嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

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

二〇一三年四月

重要提示

本基金经2013年2月16日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可字[2013]153号）核准募集。

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。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金主要采用代表性分层抽样复制策略，本基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，同时由于本基金费用、交易成本、指数成份券取价规则和基金估值方法之间的差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，并具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

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《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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。基金投资者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：

基金或本基金	指嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金；
基金合同	指《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书	指《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
基金份额发售公告	指《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》；
托管协议	指《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国	中华人民共和国(仅为本招募说明书目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)；
中国证监会	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》	指2011年6月9日由中国证监会公布并于2011年10月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》	指2004年6月29日由中国证监会公布、于2012年6月19日修订并同日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》	指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
深交所《业务细则》	指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本；
交易型开放式指数证券投资基金	指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金"，即是指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券、现金等基金合同约定的对价进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易；
ETF联接基金	指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金；
元	指人民币元；
基金管理人	指嘉实基金管理有限公司；
基金托管人	指中国银行股份有限公司；
登记结算业务	指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》(包括对该文件不时修改或更新的版本)定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务；
登记结算机构	指办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司；
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者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；
个人投资者	指依据中国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
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于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者	指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会	指按照基金合同第十部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
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3个月；
基金合同生效日	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和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；
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日	指深圳证券交易所的正常交易日；
认购	指在基金募集期内，投资者按照基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购	指在基金合同生效后的存续期间，投资者按照基金合同和招募说明书申请购买本基金基金份额的行为；
赎回	指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件申请将其持有的本基金基金份额兑换为基金合同约定的对价资产的行为；
申购赎回清单	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价	投资者申购基金份额时，按招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
赎回对价	基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
标的指数	中证指数有限公司编制并发布的中证金边中期国债指数及其未来可能发生的变更；
组合证券	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
最小申购赎回单位	本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍；
现金替代	申购或赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
现金差额	最小申购赎回单位的资产净值与按当日估值全价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
预估现金部分	由基金管理人计算并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结；
指令	指基金管理人在管理基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商(代办证券公司)；
销售机构	指基金管理人及本基金代销机构；
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；
发售代理机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；
申购赎回代理券商	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司；
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或其他媒体；
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T日	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n日	指T日后(不包括T日)第n个工作日，n指自然数；
收益评价日	指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日；
基金净值增长率	收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；
标的指数同期增长率	收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；
基金资产总值	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
基金资产估值	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
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；
不可抗力	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律及政策变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

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	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	安奎
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	付 强

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

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。

公司目前下设股票投资部、固定收益部、定量投资部、指数投资部、机构投资部、现金管理部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务团队、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、信息技术部、基金运营部、登记结算部、财务部、人力资源部、行政管理部等部门。

股票投资部、固定收益部、机构投资部、定量投资部、指数投资部、现金管理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。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程绩效考核。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。机构业务团队主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。渠道发展部、营销策划部、电子商务部、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。信息技术部、基金运营部、登记结算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管理工作。人力资源部、行政管理部负责公司企业文化建设、招聘、薪酬福利、激励和考核、人员培训和发展、人事档案、行政性后勤管理和服务等。

3.管理基金情况

截止2012年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、37只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券型发起式等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券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、特定客户资产投资组合。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

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

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理，副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Wolfgang Matis先生，董事，德国籍，法兰克福商学校经济专业（Frankfurt Business School of Economics）。曾任德意志银行全球固定收益负责人、全球市场负责人，董事总经理（MD）。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员、CEO兼发言人。

Mark Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD。

韩家乐先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

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

汤欣先生，独立董事，中共党员。1998年至2000年为北京大学法学院博士后研究人员、授课教师，曾任中国证监会并购重组审核委员会第一、二届委员，2000年至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学商法研究中心副主任、法学院副教授。

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

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

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

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，历任督察长和公司副总经理。

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

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

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。

2、基金经理

杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有12年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部门经理，2003年3月15日至2004年7月7日任万家（原天同）180指数证券投资基金基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司指数投资部总监。2005年8月29日至今任嘉实沪深300ETF联接（LOF）（原嘉实沪深300指数(LOF)）基金经理，2012年3月22日至今任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理、2012年5月7日至今任嘉实沪深300ETF、2013年2月5日至今任嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）基金经理、2013年2月6日至今任嘉实中证500ETF基金经理、2013年3月22日至今任嘉实中证500ETF联接基金经理。

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、公司副总经理戴京焦女士，总经理助理詹凌蔚先生、总经理助理邵健先生、股票投资部总监刘天君先生、机构投资部总监党开宇女士、资深基金经理陈勤先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会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、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、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

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；

（下转B22版）

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

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

二〇一三年四月

重要提示

1、嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会证监许可[2013]153号文批准。

2、本基金是交易型开放式、债券型指数证券投资基金。

场内简称：国债ETF；场外简称：嘉实中证中期国债ETF；基金代码：159926。

3、本基金的管理人为嘉实基金管理有限公司(以下简称"本公司")，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

5、本基金自2013年4月17日至2013年5月3日通过本公司的直销中心和代销机构的网点公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。其中，网上现金认购的日期为2013年4月17日至2013年5月3日，通过基金管理人进行网下现金认购为2013年4月17日至2013年5月3日，通过发售代理机构进行网下债券认购的日期为2013年4月17日至2013年5月3日，基金管理人可根据募集情况适当缩短本基金的募集期限并及时公告。

6、本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理。

7、本基金管理人办理网下现金认购。

8、网下债券发售代理机构为：广州证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中航证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、国联证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、江海证券有限公司、日信证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中原证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司。

9、投资者欲认购本基金，需具有深圳证券交易所A股账户（以下简称"深圳A股账户"）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称"深圳证券投资基金账户"）。

10、本基金以认购份额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率最高不超过0.4%。

11、网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)；通过发售代理机构办理网下债券认购的，单只债券最低认购申报张数为100张，超过100张的部分须为10张的整数倍，用以认购的债券必须是中证金边中期国债成份券和已公告的备选成份券。投资者可以多次提交认购申请，累计申报张数不设上限。

12、本基金不设募集目标上限。

13、网上现金认购可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下债券认购申报一经确认，认购债券即被冻结。网下现金认购、网下债券认购申请提交后不得撤销。

14、投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

15、投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

16、销售网点(包括直销中心和代销网点)和/或网上交易系统对申请的受理并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点和/或网上交易系统确实收到了认购申请。申请是否成功应以登记结算机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点和/或网上交易系统查询最终成交确认情况和认购的份额。

17、本公告仅对嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在2013年4月12日《证券时报》的"嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书"。

18、本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.jsfund.cn)。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金发售相关事宜。

19、各发售代理机构办理认购业务的营业网点、办理日期和时间等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

20、基金管理人可综合各种情况对基金份额的发售安排做适当调整。本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

21、对未开设销售网点的地区的投资者，请拨打本公司的客户服务电话（010）85712266，或者全国统一客户热线400-600-8800（免长途话费）咨询购买事宜。

22、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，报深圳证券交易所，经有关部门认可后，由深圳证券交易所公告。本基金上市后，未登记在申购赎回代理券商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖，如投资者需进行本基金的申购赎回交易，须转托管到本基金的申购赎回代理券商。

23、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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

24、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。

25、基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

26、风险提示

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金主要采用代表性分层抽样复制策略，本基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，同时由于本基金费用、交易成本、指数成份券取价规则和基金估值方法之间的差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，并具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

一、本次基金募集基本情况

(一)基金名称

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金

场内简称：国债ETF；场外简称：嘉实中证中期国债ETF；基金代码：159926。

(二)基金运作方式和类型

交易型开放式、债券型。

(三)基金存续期限

不定期。

(四)基金的认购份额面值、认购价格

每份基金份额初始面值为1.00元，按初始面值发售。

(五)基金投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%，年跟踪误差不超过3%。

(六)标的指数及业绩比较基准

中证金边中期国债指数。

(七)募集目标

本基金不设募集规模上限。

(八)发售对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

(九)基金份额发售机构

1、网上现金发售代理机构

投资者可通过以下具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务(排序不分先后)：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所开放式基金销售系统办理本基金的认购业务。具体名单可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

2、网下现金发售机构：

嘉实基金管理有限公司。

3、网下债券认购发售代理机构(以下排序不分先后)：

(1) 广州证券有限责任公司

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

(2) 海通证券股份有限公司

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

(3) 申银万国证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市常熟路171号		
法定代表人	储晓明	联系人	李清怡
电话	(021)54033888	传真	(021)54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(21) 962505

(4) 宏源证券股份有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街19号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010)88085858	传真	(010)88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

(5) 国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼		
法定代表人	曾小普	联系人	徐美云
电话	(0791)86285337	传真	(0791)86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

(6) 光大证券股份有限公司

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

(7) 中航证券有限公司

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

(8) 中信建投证券股份有限公司

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

(9) 长城证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华	联系人	李春芳
电话	(0755)83516089	传真	(0755)83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755)33680000

(10) 东莞证券有限责任公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
法定代表人	张运勇	联系人	苏卓仁
电话	(0769)22112062	传真	(0769)22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(769) 961130

(11) 华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街8号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层		
法定代表人	丁之锁	联系人	陶颖
电话	(010)58568040	传真	(010)58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	(10) 58568118

(12) 新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	(010)83561149	传真	(010)83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

(13) 齐鲁证券有限公司

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

(14) 招商证券股份有限公司

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

(15) 国联证券股份有限公司

住所地址	江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层		
办公地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702		
法定代表人	雷建辉	联系人	沈刚
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	95570

(16) 国都证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(17) 华宝证券有限责任公司

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

(18) 国信证券股份有限公司

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

(19) 兴业证券股份有限公司

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

(20) 国海证券股份有限公司

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

(21) 中国中投证券有限责任公司

住所地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元		
办公地址	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	4000 8008

(22) 方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	雷杰	联系人	郭军瑞
电话	(0731)85832503	传真	(0731)85832214
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

(23) 中信证券股份有限公司

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

（下转B24版）

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利

（1）分享基金资产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金资产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开或自行召集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）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）缴纳基金认购款项和认购债券、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）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；

（5）不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

（6）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（7）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（8）遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；

（9）法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金资产；

（3）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，获得基金管理费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

（4）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

（5）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。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资产、其他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，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（6）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和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（7）自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算机构进行必要的监督和检查；

（8）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；

（9）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、融券；

（10）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

（11）按照法律法规，代表基金行使因投资于证券所产生的权利；

（12）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（13）依据法律法规和基金合同的规定，召集、召开基金份额持有人大会；

（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、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；

（15）法律法规、基金合同规定的其他权利。

4、基金管理人的义务

（1）依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会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）办理基金备案手续；

（3）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资产；

（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资产；

（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，保证所管理的基金资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、分别记账，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资产；

（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）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购价格、申购对价、赎回对价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、赎回对价；

（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、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的对价；

（16）保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（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）组织并参加基金资产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）因违反基金合同导致基金资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资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

5、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（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）法律法规、基金合同规定的其他权利。

6、基金托管人的义务

（1）安全保管基金资产；

（2）设立专门的基金托管部门，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，负责基金资产托管事宜；

（3）按规定开设基金资产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；

（5）对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整和独立；

（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、账册、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）根据法律法规及本合同的约定，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、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；如果基金管理人有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）保管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；

（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对价；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

（18）因违反基金合同导致基金资产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

（19）因基金管理人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（A）本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（B）鉴于本基金和本基金的联接基金（即"嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金"，以下简称"联接基金"）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金《基金合同》的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召集或召开本基金的基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召集或召开本基金份额持有人大会。

（C）有以下情形之一时，基金管理人，或基金托管人，或单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）基金份额的基金份额持有人有权按照基金合同的约定提议召集或自行召集基金份额持有人大会：

1、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（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；

7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

8、本基金与其他基金合并；

9、终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；

10、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的基金合同变更等其他事项；

11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会审议决定的事项。

（D）尽管有前述第（C）款所列情形，但如属于以下情形之一的，则不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率；

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、调低赎回费率或变更收费方式；

3、因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当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实质性变化；

5、对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、基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

7、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。

（E）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10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60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、单独或合计代表基金份额10%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10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60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表基金份额10%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10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60日内召开。

4、单独或合计代表基金份额10%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，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

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。

（F）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天在指定媒体上公告。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、议事程序和表决方式；

3、代理投票授权委托证明送达时间和地点；

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，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见的提交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（I）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会方式、通讯开会方式，或法律法规和监管机关允许的其他方式。会议的召开方式由会议召集人确定。

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；会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码或企业法人营业执照号码（事业单位法人证书编号）、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）及其身份证号码或企业法人营业执照号码（事业单位法人证书编号）和联系方式等事项。通讯开会指按照基金合同的相关规定以通讯方式进行表决。

1、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证明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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%（含50%，下同）以上。

2、在同时符合以下条件时，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表决意见；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

（4）直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，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证明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。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在25个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（G）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（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计持有基金份额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做出决定。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做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）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后2个工作日内在大会聘请的公证机关的公证员的公证下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。

（H）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50%（含50%）以上通过。

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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的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，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

（J）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代表(如果基金管理人为召集人，则由基金托管人的授权代表担任；如基金托管人为召集人，则由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任计票人；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代表担任计票人。

（2）计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）如果大会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；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会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，大会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计票人进行计票。

（5）计票过程应由律师现场见证，召集人也可聘请公证机构现场监督。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

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：

由大会召集人授权的两名计票人在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人。

（K）生效与公告

1、基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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决议。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后依照《信息披露管理办法》的有关规定，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体上公告。

4. 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（L）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到0.1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配12次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5、本基金收益分配采取现金方式；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。

截至收益评价日基金净值增长率减去业绩比较基准同期增长率的差额超过0.1%时，基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到0.1%以上时，以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、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，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按《信息披露办法》的有关规定向中国证监会备案并公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。

（五）收益分配中发生的费用

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。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

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0.3%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0.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.3%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

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

H=E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、基金合同生效后的指数许可使用费

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

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

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

（下转B24版）