嘉实黄金证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

（2018年第1号）

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司
基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

嘉实黄金证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会于2011年5月31 日《关于核准嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集的批复》）（证监许可［2011］839号）和2011年6月15日《关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集时间安排的确认函》（基金部函[2011]376号）核准公开发售。本基金的基金合同于2011年8 月4日正式生效。本基金类型为上市契约型开放式。

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2018年2月4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12月31日（未经审计）。

一、基金的名称

本基金名称：嘉实黄金证券投资基金（LOF）

二、基金的类型

本基金类型：上市契约型开放式

三、基金的投资目标

本基金主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于全球证券市场内依法可投资的公募基金（包括ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金的投资组合比例范围：在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的90%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金资产净值的5%。黄金基金指黄金ETF、黄金股票指数ETF以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF、以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

五、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金主要通过投资于海外市场跟踪黄金价格的交易所交易基金（ETF）以实现对黄金价格的有效跟踪，所投资的海外市场黄金ETF将以有实物黄金支持的金融工具为主。本基金不直接买卖或持有实物黄金。

本基金的具体投资策略包括ETF组合管理策略、现金管理策略以及衍生品投资策略三部分组成：

1、ETF 组合管理策略

（1）黄金ETF 的选择标准

本基金目前将选择有实物黄金支持（backed by physical gold）的黄金ETF 作为主要投资标的。实物黄金支持的黄金ETF基金管理人持有标准化实物黄金并且一级市场的申购赎回也是以实物黄金进行，从而此类黄金ETF可以有效跟踪黄金价格。

在具体遴选黄金ETF的过程中，本基金主要考虑的因素包括：资产规模（Asset under management），跟踪误差（tracking error）、估值基准（basis of valuation），计价货币（denominator）、流动性（liquidity）、透明度（transparence）、上市地（listing exchange）、ETF管理公司（Management Company）、组织架构（structure）等。具体说明如下：

1）规模：是指黄金ETF 本身所管理的资产规模大小，而有实物黄金支持的黄金ETF 可以从市值规模和黄金储存量两个角度来衡量，规模越大，越可以产生规模效应，降低黄金ETF 本身运营成本从而降低跟踪误差，并且增加投资安全性；

2）跟踪误差：是指黄金ETF的资产净值（NAV）与跟踪指数（一般为金价）的偏离度，跟踪误差越小，说明黄金ETF的运作越成功；

3）估值基准：是指黄金ETF 每日进行估值的基准，目前绝大部分黄金ETF 均以伦敦金的价格作为基准；

4）计价货币：是指黄金ETF每日估值和交易的基准货币，由于国际通用金价为美元计价，所以本基金将以美元计价的黄金ETF为主，以减小其它货币对美元的汇率风险；

5）流动性：是指黄金ETF 在二级市场交易量的大小以及买卖价差的大小。本基金在二级市场买入黄金ETF 基金份额时，标的ETF 流动性高，产生的冲击成本会越小，越有利于本基金跟踪误差的控制；

6）透明度：主要指黄金ETF 的信息披露程度，信息披露越完全、真实、迅速，越可以减少潜在的投资风险；

8）上市地：本基金投资于与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区的黄金ETF；

9）ETF管理公司：选择运作黄金ETF时间长、运作成熟、管理规模大的ETF管理公司，将有利于降低本基金的潜在对于万风险；

10）组织架构：主要指黄金ETF 各参与方的权责关系和合约结构，不同市场上黄金ETF 的组织架构有所不同，合理的组织架构可以保障黄金ETF 的顺利运作，减少潜在的参与方风险。

本基金将选择流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、透明度较高、券商较佳、估值基准与本基金的业绩基准间的差异小、组织架构合理的黄金ETF 作为主要投资对象，构建备选基金库。

（2）组合构建策略

本基金存备选基金库的基础上，在建仓期内综合考虑备选基金库中黄金ETF的历史运作记录、市场流动性、上市交易所、交易币种等因素，并以最优跟踪本基金基准、从而使本基金跟踪误差最小为目标来进行黄金ETF投资组合的构建。

（3）组合调整策略

在投资组合构建完成后，本基金基本上将采用买入持有的投资策略，但本基金会根据ETF投资组合和现金比例严格控制基金净值和基准的偏差，适时调整组合内不同ETF的比重以及现金比例，以实现对基准的有效跟踪。

同时，由于本基金为开放式基金，我们还会根据申购赎回需求，灵活调整组合，结合现金管理策略，满足日常的申赎需求。

2、现金管理策略

现金管理是本基金投资管理的重要组成部分，根据现有法律法规的规定本基金所持有的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%，而持有过多的现金资产势必因为现金拖累而本基金的跟踪效果产生影响，基金管理人将在满足现有法律法规和日常申购赎回所需流动性的前提下，合理制定持有现金资产的比例，有效地实现对业绩基准的跟踪。

同时，基金管理人也将在满足现有法律法规的规定和基金流动性的前提下，尽可能提高现金资产的收益率。

3、衍生品投资策略

为降低管存现金、汇率因素的影响，本基金还将本着谨慎原则，在风险可控的前提下，投资于以黄金ETF、黄金股票指数ETF以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF、以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

五、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金主要通过投资于海外市场跟踪黄金价格的交易所交易基金（ETF）以实现对黄金价格的有效跟踪，所投资的海外市场黄金ETF将以有实物黄金支持的金融工具为主。本基金不直接买卖或持有实物黄金。

本基金的具体投资策略包括ETF组合管理策略、现金管理策略以及衍生品投资策略三部分组成：

1、ETF 组合管理策略

（1）黄金ETF 的选择标准

本基金目前将选择有实物黄金支持（backed by physical gold）的黄金ETF 作为主要投资标的。实物黄金支持的黄金ETF基金管理人持有标准化实物黄金并且一级市场的申购赎回也是以实物黄金进行，从而此类黄金ETF可以有效跟踪黄金价格。

在具体遴选黄金ETF的过程中，本基金主要考虑的因素包括：资产规模（Asset under management），跟踪误差（tracking error）、估值基准（basis of valuation），计价货币（denominator）、流动性（liquidity）、透明度（transparence）、上市地（listing exchange）、ETF管理公司（Management Company）、组织架构（structure）等。具体说明如下：

1）规模：是指黄金ETF 本身所管理的资产规模大小，而有实物黄金支持的黄金ETF 可以从市值规模和黄金储存量两个角度来衡量，规模越大，越可以产生规模效应，降低黄金ETF 本身运营成本从而降低跟踪误差，并且增加投资安全性；

2）跟踪误差：是指黄金ETF的资产净值（NAV）与跟踪指数（一般为金价）的偏离度，跟踪误差越小，说明黄金ETF的运作越成功；

3）估值基准：是指黄金ETF 每日进行估值的基准，目前绝大部分黄金ETF 均以伦敦金的价格作为基准；

4）计价货币：是指黄金ETF每日估值和交易的基准货币，由于国际通用金价为美元计价，所以本基金将以美元计价的黄金ETF为主，以减小其它货币对美元的汇率风险；

5）流动性：是指黄金ETF 在二级市场交易量的大小以及买卖价差的大小。本基金在二级市场买入黄金ETF 基金份额时，标的ETF 流动性高，产生的冲击成本会越小，越有利于本基金跟踪误差的控制；

6）透明度：主要指黄金ETF 的信息披露程度，信息披露越完全、真实、迅速，越可以减少潜在的投资风险；

8）上市地：本基金投资于与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区的黄金ETF；

9）ETF管理公司：选择运作黄金ETF时间长、运作成熟、管理规模大的ETF管理公司，将有利于降低本基金的潜在对于万风险；

10）组织架构：主要指黄金ETF 各参与方的权责关系和合约结构，不同市场上黄金ETF 的组织架构有所不同，合理的组织架构可以保障黄金ETF 的顺利运作，减少潜在的参与方风险。

本基金将选择流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、透明度较高、券商较佳、估值基准与本基金的业绩基准间的差异小、组织架构合理的黄金ETF 作为主要投资对象，构建备选基金库。

（2）组合构建策略

本基金存备选基金库的基础上，在建仓期内综合考虑备选基金库中黄金ETF的历史运作记录、市场流动性、上市交易所、交易币种等因素，并以最优跟踪本基金基准、从而使本基金跟踪误差最小为目标来进行黄金ETF投资组合的构建。

（3）组合调整策略

在投资组合构建完成后，本基金基本上将采用买入持有的投资策略，但本基金会根据ETF投资组合和现金比例严格控制基金净值和基准的偏差，适时调整组合内不同ETF的比重以及现金比例，以实现对基准的有效跟踪。

同时，由于本基金为开放式基金，我们还会根据申购赎回需求，灵活调整组合，结合现金管理策略，满足日常的申赎需求。

2、现金管理策略

现金管理是本基金投资管理的重要组成部分，根据现有法律法规的规定本基金所持有的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%，而持有过多的现金资产势必因为现金拖累而本基金的跟踪效果产生影响，基金管理人将在满足现有法律法规和日常申购赎回所需流动性的前提下，合理制定持有现金资产的比例，有效地实现对业绩基准的跟踪。

同时，基金管理人也将在满足现有法律法规的规定和基金流动性的前提下，尽可能提高现金资产的收益率。

3、衍生品投资策略

为降低管存现金、汇率因素的影响，本基金还将本着谨慎原则，在风险可控的前提下，投资于以黄金ETF、黄金股票指数ETF以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF、以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

六、基金的投资组合比例

本基金投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于全球证券市场内依法可投资的公募基金（包括ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金的投资组合比例范围：在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的90%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金资产净值的5%。黄金基金指黄金ETF、黄金股票指数ETF以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF、以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

七、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：（经汇率调整后的）伦敦金价格，其中伦敦金价格使用伦敦金每日下午收盘价（London Gold Price PM Fix）；人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

七、基金的风险收益特征

本基金属于基金中基金，主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具。本基金的表现与黄金价格走势直接相关，历史上黄金价格波幅较大，波动周期较长，预期收益可能长期超过或低于股票、债券等传统金融资产。此外，本基金主要投资海外，存在汇率风险。

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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月17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2017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

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：普通股	–	–
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	163,954,491.42	94.03
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	9,736,779.43	5.58
8	其他资产	671,077.73	0.38
9	合计	174,362,348.58	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

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

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

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR GOLD SHARES	ETF 基金	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	31,269,541.64	18.05
2	GAM PHYS GOLD – USD A	ETF 基金	交易型开放式	GAM Investment Management Switzerland AG	27,576,426.05	15.92
3	UBS ETF GOLD	ETF 基金	交易型开放式	UBS Fund Management Switzerland AG	26,986,115.32	15.58
4	ZKB GOLD ETF AA USD	ETF 基金	交易型开放式	Swisscanto Fondslistung AG/Switzerland	25,240,284.01	14.57
5	ISHARES GOLD TRUST	ETF 基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	25,153,989.08	14.52
6	ETFS PHYSCL SWISS GOLD SHRS	ETF 基金	交易型开放式	ETF Securities USI LLC	15,629,344.56	9.02
7	ISHARES GOLD CH	ETF 基金	交易型开放式	BlackRock Asset Management Schweiz AG	12,107,818.76	6.99

注：报告期末，本基金仅持有上述7只基金。

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	–
2	应收证券清算款	579,561.65
3	应收股利	–
4	应收利息	2,046.68
5	应收申购款	89,469.40
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	671,077.73

(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

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

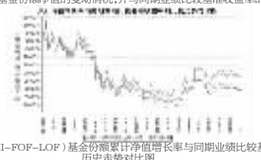
九、基金的业绩

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.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
2011年8月4日至2011年12月31日	-7.00%	0.64%	-10.32%	1.79%	3.32%	-1.15%
2012年	0.85%	0.82%	8.00%	1.06%	-7.35%	-0.23%
2013年	-30.13%	1.19%	-29.51%	1.32%	-0.62%	-0.13%
2014年	-2.60%	0.78%	0.49%	0.82%	-3.09%	-0.04%
2015年	-5.81%	0.81%	-6.73%	0.91%	0.92%	-0.10%
2016年	13.17%	0.90%	15.49%	1.04%	-2.32%	-0.14%
2017年	3.83%	0.58%	6.12%	0.66%	-2.29%	-0.08%

2.自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准收益率的变动比较



图：嘉实黄金（ODII–FOF–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

（2011年8月4日至2017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（十二（二）投资范围和（六）投资限制（二）投资组合限制）的有关约定。

十、基金管理人

（一）基金管理人概况

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63层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦9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）68215688
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

（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

生成立先生，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；中国银行董事、纪检监察组组长（兼）；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。

朱雷女士，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岗；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。

商略先生，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 Elbeck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固定收益证券区CFO、COO，JP Morgan Chase固定收益证券区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12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财政部长兼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、研发发展部总经理；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

陈正宪先生，12年证券从业经历，曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任公司指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。2016年1月5日至今任嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实中证500ETF及其联接基金基金经理，2016年3月24日至今任嘉实中证400ETF及其联接基金、嘉实基本面50（LOF）基金经理，2017年6月7日至今任嘉实中证大数据产业ETF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15日至今任嘉实创业板ETF基金经理。2016年1月5日至今任本基金基金经理。

何如女士，硕士研究生，12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，先后任职于产品管理部、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日任嘉实中创400ETF、嘉实中证500ETF联接基金经理，2014年6月13日至今任嘉实中证主要消费ETF、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H股指数（LOF）、嘉实中证500ETF及其联接基金基金经理，2016年3月24日至今任嘉实中证大数据产业ETF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。2016年1月5日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

2014年3月11日至2016年1月5日，杨宇先生任本基金基金经理。

2011年8月4日至2014年3月11日，杨阳先生任本基金基金经理。

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：嘉实国际行政总裁Peng Wah Choy、嘉实国际首席投资官 Thomas Kwan、高级基金经理 Yi Cian Jiang、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、费用概览

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

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

成立时间：1994年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2017年末，中国工商银行资产托管部共有员工230人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国从事证券投资基金托管业务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、OFII资产、ODII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只，自2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的54项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外企业融资域的持续认可和广泛好评。

十三、境外资产托管人

境外托管人基本情况

名称：纽约梅隆银行股份有限公司 The Bank of New York Mellon Corporation

注册地址：225 Liberty St, New York, New York 10286 USA

办公地址：225 Liberty St, New York, New York 10286 USA

法定代表人：Gerald L. Hassell (Chairman & CEO – 董事长兼首席执行官)

股东权益：388亿美元（截止2016年12月31日）

托管资产规模：293万亿美元（截止2016年12月31日）

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

信用等级：A1评级（穆迪），A（标普）（2016年12月31日）

（一）境外托管人的基本情况

名称：纽约梅隆银行股份有限公司The Bank of New York Mellon Corporation

注册地址：225 Liberty St, New York, New York 10286 USA

办公地址：225 Liberty St, New York, New York 10286 USA

法定代表人：Gerald L. Hassell (Chairman & CEO – 董事长兼首席执行官)

成立时间：1784年

（二）最近一个会计年度、托管资产规模、信用等级等

纽约梅隆银行公司总部设在美国纽约225 Liberty Street，是美国历史最悠久的商业银行，也是全球最大的金融服务公司之一，公司服务元化及其配套业务于一体，服务内容包括资产管理、资产服务、发行人服务、清算服务、资金服务和财富管理。公司通过在全球35个国家和地区设立的分支机构，为超过100个金融市场的投资提供证券托管服务，为全球最大的托管行，并且是全球最大的资产管理服务提供商之一。公司在存托凭证、公司信托、股东服务、清算贸易、融资服务、佣金管理等业务方面都位居全球前列，并且是领先的美元现金管理、结算服务和全球支付服务供应公司。

截至2016年12月31日，纽约梅隆银行托管资产规模达29.9万亿美元，管理资产规模为16万亿美元。

截至2016年12月31日，纽约梅隆银行股东权益为388亿美元，一级资本充足率为12.6%。全球员工总人数为52,000。

信用等级：A1评级（穆迪），A（标普）（截止2016年10月12日）

十四、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号万豪中心D座 12层		
电话	（010）65215688	传真	（010）65215677
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2期31层09-11单元		
电话	（021）38798968	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号中服国际中心A座2单元21层04-05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）83402200	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号东润大厦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