

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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 投资组合报告等内容,保证复核内容, 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉	(2) 日 \$1 重要提示 本报告所裁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 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 好存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 起壳的原则管理和应用基金资产,但不停证基金一定盈利。 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。 。
基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF) (杨内简称:中期企债)
基金主代码	160720
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2013年2月5日
报告期末基金份额总额	195.612.535.94 份

540 TF T I AL-2	100720			
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)		
基金合同生效日	2013年2月5日	2013年2月5日		
报告期末基金份额总额	195,612,535.94 份			
投资目标		过严格的投资纪律约束和数量化的风 长率与业绩比较基准之间的日均跟踪 投踪误差不超过 4%。		
投资策略	标的指数中具有代表性的部分成份 综合考虑跟踪效果,操作风险等因 日常申购赎回情况、市场流动性以 易惯例等情况,通过 久期匹配"、 策略对基金资产进行抽样化调整,	本基金为被动式指数基金。主要采用长素性分层抽样复制策略。投资于 陈的指数中具有代表性的部分液份债券。或选择丰成份债券作为替代、 综合为虚假踪效果、操作风险等因素构建组合。并根据本基金资产规模 日常年购赎回情况。市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交 易惯网等情况。通过、外那匹配"信用等级应能"期限应需"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。是控制服务课券最少化、		
业绩比较基准	中证中期企业债指数×95%+银行活	中证中期企业债指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	合基金,高于货币市场基金。本基 层抽样复制策略跟踪标的指数的表	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。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。		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	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	中国银行股份有限公司		
下属两级基金的基金简称	嘉实中证中期企业债指数 (LOF)A	嘉实中证中期企业债指数 (LOF)C		
下属两级基金的交易代码	160720	160721		
报告期末下属两级基金的份额总额	164.037.096.53 份	31.575.439.41 份		

		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)
	嘉实中证中期企业债指数 (LOF)A	嘉实中证中期企业债指数 (LOF)
1.本期已实现收益	-1,391,654.32	-291,659.12
2.本期利润	7,790,724.22	1,314,696.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0340	0.0327
4.期末基金资产净值	169,507,556.04	32,468,813.69
5.期末基金份额净值	1.0333	1.0283
本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值	收入、投资收益、其他收入(不含公允价值3 直变动收益;(2)嘉实中证中期企业债指数	

Ī	的各项费用,计/ 3.2 基金净(、费用后实际收 直表现	益水平要低于所 值增长率及其与同	动收益;(2)嘉实中 旦计提销售服务费。 引数字。 引期业绩比较基准的 中证中期企业债指		OF)A收取认(「 示不包括持有人	申)购费,嘉实中 认购或交易基金
	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	3.35%	0.08%	3.29%	0.07%	0.06%	0.01%
	嘉实中证中期企业债指数(LOF)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	3.26%	0.08%	3.29%	0.07%	-0.03%	0.01%

事实中证中则企业机务数(1.07)A基金价值累升价值增长率与问到业绩比较基準 业业本的历史业绩对长简



姓名	职务	任本基金的	任本基金的基金经理期限		说明
		任职日期	离任日期		
裴晓辉	本基金、嘉实稳固收益债券、嘉实中证中期国债 发工F及其联接基金经理	2014年6月 20日	-	8年	曾任人保健康投资部处长、国 基金固定收益总监等职务。20 年1月加入嘉实基金管理有限 司固定收益部,担任执行总监, 事投资研究工作。硕士,具有 金从业资格。
杨宇	本基金、嘉·实沪深 300ETF、嘉·实沪深 300ETF 联接 4.0F),嘉·实 中证 500ETF 及其联接、 级 4.0F),嘉·实 和 50 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18	2013年2月5日	2014年 6 月 20日	16年	曾先后担任平安保险投资管理 心基金交易室主任及大同基金万 (天同)180 指数基金经理。20 年7月加入基实基金。第20 经济学硕士,具有基金从业资格 中国国籍。

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》	去》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证中期企业债指数证
券投资基金(LOF)基金合同》和其他相关法律》	去规的规定,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 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
	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	
	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,名
	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。

- 丁。 投资回顾:本季度组合主要以调整债券持仓品种,保证跟踪误差。同时组合加大短久期债券配置,积极增强收益。 142 招生期内基金的业绩表现

	报告期末基金资产组合情况	§ 5 投资组合报告	ÚTPIENKO
序号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	-	_
	其中:股票	-	_
2	固定收益投资	227,925,000.00	95.29
	其中:债券	227,925,000.00	95.29
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
5	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买人返售金融资 产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,152,174.37	0.48
7	其他资产	10,115,758.82	4.23

	合计	239,192,933.19	100.00
报告 5.3 有 报告	设告期末按行业分类的股票投资组合 期末、本基金未持有股票。 段告期末按公允价值占基金资产净值比 期末、本基金未持有股票。 段告期末按债券品种分类的债券投资组		
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	-	-
2	央行票据	_	-
3	金融债券	20,072,000.00	9.94
	其中:政策性金融债	20,072,000.00	9.94
4	企业债券	148,136,000.00	73.34
5	企业短期融资券	10,144,000.00	5.02
6	中期票据	49,573,000.00	24.54
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	227,925,000.00	112.85

明票据						
1. felse				49,573,000.00		24.54
专债				-		-
其他				-		-
合计			2	27,925,000.00		112.85
期末按公允价值占基	。金资产净值比	七例ラ	七小排序的前五名债券	\$投资明细		
债券代码	债券名称		数量 胀)	公允价值	元)	占基金资产净值比例 %)
124224	13朝国资		300,000	30,0	00.000,000	14.85
124074	12张公经		300,000	29,7	54,000.00	14.73
1280372	12铁道 11		300,000	29,€	61,000.00	14.69
1280344	12大庆债		200,000	20,5	42,000.00	10.17
140207	14国开 07	7 200,000 20,072,000.		72,000.00	9.94	
1000	用末按公允价值占基 债券代码 124224 124074 1280372 1280344 140207 明末按公允价值占基	期末按公允价值占基金资产净值!	期来核公允价值占基金资产净值比例 债券化码 债券名称 124224 13 例目资 124074 12 张公整 1280372 12 快请 11 1280344 12 大庆倩 140207 14 田田 70 平	2 現来核公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债金 债券化码 债券名称 数量 € 1 124224 13朝国资 300,000 124074 12张公经 300,000 1280372 12快道 11 300,000 1280344 12大庆债 200,000 140207 14因开7 200,000	227,925,000.00 明末接公允价值占基金资产等值比例大小排序的前五名债券投资明細 债券代码	現来接公允价值占基金资产等值比例大小排序的前五名债券投资申期 债券名称 数量 係) 公允价值 (元) 124224 13朝国资 300,000 30,000,000,000 124074 12张公经 300,000 29,754,000,00 1280372 12铁道 11 300,000 29,661,000,00 1280344 12大庆债 200,000 20,542,000,00 140207 14田开 07 200,000 20,072,000,00 14日子の7 200,000 20,072,000,000 14日子の7 200,000 20,072,000 14日子の7 200,000 20,000 14日子の7 200,000 20,072,000 14日子の7 200,000 20,072,000 14日子の7 200,000 20,072,000 14日子の7 200,000 20,072,000 14日子の7 200,000 20,000 14日子の7 200,000 14日子の7 200,000 14日子の7 200,000 14日子の7 200,000 14日子の7

第6日前心。李爾塞小特申契广文订电券。 5.7 报告期来就公允价值占基金的字等值比例大小排序的前五名货金属投资明细报告期末。本基金未持有贯金属设资。 3.8 报告期末本基金未持有贯金属设第。 报告期末。本基金未持有权证。 3.9 报告期末本基金关持有权证。 3.9 报告期末本基金发持的股指制货交易情况说明

5.9 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。 5.10 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。 5.11 投资组合报告附注 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 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。 5.11.2 本基金均谘的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备连股票库之外的股票。

5.11.	3 其他资产构成	I POMACH J EL RESERVICIPACIÓN I
序号	名称	金额 玩)
1	存出保证金	365.66
2	应收证券清算款	5,295,218.43
3	应收股利	_
4	应收利息	4,756,285.07
5	应收申购款	33,642.49
6	其他应收款	_
7	待摊费用	30,247.17
8	其他	-
	会计	10 115 758 82

91	0 升放式基金份额受动	单位:伤
项目	嘉实中证中期企业债指数 (LOF)A	嘉实中证中期企业债指数 LOF XC
报告期期初基金份额总额	272,093,455.14	49,004,902.22
报告期期间基金总申购份额	45,141,827.97	2,056,640.51
减:报告期期间基金总赎回份额	153,198,186.58	19,486,103.32
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	164,037,096.53	31,575,439.41
注 担生期期间甘本首由助仏郷各は協工仏郷。	甘本首時同仏郷本は梅山仏郷	

\$7 基金管理人还用的时间和地址。 7.1 基金管理人持有本基金份额变动指数。 报告期内,基金管理人关证用固有资金申购,赎回或者买卖本基金的基金份额。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金交易明细 报告期内,基金管理人未运用固有资金收资本基金多易明细 影图 **备查文件目录** 8 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 \$8 **备查又件日录**(1) 中国证益会批核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)募集的文件;
(2) 《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同);
(3) 《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF) 招募设册书);
(4) 《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)招等债况。
(4) 《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)招等协议);
(4) 《基本产证一组《数据》程本

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 3 查阅方式 1 予面查询-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,风键: http://www.jstind.cn 投资者对本报总和集局,可答明本基金管理,紧实基金管理有限公司,咨询电话 400~600~8800.或发电子邮件,

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

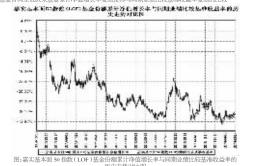
2014年6月30日

现无整性承担个别及连带责任。 基金托管人中国工商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 眼浆到给是报告中次客。保证复核内容不存在虚假记载、摄导性陈注或者重大遗漏。 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。 基金的过往业龄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。 本报告期中的财务资料未经明 009年12月30日 告期末基金 资目标 ·资策略 绩比较基准 基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益 于货币市场基金,债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高 险、较高收益品种。 验收益特征

基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2014年7月19日

	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)
1.本期已实现收益	-23,588,959.05
2.本期利润	28,191,217.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0198
4.期末基金资产净值	846,246,813.98
5.期末基金份额净值	0.6092
	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 加收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项转

阶段



7.1 24	PARTER (N/4PARTER / 1,2H) II	UZ I				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年	说明	
X±40	87.95	任职日期	离任日期	限	10097	
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 tOF)、嘉实中证 500ETF 发其联接、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实 H 股指数、嘉实直逾 (QDII- FOF-LOD,基金经理,公司 指数投资部总监	2014年3月11日	1	16年	管先后担任平安保险投资管理中心 基金交易室主任及天间基金管理有 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 人嘉字基金。南开大学经济学硕士, 具有基金从业资格,中国国籍。	
÷+ (1) /工町口棚 並/工口棚長八三	ルルカウドハエ	→ □ . (a) iT #	口の合金の道	11 行业基本/证金业11 业人里次数常	

注:(1) 任职日期,萬任日明宿公司中田公允命至至 理办法)的相关规定。 42 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、(嘉实中证锐联基本面 50 指数 证券投资基金(00)基金合同)和其他相关法律注解则规定、本省读实信用、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实法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基 金份额持有人对起的行为。 1.3 公平交易专项说明 4.3 公平交易专项说明

/Add 中/A (小型在1971/26)。 4.3 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 报告教权资管理制度和旅程独立决策,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 组出合教投资管理制度和旅程独立决策,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,通过了系统和人工 逐等方式进行日常监定。公平对待据下管理的所有投资组合。 4.3 是常交及行为的专项规则。

§ 5 投资组合报告

字号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	799,195,119.27	94.0
	其中:股票	799,195,119.27	94.0
2	固定收益投资	30,000,000.00	3.5
	其中:债券	30,000,000.00	3.5
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资	-	
5	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	19,749,390.70	2.3
7	其他资产	1,251,986.95	0.1
	合计	850,196,496.92	100.0

码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A 2	农、林、牧、渔业	-	
В 🤌	采矿业	60,308,560.93	7.13
C f	制造业	116,131,106.05	13.72
D E	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,677,696.42	3.86
E §	建筑业	87,173,926.20	10.30
F ł	比发和零售业	-	
3	交通运输、仓储和邮政业	21,600,007.67	2.55
H (主宿和餐饮业	-	
I (言息传输、软件和信息技术服务业	25,647,178.69	3.03
J s	金融业	421,401,152.85	49.80
K J	房地产业	34,255,490.46	4.05
L Ť	租赁和商务服务业	-	
M 1	科学研究和技术服务业	-	
N 7	水利、环境和公共设施管理业	-	
) J	居民服务、修理和其他服务业	_	
P 🛊	教育	-	
5 :	卫生和社会工作	-	-
R D	文化、体育和娱乐业	-	-
S 2	宗合	-	
	合计	799,195,119.27	94.44

公允价值 (元) 601288 18,796,34 47,366,779.3 601318 3,789,81 601668 11,637,83 32,818,689.0 601328 6,636,38

公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细



注:报告期末,本基金以持有上述 2 以颁养。 5.6 报告期末处之价值自选基础产价值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 报告期末,本基金未持有资产支持证券。 5.7 报告期末处之价值自选基金资产价值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 报告期末,本基金未持有负金融投资。 5.8 报告期末本基金未持有负金融投资。 报告期末,本基金未持有负金融设策。 2.3 报告期末,本基金未持有效。 2.3 报告期末本基金表传统股上指期恢复。制度初末本基金表特有效。

59 报告到水-本基金条交流设计前约页之勿由CLEO约 报告期外,本基金未参与的国前附近多局情况说明 报告期外,本基金未参与的国前附近多局情况说明 报告期外,本基金未参与国前附近多局。 3.11.1 报告期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 市十名证券的发行主体未受强分升重量,处罚。 3.11.2 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。 3.11.3 报任资金规

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	80,430.7
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	1,129,030.7
5	应收申购款	12,278.3
6	其他应收款	
7	待摊费用	30,247.1
8	其他	
	合计	1,251,986.9

7133-	单位
报告期期初基金份额总额	1,459,584,700.2
报告期期间基金总申购份额	20,925,996.5
减:报告期期间基金总赎回份额	91,497,081.1
报告期期间基金拆分变动份额	
报告期期末基金份额总额	1,389,013,615.6
注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总财	に回份額含转換出份額。 アカストリスト目の様々

注:按定声明则电查显忠明则为据言表映人为精、基显志默出功器言书映出功器。 57 基金管理人共有本基金价额变动情配 71 基金管理人共有本基金价额变动情配 72 基金管理人云亚周围有资金申购,赎回或者买卖本基金的基金份额。 72 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 报告期内、基金管理人未运用固有资金投资本基金多易明细 多8 备查文件目录

(1) 中国证益实资金需求产业证的疾态产品 30 指效证券投资态量(LOF) (2) (鉴定中证货班选本面 50 指数证券投资选金(LOF)基金(同); (3) (鉴定中证货班选本面 50 指数证券投资选金(LOF)招募说明书); (4) (鉴定中证货班选本面 50 指数证券投资选金(LOF)任金((5) 基金管理人业务资格批件、常过九颗; (6) 报告期内盈来中证货股基本面 50 指数证券投资基金(LOF)公告的

(6)报告期內嘉荣中址即形基本即 50 指家址:好汉於成據以LUTY公口即367/998/1998 起2 存放地点 北京市建国门北大街 8 号华訊大厦 8 层嘉文基金管理有限公司 3.3 查阅方式 (1)书面查询:查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:40-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。 (2) 网络查询:基金管理人例k.tmp://www.yind.cn 投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉文基金管理有限公司,咨询电话 400-600-8800,或发电子邮件,

公允价值 (人民币元

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: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 完整性承担个别及准带责任。 性和完整性承担个别及连带黄仁。 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。

基金简称		基金产品概况 嘉实中证金边中期国债 ETF 联持	is st		
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		133.237.169.37 份			
投资目标		緊密跟踪业绩比较基准,追求跟 化,力争本基金的净值增长率与 偏离度的绝对值不超过 0.3%,年	业绩比较基准之间的日均跟路		
投资策略		在投资运作过程中,本基金将在本等因素的基础上,决定采用一 市场交易的方式进行目标 ETF 自 目标 ETF 基金份额交易和申购、 收益。	级市场申赎的方式或证券二约 约买卖。本基金还将适度参与		
业绩比较基准		中证金边中期国债指数×95%+银	?行活期存款利率 (税后)×5%		
风险收益特征		本基金为嘉实中期国债 ETF 的耳中期国债 ETF 的耳中期国债 ETF 来实现对业绩比较金的业绩表现与中证金边中期旧的表现密切相关。本基金为债券期收益率低于股票基金、混合基	交基准的紧密跟踪。因此,本。 国债指数及嘉实中期国债 ETF 学型基金,其长期平均风险和		
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 ETI 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		123,101,808.55 份	10,135,360.82 份		
2.1.1 目标基金基本情况	T				
基金名称		E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		型开放式			
基金合同生效日		5月10日			
基金份额上市的证券交易所	深圳证券				
上市日期	2013年 8				
基金管理人名称		管理有限公司			
基金托管人名称	中国银行	行股份有限公司			
2.1.2 目标基金产品说明 投资目标	险管理	进行被动式指数化投资,通过严格 手段,力争本基金的净值增长率与 的绝对值不超过0.25%,年跟踪误	业绩比较基准之间的日均跟		
本基金 性的成的 果果村 投资策略 通过 外 进行制		主要采用代表性分层抽样复制策略 份券及各选成份券,或选择非成份 序队险等因素构建组合,并根据本基 汤流动性以及交易所和银行间债券 、期匹配"、信用等级匹配"、期限 转匹配"、信用等级匹配"、期限 转成交易成本,以期在 新新级系统	券作为替代,综合考虑跟踪效 基金资产规模、日常申购赎回 交易特性及交易惯例等情况。		
业绩比较基准	中证金	边中期国债指数			
本基金 混合型 混合型 性分层		8.20千劳岛以1日3X 总为情绪型基金。其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金 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 注抽样复制策略银烧炼的指数的表现,具有与标的指数,以及标称 代代表的债券市场相似的风险收益特征。			
3.1 主要财务指标	§ 3 主要财务	指标和基金净值表现			
~** T36M 21 HAN			单位, 从早;		
主要财务指标		报告期(2014年4月1日 - 20	单位:人民币 014年6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	673,850.72	17,556.00
2.本期利润	4,860,400.59	547,471.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0225
4.期末基金资产净值	125,593,150.42	10,301,768.22
5.期末基金份额净值	1.0202	1.0164
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变 验边中期国债 ETF 联接 C 不收取认(申)购费 的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所分	动收益;(2)嘉实中证金边中期国债 ET 但计提销售服务费。(3)所述基金业绩	

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交易型开放式指数证券投资基金联接基金

5.1 报告期末基金资产组合情况

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

	1	准差(2)	益率③	标准差④	1)-3)	2-4	4.2 报
过去三个月	2.52%	0.13%	1.79%	0.09%	0.73%	0.04%	开放式:
			中证金边中期国债				资产,在
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	约定,无 4.3
t去三个月	2.44%	0.13%	1.79%	0.09%	0.65%	0.04%	4.3 报 投资组
	2-03 1/23 3/23 3/23 4/23			The state of the s			监 4.4.4.4.4.4.5.2.4.4.4.4.5.2.4.4.4.4.4.4.
	\$/3% 1 1 1	Notes Notes Notes Notes	5 4 8 5 3	2 4 5 4 4	111		3
图 1;嘉实中	- 01ee	债 ETF 联接 A 基	DEBHICEPER 0		+ 1 6	E势对比图	3 济、宽t 本
图1:嘉实中	中证金边中期国	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	E势对比图	3 济、宽木 本 5.1
图 1;嘉实中	中证金边中期国	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	- 势 对比图	3 济、宽林 本 5.
图 1:嘉实中	中证金边中期国	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	三势对比图	3 济、宽林 本 5.
图 1:嘉实中	中证金边中期国 學 交中汇金	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	三势对比图	3 济、宽林 本 5. 序
图 1:嘉实中	中证金边中期国 學 交中汇金	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	三势对比图	3 济、宽材 本 5. 序:
图 1:嘉实中	中证金边中期国 學 交中汇金	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	三势对比图	3 济、宽材 本 5. 序:
图 1:嘉实中	を	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	5. 势对比图	3 济、宽材 本 5. 序:
图 1;嘉实中	本文中上全	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	与 势对比图	3 济、宽林 本 5. 序: 1 2 3
图 1:嘉实中	本文中上全	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	三势对比图	3 济、宽村 本 5. 序: 1 2 3
图 1:嘉实中	を中に金辺中期国 ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	· 势对比图	3 3 次 数 本 本 5. 序 3 3 3 3 3 4 4 5 5
图 1;嘉实中	本文中上全	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	5. 多对比图	3 3 次 数 本 本 5. 序 3 3 3 3 3 4 4 5 5
图 1:嘉实叶	を中に金辺中期国 ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	与 对比图	3 3 次 数 本 本 5. 序 3 3 3 3 3 4 4 5 5
图 1:嘉实中	を	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	5 势对比图	3 3 济、宽林 本 5. 序 3 1 2 2 3 3 4 5 5 6 6
图 1:嘉实中	を	债 ETF 联接 A 基金 (2013 年	金份额累计净值增 E 5 月 10 日至 2014	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	收益率的历史走	至勢來北七图	3 济、宽林 本 5. 序 · 1 2 3 3 4 5 5 6 6
图 1:嘉实中	を (1) を (1	债 ETF 联接 A 基。 (2013年 12 「東国 国 P P P P P P P P P P P P P P P P P P	金份额累計等值增 5 月 月 日至 2014 素配上多度 基本	矢率与同期业绩比较基准 年6月30日)	・	与 对比图	33 济、宽木 5.1. 序字 1 2 3 4 5,6
图 1: 嘉实叶	を (1) を (1	债 ETF 联接 A 基。 (2013年 12 「東国 国 P P P P P P P P P P P P P P P P P P	金份额累计净值增 5.5 月 10 日至 2014 聚合1.金股管制: 基本最易证金股管制:	大生与同期业绩比较基准 年6月30日) 予価期 K 本 予以東北海 北に副	東京の大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大学・大	多対比图	33 济、宽木 5.1 序3 1 2 3 4 5 6
	を	横 ETF 联接 A 基 (2013年 (2013年	金份额累计净值增 5 5 月 10 日至 2014 接名1. 全份 智知:	大生与同期业绩比较基准 年6月30日) 予価期 K 本 予以東北海 北に副	牧益率的万史法		2 3 3 4 5 5 6 7

注 1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同单处日显 3-14-0.7。30日) 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。 注 2:2014 年 6月20日,未基金管理人交布 长天三嘉平中盛业中期围碛 ETF 联接基金经理变更的公告》,杨宇先生不再担任本基金基金经理职务。

4 + + A /7 T	m / →P+H+ ∧ //7 mm //m \ //** ∧	3 4	日共八成日		
	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		
装碗辉	本基金、嘉实稳固收益债券、嘉实中证中期企业债券、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	2014年6月20日	-	8年	曾任人保健康投资部处长、国泰 基金固定收益总监等职务。2014 年1月加入嘉实基金管理有限 公司固定收益部,担任执行总 监,从事投资、研究工作。硕士, 具有基金从业资格。
杨宇	本 基 金、嘉 实 沪 宗 300ETF 嘉实沪席 300ETF 嵌接 4.0F)、嘉 实中证 500ETF 及 共联接、嘉实基 本面 50 指数 4.0F)、嘉 实 年股指数 QDII-LOF)、嘉 实深证基本面 120ETF 及 其联接、嘉实黄金 QDII- FOF-LOF) 基金经理、公司 指数投资部总监	2013年5月10日	2014年6月 20日	16‡≐	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都总经理, 万家 代司 180 指数基金经理。 2004 年7月加入嘉安基金。南 开大学经济学硕士,具有基金从 业资格,中国国籍。

近引上的高班E、公平公司研制。日本品对印度及企业等常交易所必要地域,公司旗下所有投资组合等与交易所必开意价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成内。合计3次,为旗下ETF因被近旗器标的指数的需要而和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。 告期内基金的投资策略和业绩表现证明 民事即以基金的投资策略和业绩表现证明 看2季度经济基本面经历了先回客。后回升的走势。以汇丰PMI数据为例。4月份较3月份仅出现小幅回升,且低加多环化变化水平。但5.6月份、汇息PMI。总值就出现了持续的超预期回升,以结构来看,基建投资近期明显发力,分经何升的最生要成力。通振方面、在1季度CPI数据特级帐于预期之后。2季度CPI总体有所回升。基本符合市场度值和回频:整体资金面维持较低位波动、收益率曲级出现平短化下行,短端利率等幅波动,长端利率出现大幅下

I順: 本季度组合主要积极跟踪国债 ETF 基准为目标, 保证跟踪误差。同时组合加大债券配置, 积极增强收益。 保等期内基金的业绩表现 结别束嘉实中面金边中期国债 ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0202 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.52%; 截 嘉实中证金边中期国债 ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0164 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.44%; 同期业绩 运率为 1.79%。

等学生地区上下列目的 1.1 No. 2 Sandown 1.1 No. 2 Sandown

号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比例 66)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	_	-
2	基金投资	120,132,154.67	83.33
3	固定收益投资	13,907,446.00	9.65
	其中:债券	13,907,446.00	9.65
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	
5	金融衍生品投资	-	
6	买人返售金融资产	_	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,624,580.19	6.68
8	其他资产	496,284.05	0.34
	合计	144,160,464.91	100.00

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 用末,本基金未持有职要

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 66)
1	国家债券	13,907,446.00	10.
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	13,907,446.00	10.

5.5 报台	与期末按公允价值占基	金资产净值比例为	: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	101320	国债 1320	102,970	10,297,000.00	7.58
2	101403	国债 1403	35,400	3,610,446.00	2.66
	期末,本基金仅持有」			. I I I I I I I I I I I I I I I I I I I	

3.6 银在邮票校公允归。但白盛旅时一种国民的人小事件的副 1 名对广义行证券较复括告期末、港基金未持有资产货币证券。 5.7 报告期末楼公允价值占基金资产价值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 报告期末、基金未持有贵金属设势。 5.8 报告期末校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。

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人

交易型开放式 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交 报告期内,本基金未参与股指期货交易 5.11 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

5.12 按效组合报告附在 5.121 报告期内本基金投资的前十名证券的变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通查,处罚。 5.303 本证券的发行主体未受到公开通查,处罚。

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	126,511.2
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	368,577.2
5	应收申购款	1,195.5
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
	合计	496,284.0

		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	285,112,244.07	37,204,332.65
报告期期间基金总申购份额	632,913.73	464,284.06
减:报告期期间基金总赎回份额	162,643,349.25	27,533,255.89
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	123,101,808.55	10,135,360.82

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 活。基本是任何可不必要的国际的研究 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。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 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 命並又中日來 (1) 中国证验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 任政心思 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,