华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝添益
基金主代码	511990
交易代码	511990
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月27日
报告期末基金份额总额	21,148,546.00份
投资目标	保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	1.久期策略：基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限，把握买卖时机。 2.收益率曲线策略：收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，将预期到的变动资本化。 3.类属配置策略：类属配置策略主要实现两个目标：一是通过类属配置满足基金流动性需求，二是通过类属配置获得投资收益。 4.套利策略：基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。 5.逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致的短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。 6.现金流管理策略：投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法，加强流动性管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：本基金份额净值为100元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日－2013年9月30日)
1. 本期已实现收益	21,363,765.26
2.本期利润	21,363,765.26
3.期末基金资产净值	2,114,854,600.20

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

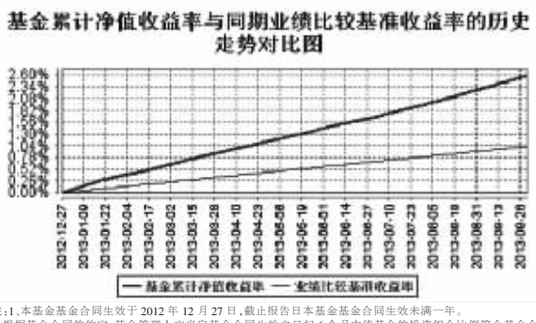
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9115%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.5712%	0.0019%

注：基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2012年12月27日至2013年9月30日)



注：1、本基金基金合同生效于2012年12月27日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至2013年6月27日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈昕	本基金基金经理、华宝兴业现金宝货币基金经理、华宝兴业中证短融50债券基金基金经理	2012年12月27日	-	9年	经济学学士，2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易，投资工作，2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理，2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理，2012年6月起兼任华宝兴业中证短融50债券基金基金经理，2012年12月起兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金管理暂行规定》、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，现金添益交易型货币基金在短期内出现过存放在具有托管资格的同一商业银行存款占净值比超过30%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年3季度国内经济增长有所反弹，通胀持续温和，资金紧张的情况逐月改善。宏观和货币政策保持稳定，央行采取锁长放短的形式维持长期资金略偏紧的格局，利率市场化进程持续。由于国内出口反弹，美国QE退出预期影响减弱，外汇占款增长较多，资金面大为改善。债券市场有较大幅度的下跌，利率债、信用债收益率均大幅上升。这一轮债券的下跌，除了基本面上经济指标超预期好转导致市场风险偏好上升之外，更直接的原因是在利率市场化大背景下，市场资金利率持续上升，对固定收益资产价格带来负面影响。相对而言，由于久期较短，且受到资金面好转的利好，短融跌幅相对较小。

报告期内本基金通过既定策略对标的指数进行有效跟踪，整体运行状况良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩比较基准收益率为1.12%，基金表现落后业绩基准0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度以来的经济回升势头在四季度恐难持续，但目前经济运行情况还是在中央容忍度之内，调结构的政策方向还将持续，CPI会有季节性上升，但总体温和，央行仍将维持货币市场紧平衡，3季度末以来资金面总体较为缓和的局面会持续，但在资金成本偏高的情况下金融机构之间资金链仍然较为脆弱，发生结构性资金紧张的可能性仍较大。4季度股市有望持续活跃，IPO若重新开闸也将对交易所资金产生负面影响，债券收益率的上升带来配置价值，目前短期限金融债的收益率已经是历史较高水平，短融的收益率分化进一步显著，4季度起会有较好的配置机会。

本基金目前仍将致力于做好流动性管理，防范可能出现的结构性资金紧张情况，控制好组合的剩余期限，在此基础上谨慎寻求债券的配置机会。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	780,718,647.63	35.23
	其中：债券	780,718,647.63	35.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,418,460,233.88	64.01
4	其他资产	16,849,359.38	0.76
5	合计	2,216,028,240.89	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.67	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	99,349,650.97	4.70
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定："本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	13.35	4.70
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	60.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	14.67	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.99	4.70

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,820,412.20	8.55
	其中：政策性金融债	180,820,412.20	8.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	599,898,235.43	28.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	780,718,647.63	36.92
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	1,000,000	100,806,699.91	4.77
2	041360012	13厦门轻工CP001	600,000	60,036,990.08	2.84
3	041358005	13银继集CP001	500,000	50,112,997.45	2.37
4	130210	13国开10	500,000	50,020,433.58	2.37
5	041359033	13苏豪CP002	400,000	40,050,858.13	1.89
6	041354020	13新希望CP001	400,000	39,885,698.82	1.89
7	041259081	12武商资CP002	300,000	30,048,896.94	1.42
8	041359011	13新旅游CP001	300,000	30,041,959.21	1.42
9	041366002	13华阳经贸CP001	300,000	30,028,176.47	1.42
10	041364009	13天山水泥CP001	300,000	30,025,962.58	1.42

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0235%
报告期内偏离度的最低值	-0.1689%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1021%

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法，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，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.8.2

本报告期内，本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.4 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	应收利息	16,834,359.06
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	15,000.32
7	其他	-
8	合计	16,849,359.38

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,658,324.22
报告期期间基金总申购份额	19,572,544.92
减：报告期期间基金总赎回份额	23,082,323.14
报告期期末基金份额总额	21,148,546.00

注：本基金基金合同生效于2012年12月27日。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后基金份额净值为100元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2013年8月8日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，公司总经理裴长江先生因个人原因，自2013年7月31日起不再担任总经理职务，由黄小薏女士代任。

2、2013年9月27日，基金管理人发布高级管理人员任职公告，黄小薏女士自2013年9月24日起正式担任公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同；

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书；

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2013年10月24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联接基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:2013年10月24日

§1 重要提示

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2013年10月22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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接	
基金主代码	000087	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月10日	
报告期末基金份额总额	730,346,718.75份	
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，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0.3%，年跟踪误差不超过4%。	
投资策略	在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖，本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。	
业绩比较基准	中证金边中期国债指数x95%+银行活期存款利率(税后)x5%	
风险收益特征	本基金为嘉实中期国债ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中期国债ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证金边中期国债指数及嘉实中期国债ETF的表现密切相关。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基金、混合基金，高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接A	嘉实中证金边中期国债ETF联接C
下属两级基金的交易代码	000087	000088
报告期末下属两级基金的份额总额	639,024,686.53份	91,322,032.22份

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金主代码	159926
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年5月10日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年8月5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	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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%。
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"等优化策略对基金资产进行抽样化调整，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。
业绩比较基准	中证金边中期国债指数
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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日－2013年9月30日)	
	嘉实中证金边中期国债ETF联接A	嘉实中证金边中期国债ETF联接C
1.本期已实现收益	-2,282,158.33	-152,047.76
2.本期利润	-4,967,199.85	-803,270.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0042
4.期末基金资产净值	638,214,704.94	91,095,155.43
5.期末基金份额净值	0.9987	0.9975

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接A收取认(申)购费，嘉实中证金边中期国债ETF联接C不收取认(申)购费但计提销售服务费。(3)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

嘉实中证金边中期国债ETF联接A

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
过去三个月	-0.68%	0.12%	-2.68%	0.13%	2.00%	-0.01%

嘉实中证金边中期国债ETF联接C

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
过去三个月	-0.76%	0.12%	-2.68%	0.13%	1.92%	-0.01%

3.2.2 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

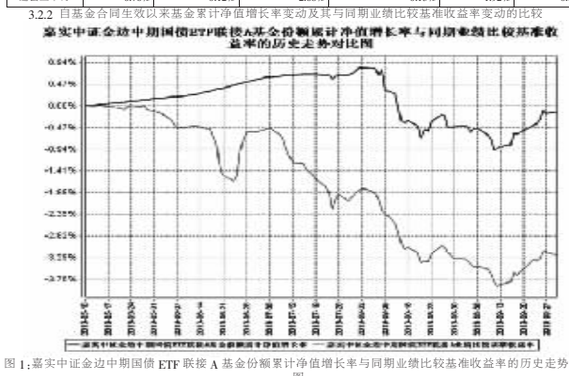


图1：嘉实中证金边中期国债ETF联接A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月10日至2013年9月30日)

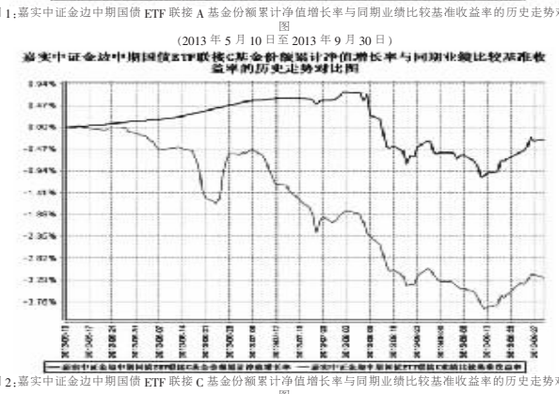


图2：嘉实中证金边中期国债ETF联接C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月10日至2013年9月30日)

注：本基金基金合同生效日2013年5月10日至报告期末未满1年，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"第十四部分(二)投资范围和(八)投资禁止行为与限制"的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实中创400ETF及其联接基金、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接基金、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证中期国债ETF基金经理、公司指数投资部总监	2013年5月10日	-	15年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家(天同)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金A类日均跟踪误差为0.11%，年度化拟合偏离度为1.74%，C类日均跟踪误差为0.11%，年度化拟合偏离度为1.73%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.3%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实中证金边中期国债ETF联接A基金份额净值为0.9987元，本报告期基金份额净值增长率为-0.68%；截至报告期末嘉实中证金边中期国债ETF联接C基金份额净值为0.9975元，本报告期基金份额净值增长率为-0.76%；同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为嘉实中证金边中期国债ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中证金边中期国债ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证中期国债指数的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1 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	658,694,251.22	89.34
3	固定收益投资	27,987,432.00	3.80
	其中：债券	27,987,432.00	3.80
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	50,017,431.86	6.78
7	其他资产	627,562.13	0.09
	合计	737,326,677.21	100.00

5.2 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。

5.3 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。

5.4 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	27,987,432.00	3.84
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	27,987,432.00	3.84

5.5 报告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	119,200	11,382,408.00	1.56
2	130013	13附息国债13	100,000	9,679,000.00	1.33
3	101313	国债1313	43,600	4,206,528.00	0.58
4	101303	国债1303	16,400	1,580,796.00	0.22
5	101315	国债1315	11,800	1,138,700.00	0.16

5.6 报告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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告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

报告期末，本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	240,276.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	386,186.63
5	应收申购款	1,098.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	627,562.13

5.11.4 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。

5.11.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证金边中期国债ETF联接A	嘉实中证金边中期国债ETF联接C
报告期期初基金份额总额	874,403,119.42	466,900,316.14
报告期期间基金总申购份额	125,641.93	529,095.00
减：报告期期间基金总赎回份额	235,504,074.82	376,107,378.92
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	639,024,686.53	91,322,032.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)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联接基金募集的文件；

(2)《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基金合同》；

(3)《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招募说明书》；

(4)《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托管协议》；

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6)报告期内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公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2013年10月24日

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24日

§1 重要提示

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2013年10月22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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝短融50
基金主代码	240021
交易代码	240021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
报告期末基金份额总额	26,870,321.78份
投资目标	本基金通过指数化投资，实现对标的指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为以中证短融50指数成份券为基础的被动式指数基金，采用最优复制法，综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素构建投资组合，并根据基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券市场交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以力争对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	95%*中证短融50指数收益率+5%*银行活期存款(税后)收益率
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混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日－2013年9月30日)
1.本期已实现收益	147,308.22
2.本期利润	310,599.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0091
4.期末基金资产净值	27,792,177.48
5.期末基金份额净值	1.034

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	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
过去三个月	0.78%	0.04%	1.12%	0.03%	-0.34%	0.01%

3.2.2 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

(2012年6月12日至2013