嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016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

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")根据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)的核准公开发售。本基金基金合同于2013年5月10日正式生效,自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年5月10日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元		
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层		
法定代表人	邓红国		
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	胡勇钦		

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

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

(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

邓红国先生,董事长,硕士研究生,中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长;中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员;中国银监会银行监管三部副主任、四部主任;中诚信托有限责任公司董事长、党委书记,法定代表人。2014年12月2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。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁,美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士,董事,硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010年11月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。

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

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

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

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,法学博士,清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编,汤姆森路透集团"中国商法"丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

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。

龚康先生,监事,中共党员,博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部,历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师集团(北京)事务所证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部,现任法律部总监。

宋振韬女士,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。

王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生,副总经理,硕士研究生。历任国泰证券行业研究员,国泰君安证券行业研究部副经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生,副总经理,工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监,南方证券金通证券部总经理助理,南方基金运作部副总监,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

(1)现任基金经理

曲扬女士,经济学硕士,毕业于中央财经大学信息系,具有11年证券从业经验。2004年至2007年,任中信基金固定收益研究员、交易员;2007年至2010年6月,任中国光大银行债券自营投资业务副主管;2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理。2011年11月18日起至2012年11月21日任嘉实稳固收益债券基金经理。2011年11月18日至今任嘉实债券基金经理。2012年12月11日至今任嘉实纯债债券基金经理。2013年5月21日至今任嘉实丰益纯债定期债券基金经理。2014年4月18日至今任嘉实稳固收益债券基金经理。2016年3月30日至今任嘉实新财富混合、嘉实新起航混合基金经理。2016年3月18日至今任嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券基金经理。2016年4月26日至今任嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合基金经理。2016年5月17日至今任嘉实稳丰纯债债券基金经理。2015年4月18日至今任嘉实中证中期企业债指数、嘉实中证金边中期国债ETF联接和本基金基金经理。

王亚洲先生,3年证券从业经验。曾任国泰基金管理有限公司债券研究员,2014年6月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部任研究员。具有基金从业资格,中国国籍。2015年7月9日至今任嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证金边中期国债ETF联接和本基金基金经理。

(2)历任基金经理

裴晓辉先生于2014年6月20日至2015年4月18日任本基金基金经理;杨宇先生于2013年5月10日至2014年6月20日任本基金基金经理。

3、债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,债券投资决策委员会的成员包括:公司固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系资深基金经理王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及投资经理王怀霓先生、嘉实国际CIO Thomas Kwan先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管部门信息披露联系人:王永民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2016年03月31日,中国银行已托管446只证券投资基金,其中境内基金416只,QDII基金30只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.申购赎回代办券商

1)国泰君安证券股份有限公司

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

2)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

3)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

4)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或按打各城市营业网点咨询电话

5)华泰证券股份有限公司

办公地址	江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场		
注册地址	江苏省南京市建邺区江东中路228号		
法定代表人	周易	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	025-51863323(南京) 0755-82492962(深圳)
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

6)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

7)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	刘阳
电话	0755-83516289	传真	0755-83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666688,0755)33680000

8)光大证券股份有限公司

住所,办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	021-22169999	传真	021-22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788,10108998

9)东海证券股份有限公司

办公地址	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦		
注册地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	朱科敏	联系人	王一彦
电话	021-20333910	传真	021-50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

10)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

11)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

2.二级市场交易代办证券公司

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二级市场交易。

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:0755-25941405

传真:0755-25987132

联系人:丁志勇

经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:李丹

电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:张勇

经办注册会计师:许康玮、张勇

四、基金的名称

本基金名称:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

债券型、交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资,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%。

七、基金的投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的80%。

此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于衍生工具(国债期货)、其他债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

八、基金的投资策略

本基金主要采用代表性分层抽样复制策略,投资于标的指数中具有代表性的成份券及备选成份券,或选择非成份券作为替代,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及交易惯例等情况,通过"久期匹配"、"信用等级匹配"、"期限匹配"等优化策略可其成份券个数、权重和券种间将存在差异。此外,本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资,以弥补基金费用、增加基金收益。

(A)资产配置策略

为实现最优跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值80%的资产投资于标的指数成份券和备选成份券。本基金将采用抽样复制法,主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及交易惯例等情况,进行抽样优化调整,以实现对标的指数的有效跟踪。

(B)债券投资策略

本基金通过分层抽样复制法进行被动式指数化投资,在力求控制跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,如"久期匹配"、"信用等级匹配"、"期限匹配"等优化策略对基金资产进行调整,降低交易成本,以期在规定的风险承受限度之内,尽量控制跟踪误差最小化。

1、债券投资组合的构建

本基金由标的指数成份券和备选成份券构建组成。构建原则如下:

1)投资标的以分层抽样配置标的指数成份券为目标;并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入;

2)当遇到包括但不限于成份券流动性不足、法律法规禁止本基金投资于相关券种、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例、基金规模太大或太小导致投资管理受到市场流动性和个券发行量的影响等情况,及预期标的指数成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据相关市场情况,对个券权重和券种进行适当调整,或部分投资于备选成份券,以期在规定的风险承受限度之内,控制跟踪误差。

2、债券投资组合的调整

1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份债券的调整而进行相应调整。

2)不定期调整

a)基金管理人将基于久期、权重、信用等级、期限分布匹配的基础上,综合考虑样本券流动性、交易规模等因素,对债券投资组合进行动态抽样调整,以期实现对标的指数的有效跟踪。

b)若成份券遇到包括但不限于退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

3、替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求及其他特殊市场情况,基金管理人在标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求的情况下,可综合考虑以下原则在成份券及备选成份券外寻找成份券替代券构建替代组合。构建替代组合的方法如下:

1)按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则,在其他可投资标的中选择成份券替代券库;

2)采用成份券替代券库中的各券过去较长一段时间的历史数据,分析其与被替代债券的相关性,选择正相关度较高的债券进一步考察;

3)分析上述债券的流动性,综合流动性和相关度两个指标挑选替代券,从而使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

4、债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势,我们将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整,如"久期匹配"、"信用等级匹配"、"期限匹配"等。

1)久期匹配

"久期匹配"策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标,从而使得在收益率曲线平行移动的情况下,债券投资组合和标的指数走势一致。

2)信用等级匹配

"信用等级匹配"是指以投资组合各信用等级权重与标的指数权重相一致为目标、力争实现基金组合各信用等级债券权重与标的指数分布相匹配,减少信用等级错配的跟踪误差。

3)期限匹配

"期限匹配"是指衡量各个期限的债券权重,力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配,减少期限利差变动造成的跟踪误差。

5、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制和对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理方,决定投资品种。本基金基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

(C)衍生品投资

基金衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征,以便更好地实现基金的投资目标。本基金将主要投资于国债期货,持有金融衍生工具风险敞口的绝对总额不得超过基金资产的5%。基金的衍生品投资只能用于风险对冲而不能用于投机。

未来,如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数、标的指数成份券或构成基金组合的其他非成份券相关的各种衍生工具,如远期、掉期、期权、期货等,以及其他投资品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围,并更新和丰富基金投资策略。

(D)其他品种

未来,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在依法履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围,并更新和丰富基金投资策略。

九、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为:中证金边中期国债指数。

十、基金的风险收益特征

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。本基金为指数型基金,主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现,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。

十一、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。

本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2016年4月15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2016年3月31日("报告期末"),本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	388,813,128.00	92.42
	其中:债券	388,813,128.00	92.42
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	24,000,000.00	5.70
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,614,784.56	0.38
8	其他资产	6,282,645.13	1.49
	合计	420,710,557.69	100.00

注:债券投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

4. 报告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	388,813,128.00	92.56
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(可交换债)	-	-
8	回业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	388,813,128.00	92.56

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	150026	15附息国债26	1,200,000	122,208,000.00	29.09
2	150019	15附息国债19	700,000	71,876,000.00	17.11
3	101526	国债1526	700,000	71,288,000.00	16.97
4	150007	15附息国债07	500,000	52,445,000.00	12.48
5	150002	15附息国债02	210,400	21,881,600.00	5.21

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1)

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(2)

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,040.01
3	应收股利	-
4	应收利息	6,279,605.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	6,282,645.13

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-3.57%	0.15%	-6.08%	0.15%	2.51%	0.00%
2014年度	8.09%	0.16%	5.63%	0.12%	2.46%	0.04%
2015年度	4.95%	0.13%	3.84%	0.10%	1.11%	0.03%
2016年1月1日至2016年3月31日	1.25%	0.12%	0.67%	0.07%	0.58%	0.05%

2.自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实中证中期国债ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月10日至2016年3月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同"第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制"的有关约定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的基金的指数使用费;

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

5、基金合同生效后的信息披露费用;

6、基金上市费及年费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金合同生效后的会计师费和律师费;

9、基金资产的资金汇划费用;

10、按照法律法规和基金合同规定可以列入的其他费用。

(二)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0.3%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日的资产净值乘以0.3%的费率来计算,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。

在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提,按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币25,000元,计费区间不足一季度的,以一季度计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

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。

4、上述"(一)与基金运作有关的费用"中4至10项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(四)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及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资产的损失等不列入基金费用。

(五)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(六)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,应按国家税收法律法规的规定履行其纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:

1.在"重要提示"部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在"三、基金管理人"部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在"四、基金托管人"部分:更新了基金托管人的相关信息。

4.在"九、基金份额的申购、赎回"部分:更新了申购赎回清单的基本信息。

5.在"十一、基金的投资"部分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

6.在"十二、基金的业绩"部分:基金业绩更新至2016年一季度末。

嘉实基金管理有限公司
2016年6月23日

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金2016年第二次收益分配公告

公告送出日期:2016年6月23日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强信用定期债券
基金主代码	000005
基金合同生效日	2013年3月8日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金招募说明书》等。
收益分配基准日	2016年6月7日
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值(单位:元) 1.031
	基准日基金可供分配利润(单位:元) 20,359,834.98
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额(单位:元) 0.01260
本次分红方案(单位:元/10份基金份额)	0.1260
有关年度分红次数的说明	本次分红为2016年的第二次分红

注:(1)截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额为每份基金份额应分配金额0.01260元,即每10份基金份额应分配金额0.1260元;(2)本次分红方案为每10份基金份额发放红利0.1260元。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年6月27日
除息日	2016年6月27日
现金红利发放日	2016年6月28日
分红对象	权益登记日在本公司登记在册的本基金份额持有人
红利再投资相关事项的说明	投资者选择红利再投资方式的,现金红利转换为基金份额的基金份额净值基准日为2016年6月27日,基金份额登记过户日为2016年6月28日。红利再投资的基金份额可赎回起始日为本基金的下一个开放日。
税收相关事项的说明	根据国家相关规定,基金向投资者分配的基金收益,暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本次分红免收分红手续费; 选择红利再投资方式的投资者,其现金红利所转换的基金份额免收申购费用。

3 其他需要提示的事项

(1)本次收益分配公告已经本基金托管人中国工商银行股份有限公司复核。

(2)因本次分红导致基金净值变化,不会改变本基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

(3)如果投资者未选择具体分红方式,本公司注册登记系统将其分红方式默认为现金方式,投资者可通过查询了解本基金目前的分红设置状态。

(4)投资者可以在基金开放日的交易时间内到本基金销售网点修改分红方式。本次分红方式将按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准。投资者可以到销售网点