

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
基金合同生效日:2014年3月26日
重要提示: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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益。

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 年度 报告摘要

保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合独立确定交易要素,交易后按价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

(基金合同生效日)至2013年12月31日。
7.4.1.2 记账本位币
本基金的记账本位币为人民币。

Table with 2 columns: 2.1 基本情况, 2.2 基金产品说明. Includes fund name, code, and investment objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人, 2.4 基金托管人. Lists management and custody details.

Table with 2 columns: 2.5 主要会计数据和财务指标. Lists key financial metrics for 2013.

Table with 2 columns: 3.1 期间数据和指标. Lists performance data for 2013.

Table with 2 columns: 3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比. Compares fund performance to benchmark.

Table with 2 columns: 3.3 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.4 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.5 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.6 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.7 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.8 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.9 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.10 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.11 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.12 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.13 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.14 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.15 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.16 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.17 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.18 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.19 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.20 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.21 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

Table with 2 columns: 3.22 基金管理人报告. Management's report on fund performance.

Table with 2 columns: 3.23 基金投资组合报告. Details the fund's asset allocation.

3.2 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行证监会《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,各投资组合投资管理流程和决策,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会。

3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,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%,合计10次,均为旗下指数基金或ETF因被动跟踪标的指数的需要而与其他基金发生反向交易,但不存在利益输送行为。

4.4 报告期内对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
本基金2013年5月10日基金合同生效,2013年8月5日在深圳交易所上市及开放日常申购、赎回业务。
本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.1%,年化拟合偏离度为1.63%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过0.25%的要求。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
本基金的投资策略:本基金作为一只投资于中证中期国债指数的被动投资产品,我们将继续秉承指数化被动投资策略,积极进行基金申购赎回的计价以及基金费用支付等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.7 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.8 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.9 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.10 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.11 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.12 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.13 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.14 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.15 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.16 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.17 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.18 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.19 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.20 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.21 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.22 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.23 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.24 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.25 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.26 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.27 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.28 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.29 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

4.30 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况的说明
本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在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(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了托管人职责。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对本基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计价以及基金费用支付等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本报告期内基金信息内容的真实、准确和完整发表意见
本报告期内,本托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的约定,对本基金管理人提供的基金信息进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.5 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.6 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.7 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.8 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.9 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.10 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.11 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.12 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.13 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.14 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.15 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.16 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.17 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.18 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.19 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.20 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.21 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.22 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.23 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.24 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.25 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.26 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.27 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.28 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

5.29 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值,基金托管人复核。月末、年中和本年度估值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值经基金会计账目核对一致后进行。

报告期内(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日),本基金未持有股票。
8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细
报告期内(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日),本基金未持有股票。
8.3 买入/卖出股票的成本及卖出股票的收入总额
报告期内(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日),本基金未持有股票。
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio composition with columns for 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 10 assets by value with columns for 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.7 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
报告期内,本基金未持有资产支持证券。
8.8 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贵金属投资明细
报告期内,本基金未持有贵金属投资。
8.9 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
报告期内,本基金未持有权证投资。
8.10 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股指期货投资情况
报告期内,本基金未参与股指期货投资。
8.11 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国债期货投资情况
报告期内,本基金未参与国债期货交易。
8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。
8.12.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。
8.12.3 期末其他各项资产构成

Table showing other assets with columns for 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期内,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期内,本基金未持有股票。

9 基金份额持有人信息
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table showing holder structure with columns for 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

Table showing target assets with columns for 项目, 持有份额(份), 占基金份额比例

Table showing top 10 holdings with columns for 序号, 名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例

注:机构投资者“持有份额”和“占基金份额比例”数据中包含“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”的“持有份额”和“占基金份额比例”数据。
9.2 期末上市基金前十名持有人

Table showing top 10 holders with columns for 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例

9.3 期末基金管理人从关联方处持有基金份额的情况
报告期内,基金管理人从关联方持有基金份额的情况

11.1 基金份额持有人大会决议
11.2 基金管理人、基金托管人的“基金托管部”的重大人事变动
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
11.4 基金投资策略的改变
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
11.7 基金租用证券交易席位的情况

Table showing securities transactions with columns for 券商名称, 交易数量, 成交金额, 债券回购交易, 应付债券利息

7.4.4.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.4.5 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
7.4.4.6 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing related party transactions with columns for 关联方名称, 持有基金份额, 持有的基金份额占基金总份额比例

7.4.4.5 由关联方保障的银行存款余额及当期产生的利息收入
7.4.4.6 由关联方保障的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table showing related party transactions with columns for 关联方名称, 本期, 上期

注:本基金银行存单由基金托管人中国银行托管,按银行同业利率计息。
7.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销的情况
7.4.4.7 本基金在承销期间参与关联方承销的情况
7.4.4.8 本基金在承销期间参与关联方承销的情况

7.4.5.1 因认购2013年12月31日,本基金持有的流通受限证券
7.4.5.2 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.3 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.5 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.6 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.7 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.8 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.9 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.10 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.11 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.12 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.13 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.14 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.15 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.16 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.17 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.18 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.19 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.20 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.21 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.22 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.23 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.24 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.25 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.26 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.27 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.28 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.29 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.30 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.31 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.32 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.4.5.33 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.34 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.35 期末持有的处于转股期的可转换债券
7.4.5.36 期末持有的处于转股期的可转换债券