼		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路258号大成国际大厦20楼2005室		
法定代表人	李季	联系人	唐岚
电话	010-88085258	传真	0991-2301802
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

（21）中泰证券股份有限公司

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	许曼华
电话	021-20315290		
网址	www.zts.com.cn	客服电话	95538

（22）第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
法定代表人	刘学民	联系人	毛诗莉
电话	(0755)23838750	传真	(0755)25838701
网址	www.firstcapital.com.cn	客服电话	95358

（23）中航证券有限公司

住所、办公地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	（0791）86768681	传真	（0791）86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

（24）华福证券有限责任公司

住所	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7至10层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	（0591）87383623	传真	（0591）87383610
网址	www.hfzq.com.cn	客服电话	（0591）96326

（25）长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦		
法定代表人	杨泽柱	联系人	李良
电话	（027）65799999	传真	（027）85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579或4008-888-999

（26）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	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022)28451991	传真	(022)28451892
网址	www.ewww.com.cn	客服电话	4006515988

（27）东吴证券股份有限公司

住所、办公地址	苏州工业园区星阳街5号		
法定代表人	范力	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512)65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	95330

（28）信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	尹旭航
电话	(010)63081493	传真	(010)63081344
网址	www.cindasc.com	客服电话	95321

（29）上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市四川中路213号久事商务大厦7楼		
法定代表人	李俊杰	联系人	邵珍珍
电话	(021)53686888	传真	(021)53686100-7008
网址	www.962518.com	客服电话	(021)962518、4008918918

（30）新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501		
法定代表人	叶顺德	联系人	田芳芳
电话	(010)83561146		
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	95399

（31）国联证券股份有限公司

办公地址	江苏省无锡市金融一街8号		
注册地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦		
法定代表人	姚志勇	联系人	祁昊
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	95570

（32）平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层		
办公地址	深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)		
法定代表人	刘世安	联系人	石静武
电话	021-38631117	传真	021-58991896
网址	stock.pingan.com	客服电话	95511—8

（33）国海证券股份有限公司

住所、办公地址	广西桂林市辅星路13号		
法定代表人	张雅锋	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0755-83700205
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	95563（全国）

（34）东莞证券股份有限公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
联系人	李荣		
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	95328

（35）中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	菅明军	联系人	程月艳、李盼盼
电话	0371--69099882	传真	0371--65585899
网址	www.ccnew.com	客服电话	95377

（36）国都证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	王少华	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

（37）东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531；400-888-8588

（38）华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	（0931）4890208	传真	（0931）4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	（0931）96668、4006898888

（39）华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
法定代表人	俞洋	联系人	杨莉娟
电话	021-54967552	传真	021-54967032
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	021-32109999；029-68918888；4001099918

（40）江海证券有限公司

办公地址	黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号		
注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊
电话	0451-85863726	传真	0451-82337279
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

（41）中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层		
法定代表人	何亚刚	联系人	齐冬妮
电话	(010)59355807	传真	(010)56437013
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

（42）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

（43）华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街8号		
办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人寿保险大厦十二层、十五层、十六层、十七层、十八层		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010-85556100	传真	010-85556088
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	400-898-4999

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在上海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)登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所、办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话：（021）5115 0298

传真：（021）5115 0398

负责人：廖海

联系人：廖海

经办律师：刘佳、张兰

(四)审计基金财产的会计师事务所

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号普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联 系 人：张勇

经办注册会计师：薛竞、张勇

四、基金的名称

本基金名称：嘉实中证主要消费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

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争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%。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票，衍生工具（权证、股指期货等），债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等），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）。

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。

八、基金的投资策略

(一) 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。

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。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资于股指期货后，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股指期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

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

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：中央交易部门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。

（二）投资组合管理

1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。

本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1）由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2）个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3）成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4）相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5）其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为(如：股本变化、分红、停牌、复牌等)信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决