

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19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2014年7月16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。

本报告期内未发生基金份额持有人申购赎回行为,基金资产净值未发生变动。

Table with 3 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额持有人户数, 基金管理人, 基金托管人

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)

Table with 2 columns: 指标名称, 数值

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,本期利润为本报告期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2.2 本基金合同生效以来基金资产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

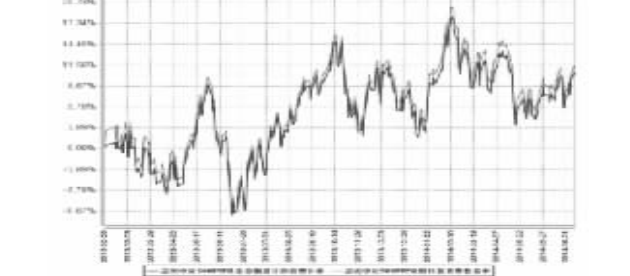


图:嘉实中证 500ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2013年2月6日至2014年6月30日)

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“第十四部分(二)投资范围(七)投资限制”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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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及基金合同的约定,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,各项投资组合投资管理流程和流程独立决策,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,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 3 次,均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

4.3.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.6 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.7 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.8 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.9 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.10 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.11 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.12 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.13 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.14 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.15 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.16 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.17 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.18 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.19 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.20 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.21 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.22 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.23 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.24 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.25 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.26 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.27 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.28 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.29 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.30 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.31 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.32 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.33 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.34 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.35 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.36 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.37 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.38 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.39 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.40 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.41 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.42 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.43 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.44 报告期内基金的投资策略和运作分析

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19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2014年7月16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。

本报告期内未发生基金份额持有人申购赎回行为,基金资产净值未发生变动。

Table with 3 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额持有人户数, 基金管理人, 基金托管人

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)

Table with 2 columns: 指标名称, 数值

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,本期利润为本报告期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2.2 本基金合同生效以来基金资产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 500ETF 联接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2月6日至2014年6月30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“第十四部分(二)投资范围(七)投资限制”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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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及基金合同的约定,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,各项投资组合投资管理流程和流程独立决策,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,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 3 次,均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

4.3.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

4.6 报告期内基金投资策略和运作分析

4.7 报告期内基金投资策略和运作分析

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析

4.9 报告期内基金投资策略和运作分析

4.10 报告期内基金投资策略和运作分析

4.11 报告期内基金投资策略和运作分析

4.12 报告期内基金投资策略和运作分析

4.13 报告期内基金投资策略和运作分析

4.14 报告期内基金投资策略和运作分析

4.15 报告期内基金投资策略和运作分析

4.16 报告期内基金投资策略和运作分析

4.17 报告期内基金投资策略和运作分析

4.18 报告期内基金投资策略和运作分析

4.19 报告期内基金投资策略和运作分析

4.20 报告期内基金投资策略和运作分析

4.21 报告期内基金投资策略和运作分析

4.22 报告期内基金投资策略和运作分析

4.23 报告期内基金投资策略和运作分析

4.24 报告期内基金投资策略和运作分析

4.25 报告期内基金投资策略和运作分析

4.26 报告期内基金投资策略和运作分析

4.27 报告期内基金投资策略和运作分析

4.28 报告期内基金投资策略和运作分析

4.29 报告期内基金投资策略和运作分析

4.30 报告期内基金投资策略和运作分析

4.31 报告期内基金投资策略和运作分析

4.32 报告期内基金投资策略和运作分析

4.33 报告期内基金投资策略和运作分析

4.34 报告期内基金投资策略和运作分析

4.35 报告期内基金投资策略和运作分析

4.36 报告期内基金投资策略和运作分析

4.37 报告期内基金投资策略和运作分析

4.38 报告期内基金投资策略和运作分析

4.39 报告期内基金投资策略和运作分析

4.40 报告期内基金投资策略和运作分析

4.41 报告期内基金投资策略和运作分析

4.42 报告期内基金投资策略和运作分析

4.43 报告期内基金投资策略和运作分析

4.44 报告期内基金投资策略和运作分析

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19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2014年7月16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。

本报告期内未发生基金份额持有人申购赎回行为,基金资产净值未发生变动。

Table with 3 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额持有人户数, 基金管理人, 基金托管人

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)

Table with 2 columns: 指标名称, 数值

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,本期利润为本报告期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2.2 本基金合同生效以来基金资产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:嘉实中证金边中期国债 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2014年6月30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(七)投资限制行为与限制”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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

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守了《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,各项投资组合投资管理流程和流程独立决策,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,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 3 次,均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

4.3.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

4.6 报告期内基金投资策略和运作分析

4.7 报告期内基金投资策略和运作分析

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析

4.9 报告期内基金投资策略和运作分析

4.10 报告期内基金投资策略和运作分析

4.11 报告期内基金投资策略和运作分析

4.12 报告期内基金投资策略和运作分析

4.13 报告期内基金投资策略和运作分析

4.14 报告期内基金投资策略和运作分析

4.15 报告期内基金投资策略和运作分析

4.16 报告期内基金投资策略和运作分析

4.17 报告期内基金投资策略和运作分析

4.18 报告期内基金投资策略和运作分析

4.19 报告期内基金投资策略和运作分析

4.20 报告期内基金投资策略和运作分析

4.21 报告期内基金投资策略和运作分析

4.22 报告期内基金投资策略和运作分析

4.23 报告期内基金投资策略和运作分析

4.24 报告期内基金投资策略和运作分析

4.25 报告期内基金投资策略和运作分析

4.26 报告期内基金投资策略和运作分析

4.27 报告期内基金投资策略和运作分析

4.28 报告期内基金投资策略和运作分析

4.29 报告期内基金投资策略和运作分析

4.30 报告期内基金投资策略和运作分析

4.31 报告期内基金投资策略和运作分析

4.32 报告期内基金投资策略和运作分析

4.33 报告期内基金投资策略和运作分析

4.34 报告期内基金投资策略和运作分析

4.35 报告期内基金投资策略和运作分析

4.36 报告期内基金投资策略和运作分析

4.37 报告期内基金投资策略和运作分析

4.38 报告期内基金投资策略和运作分析

4.39 报告期内基金投资策略和运作分析

4.40 报告期内基金投资策略和运作分析

4.41 报告期内基金投资策略和运作分析

4.42 报告期内基金投资策略和运作分析

4.43 报告期内基金投资策略和运作分析

4.44 报告期内基金投资策略和运作分析

4.45 报告期内基金投资策略和运作分析

4.46 报告期内基金投资策略和运作分析

4.47 报告期内基金投资策略和运作分析

4.48 报告期内基金投资策略和运作分析

4.49 报告期内基金投资策略和运作分析

4.50 报告期内基金投资策略和运作分析

4.51 报告期内基金投资策略和运作分析

4.52 报告期内基金投资策略和运作分析

4.53 报告期内基金投资策略和运作分析

4.54 报告期内基金投资策略和运作分析

4.55 报告期内基金投资策略和运作分析

4.56 报告期内基金投资策略和运作分析

4.57 报告期内基金投资策略和运作分析

4.58 报告期内基金投资策略和运作分析

4.59 报告期内基金投资策略和运作分析

4.60 报告期内基金投资策略和运作分析

4.61 报告期内基金投资策略和运作分析

4.62 报告期内基金投资策略和运作分析

4.63 报告期内基金投资策略和运作分析

4.64 报告期内基金投资策略和运作分析

4.65 报告期内基金投资策略和运作分析

4.66 报告期内基金投资策略和运作分析