

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更新招募说明书摘要

[illegible]

十一、基金投资组合报告

基金管理人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。

本基金投资于国内依法发行的国债、股票、权证等资产,投资于2014年10月21日披露了本报告中的资产配置情况,净值表现和组合报告内容内,保证投资组合中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年10月20日(报告期末),本报告中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	67,499,890.39	90.71
3	固定收益投资	1,802,913.40	2.43
	其中:债券	1,802,913.40	2.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
--	-------------------	---	---

8	其他资产	168,294.54	0.23
	合计	74,314,288.59	100.00

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

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	1,802,913.40	2.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他		

8	其他	-	-
	合计	1,802,913.40	2.47

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

2	101403	国债1403	8,300	844,027.00	1.15
---	--------	--------	-------	------------	------

注:报告期末,本基金仅持有上述1项债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实中证中期国债ETF	债券型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	67,490,890.39	92.19

10. 报告期内, 本基金未参与股指期货交易。

11. 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。

12. 股指期货投资情况附注
(1) 报告期内本基金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, 没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	102,502.00
2	应收证券清算款	28,290.85
3	应收股利	-

5	应收申购款	798.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

(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、基金的投资
基金管理人依照恪尽职守、诚信信用、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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年5月10日(基金合同生效日)~2013年12月31日	-2.25%	0.13%	-5.78%	0.14%	3.53%	-0.01%

2014年上半年	4.37%	0.12%	3.21%	0.10%	1.16%	0.02%
2014年1月1日至2014年9月30日	5.37%	0.11%	3.33%	0.09%	2.04%	0.02%

嘉实中证金边中期国债ETF联接C

2013年5月10日(基金合同生效日)~2013年12月31日	-2.46%	0.13%	-5.78%	0.14%	3.32%	-0.01%
2014年上半年	4.20%	0.12%	3.21%	0.10%	0.99%	0.02%

2.自基金合同生效以来基金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	
嘉实中证金边中票国债ETF跟踪A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	
2020年	

图1: 嘉实中证金中期国债ETF跟踪A基金份额累计净值增长率与同期中证金中期国债ETF基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月10日至2014年9月30日)

图 2: 嘉实中黄金中期国债 RCTF 联接 C 基金自发行以来净值增长与同期国债比较净值收益的历史走势对比图

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关费用

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)销售服务费；

(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

(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) 基金资产的资金汇费；
(9) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
2. 基金管理人计提基金托管费的方法和支付方式

H = $\max\{0.3\%, \text{当年天数} \times \text{每日应计提的基金托管费}\}$
 为每日应计提的基金托管费
 H 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分, 若为负数, 则取0。
 基金托管费每日计提, 按月支付。经基金管理人及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
 本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标

H 为每日应计提的基金托管费
 R 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的余额部分;若为负数,则R取0
 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的余额部分;若为负数,则R取0
 基金托管人于每月提,按月支付。经基金管理人及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) 销售服务费
 本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.3%。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下:

[illegible]

4.基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调整基金管理费、基金托管费和销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。
(二)与基金销售有关的费用
1.申购费和赎回费
(1)本基金A类基金份额收取申购费用、赎回费;C类基金份额从本基金基金资产中计提销售服务费,不收取申购费用,但对持有期少于30日的本类基金份额的赎回收取赎回费。
(2)本基金A类基金份额申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资人在一天之内如有多笔申购

偏离度的	中购金额(含中购费)	中购费率
	M<50万元	0.5%
	50万元≤M<100万元	0.4%
	100万元≤M<200万元	0.3%

资产净值的	200万元 ≤ M < 500万元	0.2%
（取低，可 收益类资	M ≥ 500万元	单笔 1000元

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

(3) 本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的0.75%，随持有期限的增加而递减。

A类份额的具体赎回费率如下：

市场交易 的 投资目 于风险	<365天	0.1%
	365天 ≤ M < 730天	0.05%
	≥ 730天	0

C类份额的具体赎回费率如下：

M<30天	0.75%
M≥30天	0

本基金的前端费用由基金份额持有人承担,其中A类基金份额的前端费用25%的部分计入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关支出。对于持有期少于30天的基金份额持有人收取的前端费用计入基金财产。

4.基金管理人可以在符合法律法规规定的范围内调整申购费率和赎回赎回费。费率如发生变更,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

[illegible]

四十四、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》及相关法律法规的要求，结合本基金管理人在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：明确了最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“基金份额持有人服务”部分：更新了基金持有人的相关信息。
3.在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。

级市场
金投信
中国证
券基金

机构相关信息。
5. 在“十、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“十一、基金的业绩”部分,基金业绩更新至2014年三季度末。
7. 在“二十六、其他应披露事项”部分:列示了本基金自2014年5月10日至2014年11月10日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2014年12月23日