



# 嘉实超短债证券投资基金更新招募说明书

(2006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

## 重要提示

(一) 嘉实超短债证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2006年3月22日中国证券监督管理委员会《关于同意嘉实超短债证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]48号)和2006年3月24日《关于嘉实超短债证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2006]51号)的核准,进行公开募集。本基金的基金合同于2006年4月26日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

(二) 本招募说明书是对原《嘉实超短债证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 基金管理人承诺恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,谨慎、有效地管理和运用本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。中短期债券基金不等于货币市场基金。投资有风险,投资者申购本基金前应认真阅读本招募说明书。

(五) 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2006年10月26日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日(未经审计)。

## 目 录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 一、绪言 .....                 | 3  |
| 二、释义 .....                 | 3  |
| 三、基金管理人 .....              | 6  |
| 四、基金托管人 .....              | 14 |
| 五、相关服务机构 .....             | 21 |
| 六、基金的募集 .....              | 34 |
| 七、基金合同的生效 .....            | 36 |
| 八、基金份额的申购、赎回 .....         | 36 |
| 九、基金转换 .....               | 41 |
| 十、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押 ..... | 45 |
| 十一、基金的投资 .....             | 47 |
| 十二、基金的业绩 .....             | 53 |
| 十三、基金的财产 .....             | 54 |
| 十四、基金资产估值 .....            | 55 |
| 十五、基金的收益与分配 .....          | 58 |
| 十六、基金的费用与税收 .....          | 59 |
| 十七、基金的会计与审计 .....          | 62 |
| 十八、基金的信息披露 .....           | 62 |
| 十九、风险揭示 .....              | 66 |
| 二十、差错处理 .....              | 68 |
| 二十一、基金合同的终止与基金财产的清算 .....  | 70 |
| 二十二、基金合同内容摘要 .....         | 71 |
| 二十三、基金托管协议的内容摘要 .....      | 83 |
| 二十四、对基金份额持有人的服务 .....      | 90 |
| 二十五、其他应披露事项 .....          | 92 |
| 二十六、招募说明书存放及查阅方式 .....     | 93 |
| 二十七、备查文件目录 .....           | 93 |

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实超短债证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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《基金法》、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。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语有如下含义:

| 词语或简称             | 含义                                |
|-------------------|-----------------------------------|
| 1. 基金或本基金         | 指嘉实超短债证券投资基金                      |
| 2. 基金合同或<br>本基金合同 | 指《嘉实超短债证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充 |
| 3. 招募说明书          | 指《嘉实超短债证券投资基金招募说明书》及其定期更新         |
| 4. 发售公告           | 指《嘉实超短债证券投资基金发售公告》                |
| 5. 中国证监会          | 指中国证券监督管理委员会                      |
| 6. 中国银监会          | 指中国银行业监督管理委员会                     |



|               |                                                                            |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 7. 《证券法》      | 指《中华人民共和国证券法》                                                              |
| 8. 《合同法》      | 指《中华人民共和国合同法》                                                              |
| 9. 《基金法》      | 指《中华人民共和国证券投资基金法》                                                          |
| 10. 元         | 指人民币元                                                                      |
| 11. 基金合同当事人   | 指受本《基金合同》约束，根据本《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。                 |
| 12. 基金管理人     | 指嘉实基金管理有限公司                                                                |
| 13. 基金托管人     | 指中国银行股份有限公司                                                                |
| 14. 注册登记业务    | 指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。 |
| 15. 注册登记机构    | 指办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构。      |
| 16. 投资人       | 指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者                          |
| 17. 个人投资者     | 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资人                                  |
| 18. 机构投资者     | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织。            |
| 19. 合格境外机构投资者 | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资人。       |
| 20. 基金份额持有人大会 | 指按照本《基金合同》第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议。                                    |
| 21. 基金募集期     | 指基金合同和《招募说明书》中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月。                    |
| 22. 基金合同生效    | 指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额                                             |



|            |                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------|
| 日          | 总额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日。 |
| 23. 存续期    | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限                                                    |
| 24. 工作日    | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日                                                 |
| 25. 认购     | 指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为。                                  |
| 26. 申购     | 指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为。                                     |
| 27. 赎回     | 指基金份额持有人按本基金合同规定的条件，申请卖出本基金基金份额的行为。                                    |
| 28. 转换     | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。    |
| 29. 转托管    | 指基金份额持有人将其所持有的某一基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为。                  |
| 30. 投资指令   | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令。                             |
| 31. 代销机构   | 指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构。                                   |
| 32. 销售机构   | 指基金管理人及本基金代销机构                                                         |
| 33. 基金销售网点 | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点                                                |
| 34. 指定媒体   | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站                                             |
| 35. 基金账户   | 指注册登记机构为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户                   |
| 36. 交易账户   | 指销售机构为投资人开立的记录投资人通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户                           |
| 37. 开放日    | 指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日。                                                 |
| 38. 摊余成本法  | 即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时                                         |



|            |                                                                                                                                    |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|            | 的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。                                                                                                         |
| 39. T 日    | 指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期。                                                                                                         |
| 40. 基金收益   | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。                                                                                            |
| 41. 基金资产总值 | 指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金财产的价值总和。                                                                                      |
| 42. 基金资产净值 | 指基金资产总值减去基金负债后的价值                                                                                                                  |
| 43. 基金财产估值 | 指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。                                                                                               |
| 44. 法律法规   | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充。                                                                |
| 45. 不可抗力   | 指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。 |

### 三、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  | 上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室                             |
| 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 | 王忠民                                                      |
| 总经理   | 赵学军                                                      |
| 成立日期  | 1999 年 3 月 25 日                                          |
| 注册资本  | 1 亿元                                                     |
| 股权结构  | 中诚信托投资有限责任公司 48%，立信投资有限责任公司 32.5%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 19.5%。 |
| 存续期间  | 持续经营                                                     |
| 电话    | （010）65188866                                            |
| 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。公司注册地上海,总部设在北京,在深圳、成都设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人资格。2005年公司引入新股东德意志资产管理(亚洲)有限公司,成为中外合资基金管理公司。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

## 2、部门设置情况

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。

公司目前下设十七个部门,分别是:基金投资部、固定收益部、研究部、交易部、监察稽核部、法律部、产品管理部、养老金业务部、机构客户部、渠道发展部、保险及社保业务部、营销策划部、客户服务部、运营部、财务部、人力资源部、业务发展部。

基金投资部和固定收益部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。监察稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。养老金业务部主要负责养老金客户的委托理财业务。机构客户、渠道发展部、保险及社保业务部、营销策划部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。运营部负责公司信息系统的日常运行与维护,跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务工作,人力资源部负责公司企业文化建设、文字档案、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等事务等综合事务管理。业务发展部负责公司经营战略规划、业务发展等。

## 3. 管理基金情况

截止2006年9月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、10只开放式证券投资基金,具体包括基金泰和、基金丰和、嘉实成长收益基金、嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实300指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金等证券投资基金。其中嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金属于嘉实理财通系列基金。同时,管理多个全国社保基金、企业年金

投资组合。

## （二）主要人员情况

### 1. 董事、监事及高级管理人员

王忠民先生，董事长。大学专科。曾任北京矿务局财务处会计，煤炭部财务司会计、副处长，中国统配煤矿总公司财务局局长，煤炭部财务公司筹备组负责人，中煤信托投资有限责任公司董事长兼总经理，2002年3月至今任中诚信托投资有限责任公司党委书记、董事长。

王少华先生，董事。大学本科学历，高级会计师。1992年至1995年任中国南方证券有限公司海南分公司副总经理、总经理。1996年至今在中诚信托投资有限责任公司工作，现任中诚信托投资有限责任公司总裁。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。1987年7月至1990年9月在天津通信广播公司电视设计所任助理工程师。1992年12月至1993年6月在外经贸部中国仪器进出口总公司任经济师。1993年7月至1994年8月在北京商品交易所任信息处长。1994年8月至1995年5月在天津纺织原材料交易所任总裁、法定代表人。1995年5月至1997年5月在商鼎期货经纪有限公司任副总经理兼上海营业部总经理。1998年6月至1998年9月在北京证券有限公司任基金部总经理助理、阜成路营业部总经理助理。1998年9月至2000年10月在大成基金管理有限公司助理总经理、副总经理。2000年10月至今在嘉实基金管理有限公司任总经理。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院。1990年至今，担任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，担任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今，担任立信投资有限责任公司董事长。

杨启典先生，董事。1988年毕业于东北财经大学财务会计专业。1992年至今，担任维维集团股份有限公司董事长。

Edouard Fernen Peter先生，董事，瑞士籍，美国 Carlton大学行政管理学士。曾任UBS董事总经理，德意志银行董事总经理。现任德意志资产管理公司董事总经理兼德意志资产管理（亚洲）有限公司首席执行官。

贺强先生，独立董事。大学本科学历。1982年至今在中央财经大学工作，现为教授，1994年至今任中央财经大学证券期货研究所所长。

汤欣先生，独立董事。法学博士。1998年至2000年任北京大学法学院博士后研究人员、授课教师，1999年至2000年任中国证监会《上市公司收购暂行规定（草案）》起草小组成员，2000年至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学法学院副教授。

骆小元女士，独立董事。1982年毕业于中国人民大学财会专业。1995年至2000年，担任中国注册会计师协会总会计师；2000年至今，就职于中国注册会计师协会协会注册中心，

担任中心主任。

苗菁先生，监事，大学本科。1995 年 7 月起任职于中诚信托投资有限责任公司，现任中诚信托投资有限责任公司投资管理部副总经理。

Lindsay Wright 女士，监事，大学本科（学士），曾任德意志银行（新西兰）（前身为新西兰信托银行）C00、董事总经理，德意志银行亚太资本合伙公司 C00、董事总经理，德意志信托银行亚太区 C00、德意志资产管理集团 C00 及董事总经理，德意志资产管理集团亚太区 C00。现任德意志资产管理有限公司亚太及中东区业务发展主管。

朱成刚先生，监事，法学博士。1998 年 7 月至 2002 年 1 月，就职于中国建设银行资产保全部、法律事务部；2002 年 1 月至今，就职于嘉实基金管理有限公司监察稽核部、法律部。

窦玉明先生，副总经理，硕士研究生。1994 年 6 月至 1995 年 6 月在北京中信国际合作公司金融小组工作。1995 年 6 月至 2000 年 2 月任职于深圳君安证券公司投资经理。2000 年 2 月至 2000 年 10 月任职于大成基金管理公司基金经理助理。2000 年 10 月至今任职于嘉实基金管理公司，历任投资部总监、总经理助理和公司副总经理。

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。

李道滨先生，副总经理，中共党员，法学博士，经济师。1988 年 7 月至 1990 年 9 月任职于厦门华侨博物馆。1993 年 7 月至 1998 年 9 月任职于中国厦门国际经济技术合作公司。2000 年 10 月至今任职于嘉实基金管理公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

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

## 2、基金经理

郭林军先生，数量经济学硕士，5 年证券从业经历。曾就职于中信证券金融产品开发小组从事债券研究。2002 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，先后从事债券交易、债券研究、债券投资组合经理。2006 年 4 月至今任嘉实超短债基金经理职务。

吴洪坚先生，清华大学工学硕士，3 年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心（上海），从事人民币固定收益投资及交易等工作。2005 年加入嘉实基金管理有限公司固定收益部工作，2005 年 9 月—2006 年 5 月任嘉实货币市场基金经理助理，2006 年 5 月至今任嘉实货币市场基金经理职务，2006 年 10 月至今任嘉实超短债基金经理职务。

### 3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,投资决策委员会的成员包括:公司总经理赵学军先生、公司副总经理兼投资总监窦玉明先生,公司总经理助理兼固定收益部总监戴京焦女士,资深基金经理邵健先生、王贵文先生、刘夫先生、刘熹先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### (四) 基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金财产用于以下投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

#### 4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本公司建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。内部控制制度是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。它由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，包括内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。公司基本管理制度包括内部会计控制制度、风险管理控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、

信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等进行了具体规定。

## 2. 内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、总经理助理以及投资总监、固定收益部总监、资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内

的风险负有管控及时报告的义务。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司

自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”），基本情况如下：



住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖 钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元

存续期间：持续经营

成立日期：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门总经理：秦立儒

托管部门联系人：宁敏

电话：(010) 66594977

传真：(010) 66594942

发展概况：

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域，并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务。在近百年的岁月里，中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖，打造了卓越的品牌，与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务，包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括存款、贷款、贸易相关服务和贸易融资、清算、托管等在内的各项金融产品和融资、财务解决方案。中国银行为个人客户提供包括储蓄存款、消费信贷、银行卡、个人理财、汇款等在内的各项金融服务。在多年的发展历程中，中国银行曾创造了中国银行业的许多第一，所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河，在业界独领风骚，享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域仍居领先地位。截至 2005 年底，中国银行境内外分支机构共有 11,646 个，其中境内分支机构 11,018 个，境外分支机构 627 个，是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念，不断向国际化一流大银行的目标迈进

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史，在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立，至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间，中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代，中国银行作为民族金融的支柱，以服务大众、振兴民族金融业为己任，稳健经营，锐意进取，各项业

务取得了长足发展。

新中国成立后，中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行，继续保持和发扬了顽强创业的企业精神，为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994 年随着金融体制改革的深化，中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化，与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年，中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势，中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年，中国银行成功重组了香港中银集团，将 10 家成员银行合并成当地注册的“中国银行（香港）有限公司”。2002 年 7 月，重组后的中国银行（香港）有限公司在香港联交所成功上市，成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004 年 7 月 14 日，中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，脱颖而出，作为我国银行业的优秀代表携手北京 2008 年奥运会，成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于 2003 年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行，围绕“资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行”的目标，进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制，稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004 年 8 月 26 日，中国银行股份有限公司成立，中国银行成为国家控股的股份制商业银行，标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步，中国银行的历史翻开了新的一页。

2006 年 6 月 1 日，中国银行在香港联交所成功挂牌上市，共集资 754.27 亿港元，创六年来全球最大股票发行记录。继成功发行 H 股并上市之后，2006 年 7 月 5 日，中国银行在上海证券交易所成功发行 A 股，是中国资本市场第一家国有商业银行股，是全流通背景下的第一家“海归”股。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中，在“新兴+转轨”的中国资本市场股权分置改革的大趋势中，中国银行将创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章！

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从 1990 年以来，中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜；自 1992 年，中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为“中国最佳银行”或“中国最佳本地银行”，并于 2005 年被《欧洲货币》评为中国及香港“最佳商业银行”（2005 年房地产奖项）；2004 年及 2005 年，中国银行被《环球金融》杂志评为“中国最佳贸易融资银行”和“中国最佳外汇银行”；在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的“2005 中国营销盛典”中，被评为“2005 年度中国企业营销创新奖”（是获奖企业中唯一的金融企业）；2005 年，被《中国人才》（《China

Staff》) 授予“中国大陆‘最佳人力资源战略奖’”，这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖；根据英国《金融时报》2005年8月进行的调查，中国银行是中国的十大国际品牌之一；另外，中国银行被国家工商总局授予“中国驰名商标”。世纪信誉，环球共享。中国银行将秉承“以客户为中心，以市场为导向，强化公司治理，追求卓越效益，创建国际一流大银行”的宗旨，依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验，竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务，与广大客户携手共创美好未来。

#### 财务概况：

2005年，中国银行集团实现营业利润647.44亿元，比2004年增长12%；净利润275亿元，比2004年增长31%；总资产回报率和权益净回报率分别达到0.72%和12.62%，同比提高0.11个百分点和2.58个百分点；资产质量持续改善，2005年末不良贷款比率从2004年末的5.12%进一步下降到4.62%。

#### （二）主要人员情况

肖钢先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自1996年10月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月，1981年毕业于湖南财经学院，1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自2004年8月起担任中国银行副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自2004年8月起担任中国银行股份有限公司执行董事、副行长。自2000年11月起任中国银行副行长。1993年12月至2000年11月任中国人民建设银行副行长，1987年12月至1993年12月历任中国人民建设银行大连市分行行长、中国人民建设银行计算机中心主任、国际业务部总经理。李先生出生于1955年4月，1978年毕业于南京气象学院。

秦立儒先生，自2005年10月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005年5月至2005年10月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004年

4 月至 2005 年 5 月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002 年 7 月至 2004 年 4 月任中国银行（香港）有限公司资金部总经理；1999 年 6 月至 2002 年 7 月任香港中银集团外汇交易中心总经理；1997 年 9 月至 1999 年 6 月任广东省银行香港分行（香港中银集团）总经理；1995 年 11 月至 1997 年 9 月任中国银行总行资金部副总经理，主管全球资金交易；1991 年 5 月至 1995 年 11 月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理；1987 年 10 月至 1991 年 5 月历任中国银行总行资金部副处长、处长；1982 年 8 月至 1987 年 9 月任中国银行卢森堡分行外汇部经理；1978 年 2 月至 1982 年 7 月，先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于 1955 年 5 月，1978 年毕业于北京外贸学院。

### （三）证券投资基金托管情况

截止到 2006 年 6 月末，中国银行已托管景宏、同盛、同智、兴安、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币市场、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、天同 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、招商先锋、大成蓝筹稳健、湘财荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合股票型基金等 41 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种，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。

### （四）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队；并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 70 余人，其中硕士学历以上人员 21 人，具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

### （五）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系，以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是：以完善的内部控制组织体系为保障，以体现制衡原则、健全有效的制度为基础，以精细化的过程为着眼点，以激励约束机制和问责制为引导，以信息科技手段为依托，大力培育合规文化，努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标，中国银行从明确职责入手，完善内部控制组织体系建设；从制度建设入手，夯实内部控制基础；从细节入手，实现精细化的过程控制；从完善激励约束机制和问责制入手，引导内部控制目标的实现；从加强信息技术手段入手，提高内部控制水平和质量；从加强教育培训入手，促进合规文化的形成。

## 2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 8 月 26 日成立以来，按照国家有关法律法规制定了新的公司章程，形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1) 董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会，并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施，以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构，风险管理部拟订风险管理策略及工作计划，并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能，中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动，对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估，负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005 年 11 月，董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程，进一步明确内部稽核职能独立于业务部门，并由董事会的稽核委员会领导，在董事会授权下，稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算，以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门，各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核，向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制，明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任，相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2) 中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任，管理本行风险的各个方面，包括风险管理策略、措施和信贷政策，并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理

层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行，决定内部控制基本制度，评估内部控制体系的有效性，以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷，督导改进措施的落实，审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划，制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度，并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构，该部负责管理法律风险、合规风险，并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理，以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策，制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构，该部按照资产负债管理委员会制订的政策，管理本行流动性，预测本行流动性的需求和风险，并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策，负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜，法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3) 托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组，作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

### 3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

#### 4、其他事项

最近一年内，基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### （六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### 五、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北京直销中心

办公地址：北京市建国门北大街8号华润大厦8层

电话：（010）65188866

传真：（010）65180017

联系人：钱卫东

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区富城路99号震旦国际大厦1702室

电话：（021）38789658

传真：（021）68880023

联系人：晨文红

##### （3）嘉实基金管理有限公司西南直销中心

办公地址：成都市人民中路2段35号中银大厦2911—2912



电话：(028) 86402797

传真：(028) 86402799

联系人：胡清泉

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳直销中心

办公地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦附楼二楼

电话：(0755) 25870686

传真：(0755) 25870663

联系人：钟俊杰

## 2、代销机构

### (1) 中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

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

法定代表人：肖钢

电话：(010) 66594973

传真：(010) 66594946

联系人：高越

客户服务电话：95566

网站：<http://www.boc.cn>

### (2) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市东城区正义路4号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人： 经叔平

电话：(010) 58560666

传真：(010) 58560794

联系人：吴杰

客户服务电话：95568

网址：<http://www.cmbc.com.cn>

### (3) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市五一中路元洪大厦25层



法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

传真：(0591) 83317786

电话：(0591) 87839338

联系人：陈丹

网站：www.cib.com.cn

**(4) 上海浦东发展银行股份有限公司**

住所：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：金运

电话：(021) 68881829

客服电话：95528

联系人：倪苏云

网址：www.spdb.com.cn

**(5) 深圳发展银行股份有限公司**

住所、办公地址：深圳深南中路5047号发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼(Frank N. Newman)

电话：(0755) 82088888-8811

传真：0755-82080714

联系人：周 勤

客服热线：95501

网址：www.sdb.com.cn

**(6) 中国银河证券有限责任公司**

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：朱利

电话：(010) 66568587

传真：(010) 66568536

联系人：郭京华

网址：www.chinastock.com.cn

**(7) 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：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021)62580818-213

传真：(021)62583439

联系人：芮敏祺

客户服务热线：4008888666

网址：www.gtja.com

**(8) 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：王明权

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54038844

联系人：王序微

客服电话：(021) 962505

网址：www.sw2000.com.cn

**(9) 国都证券有限责任公司**

住所：深圳市福田区华强北路赛格广场45楼

办公地址：北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人：王少华

电话：(010)64482828

传真：(010)64482090

联系人：马泽承

客户服务电话：8008108809

网址：www.guodu.com

**(10) 中信证券股份有限公司**

住所：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：(010) 84864818



传真：(010) 84865560

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

**(11) 广发证券股份有限公司**

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广州市天河北路大都会广场36、38、41、42楼

法定代表人：王志伟

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87557987

联系人：肖中梅

客户咨询电话：(020) 87555888转各营业网点

网址：www.gf.com.cn

**(12) 海通证券股份有限公司**

住所：上海市唐山路 218 号

办公地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566—4125

传真：(021) 53858549

联系人：金芸

客户服务电话：(021) 962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

**(13) 中信建投证券有限责任公司**

住所：北京市朝阳区安立路 66 号

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：(010) 65183888

传真：(010) 65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

**(14) 兴业证券股份有限公司**

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：(021)68419974

传真：(021)68419867

联系人：杨盛芳

客户服务热线：021-68419125

网址：www.xyzq.com.cn

**(15) 湘财证券有限责任公司**

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地点：上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 18 楼

法定代表人：陈学荣

电话：(021) 68634518

传真：(021) 68865938

联系人：陈伟 (021) 68634818-8631

客服电话：(021) 68865020

网址：www.xcsc.com www.eestart.com

**(16) 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 40-45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755)82943511

传真：(0755)82943227

联系人：黄健

客户服务热线：4008888111、(0755)26951111

网址：www.newone.com.cn

**(17) 渤海证券有限责任公司**

住所：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军



电话：(022) 28451883

传真：(022) 28451892

联系人：徐焕强

网址： [www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

**(18) 平安证券有限责任公司**

住所、办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：杨秀丽

电话：(0755) 82450826

传真：(0755) 82433794

联系人：任磊、苗永华

全国统一客户服务热线：95511

网址： [www.pa18.com](http://www.pa18.com)

**(19) 东方证券股份有限公司**

住所：上海市浦东新区浦东大道 720 号 20 楼

办公地址：上海市巨鹿路 756 号

法定代表人：王益民

电话：(021) 62476600

传真：(021) 62474651

联系人：盛云

客户服务电话：(021) 952506

网址： [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

**(20) 江南证券有限责任公司**

住所、办公地址：江西省南昌市象山北路 208 号

法定代表人：姚江涛

电话：(010) 84802022

传真：(010) 84801799

联系人：方俊才

客户服务电话：(0755) 83366612, 83325909

网址： <http://www.scstock.com>

**(21) 华泰证券有限责任公司**



住所、办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：(025)84457777-882、721

传真：(025)84579879

联系人：张雪瑾、袁红彬

客户咨询电话：(025)84579897

网址：www.htsc.com.cn

#### **(22) 东北证券有限责任公司**

住所：长春市人民大街 138-1 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李树

电话：(0431) 96688-99、(0431) 5096733

传真：(0431) 5680032

联系人：高新宇

网址：http://www.nesc.cn

#### **(23) 财富证券有限责任公司**

住所、办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27 层

法定代表人：蒋永明

电话：(0731) 4403343

传真：(0731) 4403439

联系人：张治平

客户服务热线：(0731) 4403343

网址：www.cfzq.com

#### **(24) 宏源证券股份有限公司**

住所：新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层（营销经纪总部）

法人代表人：高冠江

电话：(010) 62267799-6316

传真：(010) 62294470

联系人：师敬泽



咨询电话：(010) 62267799—6789

网址：www.ehongyuan.com

**(25) 中信万通证券有限责任公司**

住所、办公地址：青岛市崂山区香港东路 316 号

法定代表人：史洁民

电话：(0532) 5022026

传真：(0532) 5022511

联系人：陈向东、丁韶燕

网址：www.zxwt.com.cn

**(26) 中银国际证券有限责任公司**

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：平岳

客服电话：(021) 68604866

传真：(021) 50372474

联系人：张静

网址：http://www.bocichina.com.cn

**(27) 长城证券有限责任公司**

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 层

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：魏云鹏

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83516199

联系人：高峰

客户咨询电话：(0755) 82288968

网址：www.cc168.com.cn

**(28) 德邦证券有限责任公司**

住所：沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人：王军



电话：(021) 68590808—8125

传真：(021) 68596077

联系人：罗芳

客服电话：(021) 68590808—8119

网址：www.tebon.com.cn

电子信箱：mail@tebon.com.cn

**(29) 光大证券股份有限公司**

住所、办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15—16 楼

法定代表人：王明权

电话：(021) 68816000

传真：(021) 68815009

联系人：张琦

客户服务电话：(021) 68823685

网址：www.ebscn.com

**(30) 东海证券有限责任公司**

住所：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达广场13楼

法定代表人：顾森贤

电话：(021) 50586660

传真：(021) 50586660-8880

联系人：邵一明

客户服务热线：(010) 86525005、(021) 62196752、(0755) 83154530、(0519) 6634000

网址：http://www.longone.com.cn

**(31) 东吴证券有限责任公司**

住所：苏州市十梓街 298 号

办公地址：苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

电话：(0512) 65581136

传真：(0512) 65588021

联系人：方晓丹



客户服务热线：(0512)96288

网址：www.dwzq.com.cn

**(32) 国信证券有限责任公司**

住所、办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

电话：(0755)82130833

传真：(0755)82133302

联系人：林建闽

客户服务电话：800-810-8868

网址：www.guosen.com.cn

**(33) 国联证券有限责任公司**

住所：江苏省无锡市县前东街 8 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号国联大厦 7 楼

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

电话：(0510) 2831662, 2588168

传真：(0510) 2831589

网址：http://www.glsc.com.cn

**(34) 国盛证券有限责任公司**

住所：江西省南昌市永叔路15号

办公地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人：管荣升

联系电话：(0791) 6289771

传真电话：(0791) 6289395

联系人：万齐志

网址：www.gsstock.com

**(35) 金元证券有限责任公司**

住所：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：郑辉



电话：(0755) 83025695

传真：(0755) 83025625

联系人：金春

开放式基金客服电话：(0755) 83025695

网址：<http://www.jyzq.cn>

**(36) 广东证券股份有限公司**

住所、办公地址：广州市解放南路 123 号金汇大厦

法定代表人：钟伟华

电话：(020) 83270846

传真：(020) 83270846-76504

联系人：陈新

网址：[www.stock2000.com.cn](http://www.stock2000.com.cn)

**(37) 联合证券有限责任公司**

住所、办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：(0755) 82492000

传真：(0755) 82492062

联系人：范雪玲

客户服务电话：4008888555、(0755) 25125666

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

**(38) 山西证券有限责任公司**

住所、办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心

法定代表人：吴晋安

电话：(0351) 8686766、8686708

传真：(0351) 8686709

联系人：邹连星、刘文康

客户服务电话：(0351) 8686868

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

**(39) 国元证券有限责任公司**

住所、办公地址：合肥市寿春路 139 号



法定代表人： 凤良志

电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

传真：(0551) 2634400—117

联系人： 李蔡

网址： [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

**(40) 民生证券有限责任公司**

住所、办公地址：北京市朝阳区门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室

法定代表人： 岳献春

电话：(010) 85252605

传真：(010) 85252655

联系人： 杨甦华

客户服务电话：(0371) 67639999

网址： [www.msza.com](http://www.msza.com)

**(41) 中信金通证券有限责任公司（原金通证券股份有限公司）**

住所、办公地址：浙江省杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 8-12 层

法定代表人： 应土歌

电话：(0571) 85783752

传真：(0571) 85783748

客服电话：(0571) 96598

联系人： 何燕华

网址： <http://www.bigsun.com.cn>

**(42) 长江证券有限责任公司**

住所：湖北省武汉市江汉区新华下路特 8 号

办公地址：上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F

法定代表人： 胡运钊

电话：(027) 65799560

传真：(027) 85481532

联系人： 冯蔚

客户服务热线：(027) 65799999

网址： [www.cz318.com.cn](http://www.cz318.com.cn)

**(43) 西部证券股份有限公司**

住所、办公地址：西安市东大街232号信托大厦16、17层

法定代表人：刘建武

电话：（029）87406172

传真：（029）87406387

联系人：黄晓军

客户服务电话：（029）87406132

网址：www.westsecu.com.cn

**(二) 基金注册登记机构：嘉实基金管理有限公司（同上）****(三) 律师事务所和经办律师**

名称：国浩律师集团（北京）事务所

住所：北京市东城区建内大街贡院西街六号E座9层

负责人：张涌涛

联系电话：010-65171188

传真：010-65176800

联系人：杜玉松

经办律师：杜玉松、黄伟民

**(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有限公司

住所：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

联系人：许康玮

经办注册会计师：汪棣 许康玮

## 六、基金的募集

**(一) 基金募集的依据**



本基金经中国证券监督管理委员会2006年3月22日《关于同意嘉实超短债证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2006]48号）核准公开募集。

（二）基金运作方式和类型

契约型开放式，债券基金

（三）基金存续期：不定期

（四）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象

1. 募集期限：2006年3月30日至2006年4月21日

2. 募集方式及场所：本基金管理人直销中心和中国银行以及其他代销机构。

3. 募集对象：中华人民共和国境内的个人投资人、机构投资人（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）和合格境外机构投资人。

（四）募集目标

本基金不设定发售规模上限。

（五）认购的时间：2006年3月30日至2006年4月21日

（六）基金的面值、认购价格及计算公式、认购费用

1. 基金份额面值：1.00元人民币

2. 认购价格=基金份额面值

3. 认购费率：本基金不收取认购费

4. 有关基金认购数额的计算

（1）募集资金利息在基金募集期结束时归入投资人认购金额中，折合成投资人所认购的基金份额。募集资金利息的数额以基金注册登记机构的记录为准。

（2）本基金每份基金份额面值均为人民币1元，每份基金份额认购价格为人民币1元。

认购份额的计算方法如下：

本金认购份额=认购金额/基金份额面值

利息认购份额=认购期利息/基金份额面值

认购份额=本金认购份数+利息认购份数

其中：认购份数保留至0.01份基金份额，小数点后两位以后舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。

（七）募集资金利息的处理方式

募集期间认购资金利息在募集期结束时归入投资者认购金额中，折合成基金份额，归投资者所有。募集资金利息的数额以基金注册登记机构的记录为准。

基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入商业银行，不得动用。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2006 年 4 月 26 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

基金合同生效后，当基金份额持有人数量不满200人，或基金资产净值低于人民币5000万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律、法规或证券监管部门另有规定的，从其规定办理。

## 八、基金份额的申购、赎回

### （一）基金投资人范围

个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （二）申购、赎回的场所

- 1、基金管理人直销网点；
- 2、各代销机构开办开放式基金业务的营业网点；
- 3、本基金开通的网上交易系统。

基金管理人可根据情况变更或增减基金的销售机构及网点，并按规定予以公告。

### （三）申购、赎回的开放日及时间

本基金的申购和赎回业务于2006年5月15日开始办理。

申购、赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体由基金管理人在《更新的招募说明书》中规定。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将根据法律法规和基金合同规定的原则视情况进行相应的调整并公告。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### （四）申购、赎回的原则

1. “未知价原则”，即本基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. 本基金采用金额申购、份额赎回原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；
4. 当日的申购、赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；
5. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日予以公告。

#### （五）申购、赎回的程序

##### 1. 申购、赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回的申请。

投资人在提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金。投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2. 申购、赎回申请的确认

基金管理人应以在规定的业务办理时间段内收到申购、赎回申请的当天作为申购、赎回的申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2工作日及之后到其提出申请的网点进行成交查询。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定将赎回款项于T+1日从基金托管账户划出，经销售机构划往投资人银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。

#### （六）申购、赎回的数额限制

##### 1. 申请申购基金的金额

投资人通过代销机构首次申购单笔最低限额为人民币1000元；投资人通过直销中心首次申购单笔最低限额为人民币20000元；追加申购单笔最低限额为人民币1000元。



投资人将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

## 2. 申请赎回基金的份额

投资人可将其全部基金份额赎回。

单笔赎回不得少于1000份（如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足1000份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的基金余额不足1000份时，基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的基金剩余份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况调整有关申购、赎回的程序和数额限制以及在销售机构保留的最低份额限制，但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4、对于大额申购赎回申请，须提前一个工作日预约；对于没有预约的单笔大于等于2亿元的申购申请或单笔大于等于2亿份的赎回申请，管理人可以拒绝。

## （七）申购、赎回的费率

本基金的申购、赎回费率均为零。

## （八）申购份额、赎回金额的计算方式

### 1. 申购份额的计算

申购份额 = 申购金额 ÷ 基金份额净值

例一：假定T日某投资人投资10,000元申购嘉实超短债证券投资基金，则其可得到的申购份额计算如下：

|        | 嘉实超短债证券投资基金基金份额 |
|--------|-----------------|
| 申购金额   | 10,000元         |
| 基金份额净值 | 1.02元           |
| 申购份额   | 9,803.92份       |

申购份额保留至小数点后两位，小数点后两位以下舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

### 2. 基金赎回金额的计算

赎回金额 = 赎回份额 × 基金份额净值

例二：假定某投资人在T日赎回10,000.00份基金份额，则其获得的赎回金额计算如下：



|        |                 |
|--------|-----------------|
|        | 嘉实超短债证券投资基金基金份额 |
| 赎回份额   | 10,000.00份      |
| 基金份额净值 | 1.02元           |
| 赎回金额   | 10,200.00元      |

赎回金额保留至小数点后两位，小数点后两位以下舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

3. T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。其计算公式为：计算日基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日基金总份额。

#### （九）申购、赎回的注册登记

1. 经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2. 投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1工作日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自T+2工作日起有权赎回该部分基金份额。

3. 投资人赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1工作日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施三个工作日以前予以公告。

#### （十）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请有困难，或认为兑付投资人的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接

受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额;未受理部分除投资人在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权,以此类推,直到全部赎回为止。投资人在提出赎回申请时也可选择将当日未获受理部分予以撤销。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告,并说明有关处理方法。

(4) 暂停接受和延缓支付:本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过正常支付时间二十个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

(5) 当发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先级,具体处理方式和程序由基金管理人另行公告。

#### (十一) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1. 在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请,此时,由其他基金转入本基金的转入申请将按同样方式处理:

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请;
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市;
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况;
- (4) 基金财产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种;
- (5) 其他可能对基金业绩或流动性产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;
- (6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如发生上述拒绝申购的情形,被拒绝的申购款项应全额退还投资人。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括:

- (1) 拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请;
- (2) 拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请;
- (3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2. 在如下情况下,基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请,此时,由本基金转出

的转出申请将按同样方式处理：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市；
- (3) 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

3. 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。发生基金合同或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

4. 暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。基金暂停申购、赎回，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过1天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种指定信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

## 九、基金转换

基金转换是基金管理人给基金份额持有人提供的一种服务，是指基金份额持有人按基金

管理人规定的条件将其持有的某一只基金的基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。

### （一）基金转换开始日及时间

基金转换的开始办理时间：2006年6月14日起。

办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

投资人需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

### （二）基金转换的原则

- 1、本基金采用份额转换原则，即转换以份额申请；
- 2、当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；
- 3、基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；
- 4、投资人可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；
- 5、基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日予以公告。

### （三）基金转换的程序

#### 1、基金转换的申请方式

基金投资人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

提交基金转换申请时，帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### 2、基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2工作日及之后查询成交情况。

### （四）基金转换的数额限制

基金转换时，由本基金转换到嘉实旗下其他开放式基金时，最低转出份额为1000份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的程序及有关限制,但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### (五) 基金转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担,用于支付有关手续费和注册登记费。

本基金的转换费率按照如下方式收取:

(一) 由嘉实超短债证券投资基金转出至嘉实成长收益证券投资基金、嘉实理财通系列证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实浦安保本混合型证券投资基金、嘉实货币市场基金、嘉实主题精选证券投资基金,转换费=转出金额×转入基金的适用申购费率。

(注:此转换行为,视同将转出金额用于申购嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实主题精选证券投资基金)。

(二) 由嘉实成长收益证券投资基金、嘉实理财通系列证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实浦安保本混合型证券投资基金、嘉实货币市场基金、嘉实主题精选证券投资基金转出至嘉实超短债证券投资基金,转换费=转出金额×转出基金的适用赎回费率,该等转换费的25%计入转出基金的基金资产。

(注:此转换行为,视同赎回嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实主题精选证券投资基金,再将赎回金额用于申购嘉实超短债证券投资基金)。

基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率,调整后的基金转换费率在《更新的招募说明书》中列示。上述费率如发生变更,基金管理人还应最迟于新的费率实施前三个工作日在至少一种指定的信息披露媒体公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)或在特定时间段等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金转换费率。

#### (六) 基金转换份额的计算方式

转出金额=转出份额×转出基金T日的基金份额净值

基金转换费=转出金额×基金转换费率

转入金额=转出金额-基金转换费

转入份额=转入金额÷转入基金T日的基金份额净值

例三：假定某投资人在T日转出10,000份基金份额至嘉实超短债证券投资基金，转出基金T日的基金份额净值为1.1000元，转入基金份额净值为1.02元，假设转换费率为0.25%，则可获得转入基金的基金份额计算如下：

| 转出份额   | 转出基金份额净值 | 转出金额    | 转换费   | 转入金额       | 转入基金份额净值 | 转入份额      |
|--------|----------|---------|-------|------------|----------|-----------|
| 10,000 | 1.1000元  | 11,000元 | 27.50 | 10,972.50元 | 1.02元    | 10,757.35 |

转换份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

### （七）基金转换的注册登记

投资人申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T+1工作日为投资人办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资人自T+2工作日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前三个工作日予以公告。

### （八）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

### （九）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的转入申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的转入申请；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市；
- （3）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- （4）其他可能对基金业绩或流动性产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

（5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转入；

（6）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的转出申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市；

- (3) 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 当基金管理人认为某笔转出会有损于现有基金份额持有人利益；
- (5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

3、发生基金合同或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准。

4. 基金暂停转换或暂停后重新开放转换时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## 十、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

### （一）非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、强制执行，及注册登记机构认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

- 1. “继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人或受遗赠人继承；
- 2. “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；
- 3. “遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；
- 4. “自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；
- 5. “分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；
- 6. “国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；
- 7. “机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；
- 8. “资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资

产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；

9. “机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；

10. “企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；

11. “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，并向基金注册登记机构申请办理。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## （二）转托管

基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在办理转托管手续后转入其指定的销售机构（网点）。

## （三）冻结与质押

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一律转为基金份额并冻结。

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金份额位的质押业务，制定并实施相应的业务规则。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳妥，保持资产较高的流动性，降低基金净值波动风险，取得超过比较基准的稳定回报。

### （二）投资范围

本基金投资范围为固定收益类金融工具，具体包括国债、金融债、信用等级为投资级及以上的企业债和次级债券等；债券回购；央行票据、银行存款、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金不投资于可转换债券。

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。

### （三）投资理念

坚持相信由战略性资产类别配置和证券品种选择的积极投资，并结合风险控制的战略性应用，能为投资组合提供持续稳定的增加价值。本着承担最小的风险，谋求投资收益的最大化的投资原则，稳健投资。在获取合理收益的同时，使投资组合承担较低风险，同时保持组合较好的流动性。真正达到为持有人规避风险，提供稳定回报的目的。

### （四）投资策略

本基金主要目标是在保持传统货币市场基金的本金稳妥、高流动性特点的同时，通过适当延长基金投资组合的久期，投资于期限稍长的固定收益工具，获取更高的投资收益。因此本基金的投资策略也是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略，一方面将基金的大部分资产投资于货币市场工具，保持基金资产的高流动性，同时提供稳定的收益；另一方面，通过价值挖掘，将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具，比如投资级的企业债、金融债、次级债、浮动利率债等，为基金资产提供超额收益。本基金的投资策略主要包括：

#### 1、久期策略

为了保持本基金明显的收益-风险特征，本基金的久期保持大于0.5年，小于1年。在分析宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率）和财政货币政策等的基础上，对未来较长一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。

#### 2、收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析,预测收益率曲线的变化趋势,并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容,一是收益率曲线本身的变化,根据收益率曲线可能向上移动或向下移动,降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征,通过骑乘策略,投资于最有投资价值的债券。

### 3、买入持有策略

本基金的投资对象主要是短期的固定收益类投资工具,一般情况下,本基金对这些短期固定收益投资工具,采取买入持有策略,以便降低基金净值的波动性。

### 4、相对价值挖掘策略

本基金在主要投资于货币市场工具的同时,深入挖掘市场上各类固定收益型投资产品由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况造成的短期内市场失衡;新股、新债发行以及节日效应等因素导致的市场资金供求发生短时失衡等。这种失衡将带来一定投资机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

### 5、无风险套利策略

本基金将充分利用投资范围广泛的特点,寻找各类可投资工具之间存在的无风险套利机会,比如跨市场套利、跨品种套利等。

本基金在投资过程中,将综合运用多种投资策略,使投资组合产生持续稳定的回报,而不是仅仅依赖某一种投资策略。在投资的过程中,即使通过价值挖掘发现某只债券具有较高的投资价值,也不在单只债券上暴露过多的风险,而是将风险分散到多只债券上,每只债券只承担较小的风险。同时我们还将通过数量模型,分析个券、类属债券直至整个投资组合的风险-收益特征,并在二者之间做到有效平衡。

## (五) 业绩比较基准

一年期银行定期储蓄存款的税后利率。

当法律法规发生变化或有更加适合的业绩比较基准时,基金管理人有权对此基准进行调整,并提前三个工作日在至少一种指定媒体上公告。

## (六) 风险收益特征

本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金,低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

## (七) 投资决策

### 1、决策依据

(1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

(2) 宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况;

(3) 策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

## 2、决策程序

(1) 投资决策委员会定期召开会议，决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合类属资产配置比例等做出决议。

(2) 研究部对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。

(5) 监察稽核部负责核查基金的操作是否符合基金合同和有关基金投资的法律、法规；运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告。风险控制委员会定期召开会议，负责监督基金管理组投资方案的执行情况，评估风险监控报告，并进行投资风险管理。

### (八) 投资组合限制

本基金投资组合应符合以下规定：

(1) 基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；

(2) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

(3) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

(4) 投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年；

(5) 不投资非投资级的债券；

(6) 不投资股票和可转债；

(7) 不投资剩余期限在7年以上的债券；

(8) 持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%；

(9) 投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%，投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%；

(10) 持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；同一基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；投资的资产支持证券信用级别评级为BBB级以上(含BBB)或相当于BBB级。

(11) 中国证监会规定的其他比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同

的有关约定。

#### （九）银行间市场交易的信用风险控制

（1）基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督。

（2）基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

- ①银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；
- ②银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；
- ③如无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人内部特别授权的风险管理人员批准。

#### （十）各种资产和负债的久期的确定

1、银行存款、清算备付金、交易保证金的久期为0；证券清算款的久期以计算日至交收日的剩余交易日时间计算；买断式回购履约金的久期以计算日至协议到期日的实际剩余时间计算。

2、银行定期存款、大额存单的久期以计算日至协议到期日的实际剩余时间计算。

3、组合中债券和剩余期限在1年以上的央行票据的久期是指该债券的麦考莱久期，以下情况除外：允许投资的浮动利率债券的久期以计算日至下一个利率调整日的实际剩余时间计算。

4、回购（包括正回购和逆回购）的久期以计算日至回购协议到期日的实际剩余时间计算。

5、剩余时间在1年以内的中央银行票据的久期以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余时间计算。

6、买断式回购产生的待回购债券的久期为该基础债券的久期。

7、买断式回购产生的待返售债券的久期以计算日至回购协议到期日的实际剩余时间计算。

8、基金管理人可以和托管人协商决定新的固定收益率类产品久期的计算方法，或者修改现有的久期计算方法。

9、中国证监会规定的其他情况

#### （十一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1. 投资于其他基金份额；
- 2. 投资于股票或可转换债券；

3. 将基金财产向他人贷款或者提供担保；
  4. 从事可能使基金承担无限责任的投资；
  5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金托管人、基金管理人发行的股票或债券；
  6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；
  7. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
  8. 承销证券；
  9. 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
- 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。

#### **（十二）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则**

- （1）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益；
- （2）有利于基金资产的安全与增值。

#### **（十三）风险管理**

本基金投资于固定收益类金融工具，而且组合久期不超过 1 年，整个基金的风险处于较低的水平。尽管如此，依然有必要对本基金实施严格的风险管理。

##### **（1）利率风险的控制**

在利率风险控制方面，本基金将严格遵循投资程序，严格控制组合久期不超过 1 年，相比中长期债券基金而言，其利率风险相对较低。一旦出现利率大幅上升的情景，本基金将进一步降低组合久期，将基金资产投资于流动性好且利率风险低的货币市场工具。另外，本基金在构建组合时将根据风险监控指标进行及时的组合重整，以进一步对利率风险进行控制。

##### **（2）流动性风险的控制**

由于本基金要求较好的流动性，基金发生大额赎回时可能造成投资收益的减少，引至流动性风险。为控制赎回导致的风险，本基金在资产配置层面上，会持有一定比例的现金，在正常情况下，本基金的现金部分足以满足赎回带来的流动性需求；本基金在投资过程中将时刻监控组合中各券的流动性情况，对流动性差的个券及时置换出去，保持投资组合整体上较高的流动性水平；当遇到巨额赎回时，本基金将会进一步变现组合中流动性较好的投资对象或通过回购等融资手段获得现金资产应对赎回，避免巨额赎回带来的投资损失；同时，基金合同中关于巨额赎回的有关规定也在一定程度上降低了由于巨额赎回而导致的流动性风险。

#### **（十四）基金的融资**

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

#### **（十五）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。

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 2006 年 10 月 25 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 2006 年 9 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

| 资产组合            | 金额（元）            | 占基金总资产的比例 |
|-----------------|------------------|-----------|
| 债券投资            | 1,864,843,687.38 | 89.63%    |
| 买入返售证券          | 182,150,000.00   | 8.75%     |
| 其中：买断式回购的买入返售证券 |                  |           |
| 银行存款和清算备付金合计    | 26,341,227.66    | 1.27%     |
| 其他资产            | 7,367,354.03     | 0.35%     |
| 合计              | 2,080,702,269.07 | 100%      |

## 2 报告期末债券投资组合

### （1）按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 市值（元）            | 占基金资产净值的比例 |
|----|-----------|------------------|------------|
| 1  | 国家债券      | 2,899,490.30     | 0.16%      |
| 2  | 金融债券      | 711,250,644.23   | 39.35%     |
|    | 其中：政策性金融债 | 561,566,253.11   | 31.07%     |
| 3  | 央行票据      | 277,811,505.45   | 15.37%     |
| 4  | 企业债券      | 855,882,047.40   | 47.35%     |
| 5  | 资产支持证券    | 17,000,000.00    | 0.94%      |
|    | 合计        | 1,864,843,687.38 | 103.17%    |

### （2）基金投资前五名债券明细

| 序号 | 债券名称       | 市值（元）          | 市值占基金资产净值的比例 |
|----|------------|----------------|--------------|
| 1  | 06 央行票据 03 | 277,811,505.45 | 15.37%       |
| 2  | 05 农发 06   | 211,637,249.33 | 11.71%       |
| 3  | 06 国开 02   | 119,003,566.97 | 6.58%        |
| 4  | 05 农发 17   | 109,837,782.69 | 6.08%        |
| 5  | 06 民生 01   | 99,868,082.68  | 5.52%        |

### 3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

| 序号 | 债券名称  | 期末市值（元）       | 市值占基金资产净值比例 |
|----|-------|---------------|-------------|
| 1  | 吴中 01 | 17,000,000.00 | 0.94%       |

## 4 投资组合报告附注

### （1）基金计价方法说明

本基金的基金份额净值的计算,精确到 0.0001 元,小数点第五位四舍五入。

在证券交易所市场交易的债券按市价估值;在银行间债券市场交易的债券及未上市债券按摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

(2) 本报告期内需说明的证券投资决策程序:无

(3) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离情况

本基金持有的银行间债券采用“影子定价”与“摊余成本法”确定基金资产净值,无重大偏离。

(4) 其他资产的构成

| 序号 | 项目        | 期末金额(元)      |
|----|-----------|--------------|
| 1  | 交易保证金     |              |
| 2  | 应收证券交易清算款 |              |
| 3  | 应收利息      | 7,310,056.69 |
| 4  | 应收申购款     |              |
| 5  | 待摊费用      | 57,297.34    |
|    | 合计        | 7,367,354.03 |

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2006年9月30日。

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<br>增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 基金合同生效之日至<br>2006年9月30日 | 0.64%      | 0.01%         | 0.79%          | 0.01%             | -0.15% | 0.00% |

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

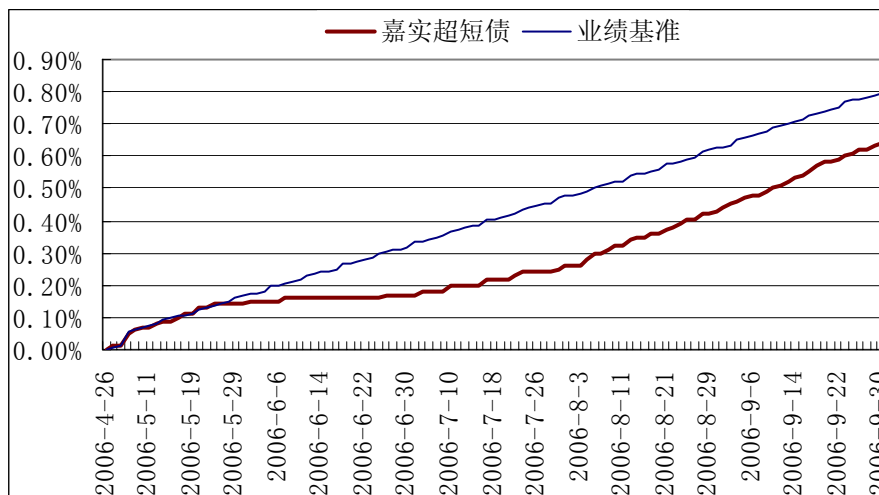


图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2006年9月30日)

注 1: 本基金合同于 2006 年 4 月 26 日生效, 截至报告期末本基金合同生效未满一年。

注 2: 报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定:

(1) 基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和, 不超过该证券的10%; (2) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年, 债券回购到期后不展期; (3) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%; (4) 投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年; (5) 持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%; (6) 投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%, 投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%; (7) 中国证监会规定的其他比例限制。

### 十三、基金的财产

#### (一) 基金财产构成

本基金基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### (二) 基金财产的帐户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户, 与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （三）基金财产的保管与处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产估值

### （一）估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

本基金合同生效后，每工作日对基金财产进行估值。本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的银行存款、各类有价证券和应收款项以及其他投资等资产。

### （四）估值方法

1、基金持有的银行存款以本金列示，逐日计提利息；

2、基金持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息；

3、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日净价收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的净价收盘价估值；

4、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值；

5、在银行间债券市场交易的债券及未上市债券按摊余成本法估值, 即估值对象以买入成本列示, 按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价, 在其剩余期限内平均摊销, 每日计提收益;

6、为了避免采用上述 1—5 方法计算的基金资产净值与按市场利率、市场报价和交易市价评估的基金资产净值发生偏离, 从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果, 基金管理人于每一估值日, 采用市场利率、市场报价和交易价格, 对基金持有的估值对象进行重新评估, 即确定“影子定价”。

影子定价的确定方法是: 对于本基金投资对象中, 符合货币市场基金许可投资的品种, 按照货币市场基金影子价格确定方法确定影子价格; 对于本基金投资对象中的其他品种, 基金管理人和托管人将根据市场利率、市场报价和交易市价等共同确定其影子价格。本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告中说明各类债券的估值方法, 使投资者能够了解其估值方法的运行原理或机制。在相关机构认可的第三方机构对债券报价的情况下, 本基金采用该报价作为影子价格。

7、当影子定价确定的基金资产净值与采用上述 1—5 方法计算的基金资产净值偏离达到或超过 0.5%时, 或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时, 将强制按照影子价格对基金资产进行估值。具体的强制调整程序如下:

(1) 根据基金管理人和托管人共同确定的影子价格, 基金管理人确定当天组合中持有的摊余成本法估值与影子价格偏离超过 0.5%的个券名单, 将其影子价格作为该债券当天的估值。并结合 1~5 对基金资产重新进行估值, 确定“强制调整后的基金资产净值”。

(2) 基金管理人将当天组合中所持有的摊余成本法估值与影子价格偏离超过 0.5%的个券名单、及其摊余成本估值和影子价格、强制调整后的基金资产净值, 以书面形式报给基金托管人;

(3) 基金托管人按照《基金合同》复核无误后, 签章返回给基金管理人;

(4) 对上述强制调整名单中的债券, 将其成本强制调整为当天的影子价格, 在此基础上继续进行摊余成本估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的方法估值;

9、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

3、基金管理人按本条（四）估值方法中的第8项、第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

4、因基金份额净值计算错误给投资人造成损失的，基金份额持有人有权要求基金管理人、基金托管人予以赔偿，具体处理原则、方式适用本招募说明书第十九条“差错处理”的规定。

- 5、如果法律、法规、规章及中国证监会另有规定的，从其规定。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

- 1、基金收益包括：基金投资所得利息收入、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。
- 2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。
- 3、基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

- 1、基金收益分配采用现金方式。投资人可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过 0.001 元的前提下，本基金每个月应将至少 90%的可分配收益进行分红。每年分红次数不超过 20 次；
- 7、基金合同生效不满三个月，收益可不分配。
- 8、法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，按有关法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

### （五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值转为基金份额。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1. 基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金销售服务费；
- （4）基金的证券交易费用；
- （5）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- （8）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

#### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （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 0.41% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.41% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.41\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前十个工作日内从基金财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 0.14% 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 0.14% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.14\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### （3）基金的销售服务费

基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况，确保其用于约定的用途。在通常情况下，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月的前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人相应支付给基金销售机构。

（4）本条第（一）款第 4 至第 8 项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。

### 3. 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财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### 4. 基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费、销售服务费，经中国证监会核准后公告。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1. 基金认购费

（1）认购费率：0

（2）认购份数的计算公式：

本基金的面值为每份基金份额人民币1.00元, 认购份额的计算方法如下:

本金认购份额=认购金额/基金份额面值

利息认购份额=认购期利息/基金份额面值

认购份额=本金认购份数+利息认购份数

其中: 认购份数保留至0.01份基金份额, 小数点后两位以后舍去。多笔认购时, 按上述公式进行逐笔计算。

## 2. 基金申购费

(1) 申购费率: 0

(2) 申购份数的计算公式:

申购份额=申购金额÷基金份额净值

申购份数保留至小数点后两位, 小数点后两位以下舍去, 舍去部分所代表的资产计入基金财产。

## 3. 基金赎回费

(1) 赎回费率: 0

(2) 赎回金额的计算公式:

赎回金额=赎回份额×基金份额净值

赎回金额保留至小数点后两位, 小数点后两位以下舍去, 舍去部分所代表的资产计入基金财产。

## 4. 基金转换费

(1) 转换费率和转换的计算公式

基金转换费由基金份额持有人承担, 基金转换费率和转换的计算公式由基金管理人另行公告。

(2) 基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率, 调整后的基金转换费率在《更新的招募说明书》中列示。上述费率如发生变更, 基金管理人还应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种指定的信息披露媒体公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)或在特定时间段进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

## (三) 基金税收

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。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
3. 会计制度按国家有关的会计制度执行。
4. 本基金独立建账、独立核算。
5. 本基金会计责任人为基金管理人。
6. 基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 十八、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同等有关规定。本基金信息披露事项应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一）基金募集信息披露

### 1. 招募说明书

基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人应当在基金份额发售的三日前,将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上。

### 2. 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

### 3. 基金合同、基金托管协议

基金管理人、基金托管人应当在基金份额发售的三日前将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

### 4. 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### 5. 更新招募说明书

基金合同生效后,基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的十五日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

## (二) 基金运作信息披露

### 1. 基金净值公告

(1) 本基金基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

(2) 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(3) 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### 2. 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

### 3. 基金定期报告

### (1) 基金年度报告

基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

### (2) 基金半年度报告

基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

### (3) 基金季度报告

基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

### 4. 基金份额30日年化净值增长率公告

基金管理人自 2006 年 11 月 14 日起新增披露本基金每个开放日基金份额“30 日年化净值增长率”，计算公式为：

$$\left( \left( \prod_{i=1}^k NAV_{t(i)-1} / NAV_{t(i)-1}^* \right) \times (NAV_n / NAV_{t(k)}^*) - 1 \right) \times \frac{365}{30} \times 100\%$$

其中，k 表示计算日前三十日内分红总次数；

$NAV_{t(i)-1}$  表示第 i 次分红前一工作日基金份额净值；

$NAV_{t(i)}^* = NAV_{t(i)-1} - D(i)$  等于第 i 次分红前一工作日基金份额净值—第 i 次分红基金份额分红金额；

$NAV_{t(0)}^*$  表示计算日前第 30 个公历日基金份额净值；

$NAV_n$  表示计算日基金份额净值。

注：当 k=0 时，令

$$\prod_{i=1}^k NAV_{t(i)-1} / NAV_{t(i)-1}^* = 1$$

本基金 30 日年化净值增长率采取四舍五入方式保留小数点后三位，每个基金开放日由基金管理人计算并经基金托管人中国银行股份有限公司复核无误后进行公告。

基金管理人可以根据市场反映自行决定停止披露 30 日年化净值增长率；或当有更好、更合理的计算方式或指标时，若被基金管理人采用将另行公告并报中国证监会备案。

### （三）基金临时信息披露

#### 1. 临时报告与公告

本基金在运作管理过程中，发生以下可能对基金份额持有人权益及基金份额的交易价格产生重大影响的事项之一时，基金管理人或/及托管人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告。

- （1）基金份额持有人大会的召开；
- （2）提前终止基金合同；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- （7）基金募集期延长；
- （8）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- （9）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- （10）基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- （11）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- （12）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- （13）基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- （14）重大关联交易事项；
- （15）基金收益分配事项；
- （16）管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （17）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- （18）基金改聘会计师事务所；
- （19）变更基金份额发售机构；
- （20）基金更换注册登记机构；
- （21）基金开始办理申购、赎回；
- （22）基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

- (23) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

## 2. 基金份额持有人大会事项的公告

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项未履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

## 3. 澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，基金管理人或/及基金托管人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

## （四）信息披露文件的存放与查阅

本基金招募说明书（包括更新招募说明书）、基金合同、年度报告、半年度报告、季度报告、基金资产净值公告、临时公告等公告文本存放于基金管理人或/及基金托管人或/及基金代销机构的办公场所和营业场所，投资人可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述公告文本的复印件。

投资人也可直接在基金管理人或/及基金托管人的网站查阅相关的信息披露文件。

基金管理人或/及基金托管人保证存放文本的内容与所公告的内容完全一致。

# 十九、风险揭示

## （一）市场风险

本基金所投资的各种固定收益工具因受到经济、政治、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

### 1. 政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致证券市场价格波动而产生风险。

## 2. 利率风险

利率风险主要是指因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的风险。利率直接影响着债券的价格和收益率。本基金主要投资对象包括债券、票据和银行存款等，其收益水平直接受到利率波动的影响，利率波动可能导致本基金跌破面值，在利率波动时本基金的净值波动一般会高于货币市场基金。但本基金投资组合久期控制在一年以内，通过组合久期的调控，可以很大程度地规避利率变动导致的风险。

## 3. 再投资风险

债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

## 4. 信用风险

信用风险主要指债券、票据发行主体信用状况可能恶化而可能产生的到期不能兑付的风险。

### （二）管理风险

1. 在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2. 基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

流动性风险主要是指因基金资产变现的难易程度所导致基金资产净值变动的风险。本组合的主要投资对象货币市场工具的流动性相对较好，但是在特殊市场情况下(如加息或市场资金紧张的情况下)也会出现部分品种的交投不活跃、成交量不足的情形，此时如果基金赎回量较大，可能因流动性风险的存在导致基金资产净值出现波动。另外，基金管理人为提高基金的收益，通常会使用回购的方法，较高比例的回购会降低基金资产的流动性，此时如果基金赎回量较大，可能导致基金现金支付出现困难。

### （四）本基金特有的风险

#### 1. 机会成本风险

由于本基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金过多而带来的机会成本风险。

#### 2. 估值风险

本基金持有的银行间债券市场交易的债券及未上市债券采用摊余成本法估值，可能在一

定时期内高估或低估基金资产的净值。

#### （五）其他风险

1. 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
2. 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
3. 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
4. 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
5. 因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金代销机构等机构无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回无法按正常时限完成的风险；
6. 其他风险。

## 二十、差错处理

### （一）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### （二）差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定和本《基金合同》的约定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿。本《基金合同》的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

（1）基金管理人对估值差错承担责任。如基金管理人的估值结果与基金托管人复核结果不一致，且基金托管人的估值数据正确，则基金托管人对此估值差错不承担责任；若基金

托管人的估值数据也不正确，则基金托管人应承担部分未正确履行复核义务的责任；

(2) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失有差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(3) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(4) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(5) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(6) 如果因基金管理人估值错误造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人复核错误造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人或基金托管人负责向差错方追偿；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### (三) 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，基金管理人应要求基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- (5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

### (四) 特殊情形的处理

- 1、基金管理人按第十三条第(四)款估值方法中的第8项条款、第9项条款进行估值

时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 二十一、基金合同的终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情形之一的，经中国证监会批准后基金合同终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止；
2. 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
3. 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二）基金财产的清算

基金合同终止，应当按照法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 1、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。基金财产清算组在中国证监会的监督下进行清算。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

基金财产清算组在成立后五个工作日内应当公告。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产清算剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组作出的基金财产清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会批准并公告。

### 6、清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十二、基金合同内容摘要

### （一）前言

1、订立嘉实超短债证券投资基金基金合同（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则。

- （1）订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范嘉实超短债证券投资基金（以下简称“本基金”）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。

## （2）订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、2004年6月29日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和2004年6月25日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定。

## （3）订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

2、本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关规定募集，并经中国证监会批准。中国证监会对本基金募集的批准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证投资于本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

3、本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得本基金基金份额，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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

4、现行法规变更引起本基金合同事项变更，或者相关事项变更对持有人权利或权益无不利影响，经基金管理人和托管人协商，并经监管机关批准，可以不召开持有人大会对本合同进行修改。

## （二）基金管理人的权利与义务

### 1. 基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）运用基金财产；
- （3）自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
- （5）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- （6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
- （13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- （14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- （15）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （16）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- （17）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、

赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

## 2. 基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(3) 办理基金备案手续；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记帐，进行证券投资；

(6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制中期和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

(17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

- (18)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
- (19)组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;;
- (21)基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- (22)国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **1. 基金托管人的权利**

- (1) 安全保管基金财产;
- (2) 获得基金托管费;
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作,如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的,不予执行并向中国证监会报告;
- (4) 在基金管理人职责终止时,提名新的基金管理人;
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人,如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- (7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### **2. 基金托管人的义务**

- (1) 安全保管基金财产;
- (2) 设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
- (3) 按规定开设基金财产的资金帐户和证券帐户;
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
- (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整和独立;

- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **(四) 基金份额持有人的权利与义务**

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

##### **1. 基金份额持有人的权利**

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

- (7) 监督基金管理人的投资运作；

- (8) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2. 本基金每份基金份额享有同等的其他合法权益。

### 3. 基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；

- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

- (3) 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；

- (6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### (五) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、有以下事由情形之一的, 应当召开基金份额持有人大会:

- (1) 提前终止基金合同；

- (2) 转换基金运作方式；

- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

- (4) 更换基金管理人、基金托管人；

- (5) 变更基金类别；

- (6) 变更基金投资目标、范围或策略；

- (7) 变更基金份额持有人大会程序；

- (8) 本基金与其它基金合并；

- (9) 法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

#### 4、召集方式

- (1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- (2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。  
基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

(4) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报国务院证券监督管理机构备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 投票委托书送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- (1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- (2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- (3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；
- (4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
- (5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 7、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

①议事内容限为本条前述第（五）款第2项条款规定的基金持有人大会召开事由范围内的的事项。

②基金管理人、基金托管人、代表基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

③对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

④单独或合并持有权益登记日基金总份额10%或以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

⑤基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### （2）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### ① 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之

二) 通过。

② 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上(含百分之五十)通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或提前终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

9、计票

(1) 现场开会

① 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表,如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人,则监督员由基金托管人担任;如基金托管人为召集人,则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人担任监票人。

② 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

③ 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

④在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下,如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的,则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照投资基金法有关规定表决通过的事项,召集人应当自通

过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等项目的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或备案后2日内，由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## **(六) 基金合同的变更和终止**

### **1. 基金合同的变更**

(1) 以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- ① 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- ② 变更基金的投资目标、投资范围、投资策略，但基金合同另有约定的除外；
- ③ 基金份额持有人大会的议事程序、表决方式和表决程序；
- ④ 其他对基金份额持有人的权利义务产生重大影响的事项。

(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

### **2. 基金合同的终止**

本基金出现下列情形之一的，经中国证监会批准后本基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- (3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

## **(七) 争议的处理**

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根

据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### （八）基金合同的存放及查阅方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构的住所查阅；投资人也可在支付一定工本费后获得本基金合同复印件或复制件，但应以基金合同正本为准。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

基金管理人（或简称“管理人”）

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 4104 室

法定代表人：王忠民

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】5 号

组织形式：中外合资经营企业

注册资本：壹亿元人民币

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983 年 10 月 31 日

批准设立机关：中华人民共和国国家工商行政管理总局

批准设立文号：1000001000134（营业执照号码）

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币壹仟捌佰陆拾叁亿玖仟零叁拾伍万贰仟肆佰玖拾柒元捌角叁分

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

① 对基金的投资范围、投资对象进行监督；

② 对基金投融资比例进行监督；

③ 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

④ 基金管理人应向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；基金托管人对银行间债券市场交易的交易方式（如见券付款、见款付券）的控制是否符合基金合同的约定进行监督；

⑤ 基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

⑥ 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

（2）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（3）基金托管人在上述第（1）、（2）项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及《基金合同》的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项

未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(4) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(5) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

## 2. 基金管理人 对基金托管人的业务核查

(1) 基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(2) 基金管理人 发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人 有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人 应报告中国证监会。

(3) 基金托管人 应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

## (三) 基金财产的保管

### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人 应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

(4) 基金托管人 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人 不得委托第三人 托管基金财产。

### 2. 基金合同生效时募集资金的验证和入帐

(1) 基金募集期满或基金管理人 宣布停止募集，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人 在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验

资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

（2）基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### 3. 基金的银行账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

（3）本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币结算银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

### 4. 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的本协议第三条所述存款银行名单中的银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

### 5. 基金证券账户和资金账户的开设和管理

（1）基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

（4）基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时相关规定或市场的通行做法办理，而限于上述关于账户开设、使用的规定。

（5）在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、

使用的规定。

#### 6. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库,但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应及时将合同正本提交给基金托管人。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。

### (四) 基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值,并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核,并在盖章后以传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(3) 当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时,基金管理人可根据具体情况,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,双方应及时进行协商和纠正。

(5) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时,视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,并采取合理的

措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

(6) 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在本基金《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### (2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### (3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 日内完成；招募说明书在本基金《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后10个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

#### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

##### **1、基金份额持有人名册的内容**

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册
- （4）每月最后一个交易日的基金份额持有人名册。

##### **2、基金份额持有人名册的提供**

对于每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

##### **3、基金份额持有人名册的保管**

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理费用给予补偿。

#### **（六）争议解决方式**

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### **(七) 基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

##### **1、托管协议的变更**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

##### **2、托管协议的终止**

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 本基金更换基金托管人；
- (3) 本基金更换基金管理人；
- (4) 发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### **3、基金财产的清算**

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## **二十四、对基金份额持有人的服务**

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

#### **(一) 资料寄送**

##### **1、账户卡**

在开户确认后的 10 个工作日内向基金份额持有人寄送账户卡。

##### **2、基金份额持有人对账单**

基金管理人在每个季度结束后的15个工作日内向基金份额持有人寄送季度对账单；每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

### 3、电子邮件寄送

基金管理人为投资者准备了《每周通讯》等系列投资理财刊物，以电子邮件形式向订阅的基金份额持有人发送。

#### （二）红利再投资

若基金份额持有人选择将基金收益以基金份额形式进行分配，该持有人当期分配所得的红利将按照红利发放日前一日的基金份额净值自动转为本基金份额，并免收申购费用。

#### （三）定期定额投资计划

基金管理人从 2006 年 6 月 30 日起推出本基金定期定额投资计划业务，投资者可通过中国银行、国泰君安证券股份有限公司等 15 家代销机构网点进行本基金定期定额申购基金份额。

#### （四）手机短信服务

基金管理人向留有手机号码的基金份额持有人提供基金交易确认、基金公告等信息服务。基金份额持有人可以拨打客户服务电话 400-600-8800、95105866 或（010）65185566 转人工，也可通过基金管理人网站留言留下手机号码，基金管理人将自动为基金份额持有人开通此项服务，或发送“DZDX+身份证件号码”，移动发送到 6295515，联通发送到 70095515。

#### （五）在线服务

通过基金管理人网站，基金份额持有人还可获得如下服务：

##### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

##### 2、信息资讯服务

投资者或基金份额持有人可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等最新资讯。

##### 3、网上交易服务

投资者可持广发理财通卡、北京银行各类银行卡、兴业银行兴业卡、农行金穗卡、建行龙卡储蓄卡和银联其他卡（银联跨行转帐业务支持的除兴业卡外的银行卡）登录本基金管理人网站办理本基金网上交易业务，实行申购费率优惠。

#### （六）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解本基金有关申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800、



95105866, 或 (010) 65185566, 传真: (010) 65182266

## 2、互联网站

公司网址: <http://www.jsfund.cn>

电子信箱: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十五、其他应披露事项

自本基金基金合同生效日 2006 年 4 月 26 日至 2006 年 11 月 15 日, 本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的临时报告如下:

| 序号 | 临时报告名称                                | 披露日期             | 备注    |
|----|---------------------------------------|------------------|-------|
| 1  | 嘉实超短债证券投资基金开放申购和赎回业务公告                | 2006 年 5 月 10 日  |       |
| 2  | 关于嘉实超短债证券投资基金开放日常基金转换业务的公告            | 2006 年 6 月 9 日   |       |
| 3  | 嘉实超短债证券投资基金分红公告                       | 2006 年 6 月 13 日  |       |
| 4  | 嘉实超短债证券投资基金分红公告的补充公告                  | 2006 年 6 月 14 日  |       |
| 5  | 关于通过中国银行开办嘉实超短债基金定期定额投资业务的公告          | 2006 年 6 月 27 日  |       |
| 6  | 关于所管理的部分证券投资基金运用基金财产投资资产支持证券的公告       | 2006 年 6 月 29 日  | 包括本基金 |
| 7  | 关于增加浦发银行为嘉实超短债、嘉实主题基金代销机构的公告          | 2006 年 7 月 17 日  |       |
| 8  | 关于增加深圳发展银行为嘉实 300 基金、嘉实超短债基金代销机构的公告   | 2006 年 7 月 26 日  |       |
| 9  | 关于旗下开放式基金通过东北证券开办定期定额投资业务的公告          | 2006 年 8 月 25 日  | 包括本基金 |
| 10 | 嘉实超短债证券投资基金 2006 年第二次收益分配公告           | 2006 年 8 月 28 日  |       |
| 11 | 关于对中国农业银行金穗卡持有人办理嘉实基金网上交易业务的公告        | 2006 年 9 月 15 日  | 包括本基金 |
| 12 | 嘉实超短债证券投资基金 2006 年第三次收益分配公告           | 2006 年 9 月 22 日  |       |
| 13 | 关于嘉实超短债基金 2006 年“十一”长假前两个工作日暂停申购业务的公告 | 2006 年 9 月 26 日  |       |
| 14 | 关于运用公司自有资金申购嘉实超短债证券投资基金的公告            | 2006 年 10 月 17 日 |       |
| 15 | 嘉实超短债证券投资基金 2006 年第四次收益分配公告           | 2006 年 10 月 26 日 |       |



|    |                                          |                  |               |
|----|------------------------------------------|------------------|---------------|
| 16 | 关于增聘嘉实超短债证券投资基金基金经理的公告                   | 2006 年 10 月 28 日 | 增聘吴洪坚任本基金基金经理 |
| 17 | 关于增加西部证券为嘉实主题、嘉实超短债基金代销机构的公告             | 2006 年 11 月 4 日  |               |
| 18 | 关于旗下开放式基金通过国泰君安证券等 13 家代销机构开办定期定额投资业务的公告 | 2006 年 11 月 4 日  | 包括本基金         |
| 19 | 关于新增披露嘉实超短债基金份额 30 日年化净值增长率的公告           | 2006 年 11 月 13 日 |               |
| 20 | 关于开通中国建设银行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告                 | 2006 年 11 月 15 日 | 包括本基金         |

## 二十六、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十七、备查文件目录

1. 中国证监会批准嘉实超短债证券投资基金募集的文件；
2. 《嘉实超短债证券投资基金基金合同》；
3. 《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《嘉实超短债证券投资基金托管协议》；
5. 法律意见书；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
7. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
8. 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**嘉实基金管理有限公司**

**2006年12月15日**