嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2013年8月5日
公告日期:2013年7月31日

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
登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司

一、重要声明与提示

《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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”)管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所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上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细阅读刊登在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》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站(www.jsfund.cn)。

二、基金概览

1. 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
2. 基金类型:债券型
3. 基金运作方式:交易型开放式
4. 基金场内简称:国债ETF
5. 基金代码:159926
6. 标的指数简称:中证金边中期国债指数
7. 标的指数代码:H01017
8. 基金份额总额:
截至2013年7月29日,本基金的基金份额总额为7,082,698.00份。
9. 基金份额净值:
截至2013年7月29日,本基金的基金份额净值为99.354元。
10. 本次上市交易的基金份额:7,082,698.00份
11. 上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
12. 上市交易日期:2013年8月5日
13. 基金管理人:嘉实基金管理有限公司
14. 基金托管人:中国银行股份有限公司
15. 登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司
16. 申购赎回代理券商:中信证券股份有限公司

三、基金份额的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况
1. 基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2013】153号
2. 基金合同生效日:2013年5月10日
3. 运作方式:交易型开放式
4. 基金合同期限:不定期
5. 发售日期:2013年4月17日至2013年5月3日。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。
6. 发售价格:1.00元人民币
7. 份额发售方式:场内、场外认购
8. 发售机构:
1)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。
2)本基金管理人办理网下现金认购。
3)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、中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、财通证券有限责任公司、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、中国国际证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。
9. 验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
10. 募集资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为641,870,000.00元人民币(含所募集债券市值),认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计23,704.00元人民币。本次募集所有资金已于2013年5月9日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立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托管专户。

本次募集有效认购户数为682户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计641,893,704.00份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。
11. 本基金募集备案情况:本基金于2013年5月10日验资完毕,2013年5月10日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2013年5月10日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。
12. 基金合同生效日:2013年5月10日
13. 基金合同生效日的基金份额总额:641,893,704.00份。
14. 基金的折算
根据《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》、《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》的有关规定,嘉实基金管理有限公司确定2013 年7月18日为嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

本基金折算前基金份额总额为708,273,704.00份,折算前基金份额净值为0.998元,根据《嘉实基金管理有限公司关于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折算的公告》中的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为7,082,698.00份,折算后基金份额净值为99.846元。

本基金的登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司于2013年7月19日进行了本基金基金份额的变更登记。折算后的基金份额计算至整数位,小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。折算后的基金份额以本基金登记结算机构最终确认的数据为准。
(二)本基金日常申购、赎回情况
本基金已于2013年6月19日起开放申购,并于2013年6月24日起暂停申购。基金管理人在重新接受申购日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(三)本基金上市交易的主要内容
1. 基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上【2013】255号
2. 上市交易日期:2013年8月5日
3. 上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4. 基金场内简称:国债ETF
5. 基金交易代码:159926
6. 本次上市交易份额:7,082,698.00份
7. 未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有情况
截至2013年7月29日,本基金持有人户数为2,233户,平均每户持有的基金份额为3,171.83份。
截至2013年7月29日,机构投资者持有的基金份额为6,230,923.00份,占基金总份额的比例为87.97%;个人投资者持有的基金份额为851,775.00份,占基金总份额的比例为12.03%。
(二)基金份额前十名持有人情况
截至2013年7月29日,前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额比例(%)
1	招商证券股份有限公司	1,000,029.00	14.12%
2	华泰证券股份有限公司	500,020.00	7.06%
3	国泰君安证券股份有限公司	500,014.00	7.06%
4	海通证券股份有限公司	500,014.00	7.06%
5	光大证券股份有限公司	500,009.00	7.06%
6	东海证券-招行-东海证券金盾双利2号集合	497,500.00	7.02%
7	华西证券-建行-华西证券融诚2号集合资产	450,007.00	6.35%
8	中航证券-浦发-中航金航5号集合资产管理	400,005.00	5.65%
9	华安证券固定收益	300,008.00	4.24%
10	华林证券有限责任公司	300,001.00	4.24%
合计		4,947,607.00	69.86%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1.公司概况
名称:嘉实基金管理有限公司
法定代表人:安奎
总经理:赵学军
注册资本:1.5亿元人民币
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
设立批准文号:中国证监会证监基字[1999]5号
工商登记注册的法人营业执照文号:100000400011239
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理及中国证监会许可的其他业务
成立日期:1999年3月25日
2.股东及其出资比例:中诚信托有限责任公司40%,立信投资有限责任公司30%,德意志资产管理(亚洲)有限公司30%。
3.内部组织结构及职能
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。
4.人员情况
截至2013年6月30日,我公司共有459名员工,其中博士学位21人、硕士学位232人、学士学位198人、其他8人。
5.信息披露负责人:胡勇钦
咨询电话:010-65215588
6.基金管理业务情况
截止2013 年6月28 日,基金管理人共管理2 只封闭式证券投资基金、47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、嘉实稳健混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实多增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300 ETF 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、嘉实周优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400 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、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF 联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)。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。
7.本基金基金经理简介
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15 年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理、2003 年3 月15 日至2004 年7 月7 日任万家(原天同)180 指数证券投资基金基金经理、2004 年7 月加入嘉实基金管理有限公司,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、2013年5月10日起任嘉实中证金边中期国债ETF及其联接基金基金经理。
(二)基金托管人
1.公司概况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币或什荣佰玖拾壹亿肆什柒佰贰拾贰万叁什壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:(010)66594855
传真:(010)66594942
2. 基金托管部门及主要人员情况
中国银行于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,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,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务,托管资产规模居同业前列。
(三)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
法定代表人:杨经信
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
经办注册会计师:许康玮、金毅
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产列支,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金2013年7月29日资产负债表(未经审计)如下:

资 产	期末 2013年7月29日
资 产:	
银行存款	10,949,481.11
结算备付金	2,833,529.41
存出保证金	–
交易性金融资产	683,763,700.00
其中:股票投资	–
基金投资	–
债券投资	683,763,700.00
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	–
应收利息	6,448,283.93
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	703,994,994.45
负债和所有者权益	**期末 2013年7月29日**
负 债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	169,091.84
应付托管费	56,363.96
应付销售服务费	–
应付交易费用	4,965.93
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	72,263.28
负债合计	302,685.01
所有者权益:	
实收基金	708,273,704.00
未分配利润	–4,581,394.56
所有者权益合计	703,692,309.44
负债和所有者权益总计	703,994,994.45

八、基金投资组合

截至2013年7月29日,嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下:
(一)期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	683,763,700.00	97.13
	其中:债券	683,763,700.00	97.13
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	13,783,010.52	1.96
6	其他资产	6,448,283.93	0.92
	合计	703,994,994.45	100.00

(二)期末按行业分类的股票投资组合
2013年7月29日,本基金未持有股票。
(三)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
2013年7月29日,本基金未持有股票。
(四)期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	683,763,700.00	97.17
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
	合计	683,763,700.00	97.17

(五)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101308	国债1308	3,500,000	341,558,000.00	48.54
2	101313	国债1313	2,400,000	233,971,200.00	33.25
3	101303	国债1303	1,100,000	108,234,500.00	15.38

2013年7月29日,本基金仅持有上述3只债券。
(六)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
2013年7月29日,本基金未持有资产支持证券。
(七)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
2013年7月29日,本基金未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1.2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年7月29日本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
2.本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
3.2013年7月29日其他资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,448,283.93
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	
	合计	6,448,283.93

4.期末持有的处于转股期的可转换债券明细
2013年7月29日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
2013年7月29日,本基金未持有股票。

九、重大事件揭示

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已于2013年5月10日正式生效,基金管理人于2013年5月11日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登《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生效公告》。
嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金已于2013年6月19日起开放申购,并于2013年6月24日起暂停申购,基金管理人在重新接受申购日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露
所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。
(一)中国证监会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募集的文件;
(二)《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》;
(三)《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》;
(四)《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》;
(五)《关于嘉实基金管理有限公司募集设立嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书》;
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;
(八)中国证监会要求的其他文件。

嘉实基金管理有限公司
2013年7月31日

附件: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权利和益;
(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,进行正确投资;
(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,编制申购赎回清单;
(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