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

2014 半年度 报告摘要

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：中国银行股份有限公司
送出日期：2014年8月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 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联接基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	133,237,169.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	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
下属分级基金的交易代码：	000087	000088
报告期末下属分级基金的份额总额	123,101,808.55份	10,135,360.82份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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×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。

2.2.1 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	（010）65215588	（010）66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		（010）65182266	（010）66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	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
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-1,083,013.79	-245,788.39
本期利润	11,065,124.38	1,329,778.47
加权平均基金份额本期利润	0.0411	0.0390
本期加权平均净值利润率	4.13%	3.93%
本期基金份额净值增长率	4.37%	4.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0055	-0.0092
期末基金资产净值	125,593,150.42	10,301,768.22
期末基金份额净值	1.0202	1.0164
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.02%	1.64%

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；（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.69%	0.14%	0.41%	0.06%	0.28%	0.08%
过去三个月	2.52%	0.13%	1.79%	0.09%	0.73%	0.04%
过去六个月	4.37%	0.12%	3.21%	0.10%	1.16%	0.02%
过去一年	1.46%	0.13%	-2.19%	0.13%	3.65%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.02%	0.13%	-2.75%	0.13%	4.77%	0.00%

嘉实中证金边中期国债ETF联接C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.66%	0.14%	0.41%	0.06%	0.25%	0.08%
过去三个月	2.44%	0.13%	1.79%	0.09%	0.65%	0.04%
过去六个月	4.20%	0.12%	3.21%	0.10%	0.99%	0.02%
过去一年	1.12%	0.13%	-2.19%	0.13%	3.31%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.64%	0.13%	-2.75%	0.13%	4.39%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中证金边中期国债指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

中证金边中期国债指数由交易所市场和银行间市场上市交易、剩余期限在4到7年之间、且固定利率付息和一次还本付息的国债品种组成样本，在指数设计上结合了中期国债的具体特征及指数化产品的投资要求。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×(中证金边中期国债指数(t)/中证金边中期国债指数(t-1)-1)+5%×银行活期存款利率（税后）

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark (t-1)

其中t=1,2,3,…。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

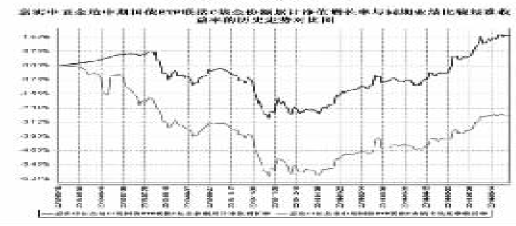

图2：嘉实中证金边中期国债ETF联接C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2013年5月10日至2014年6月30日）

注1：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。

注2：2014年6月20日，本基金管理人发布《关于嘉实中证金边中期国债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；聘请裴晓辉先生担任本基金基金经理职务。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2014年6月30日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	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、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实H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）基金经理杨宇的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理裴晓辉的任职日期指公司作出决定后公告之日，离任日期指公司作出决定后公告之日；（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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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%的，合计3次，均为旗下ETF因被动跟踪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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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ETF联接A(000087)：日均跟踪偏离度的绝对值 0.07%，年化跟踪误差1.56%；符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.3%的限制。

嘉实中证金边中期国债ETF联接C(000088)：日均跟踪偏离度的绝对值 0.07%，年化跟踪误差1.55%；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1.0202元，本报告期基金份额净值增长率为4.37%；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1.0164元，本报告期基金份额净值增长率为4.20%；同期业绩比较基准收益率为3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在稳增长政策的持续推动下，我们预计中短期经济会筑底回升。同时总体通胀水平受制于前期的较弱基本面影响，而持续保持在较低水平。货币政策，延续2季度以来总量中性偏松，定点发力的态势。

3季度债市展望：由于基本面阶段性有所筑底回升，同时流动性边际进一步改善的空间比较有限，上半年市场对弱势经济、宽松政策的乐观预期可能会有所降温，债市整体性风险仍然不大，但有可能进行短期调整。

本基金将谨慎跟踪嘉实中期国债ETF，降低流动性风险暴露，争取为持有人谋求长期稳定的正回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《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与基金托管人一同进行，基金份额净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、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本报告3.1.2"期末可供分配利润" 嘉实中证金边中期国债ETF联接A为-674,999.02元、嘉实中证金边中期国债ETF联接C为-93,330.27元以及基金合同的约定，报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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联接基金（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应尽的义务。

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规定，对本基金管理人的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算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,624,580.19	27,949,468.78
结算备付金		-	-
存出保证金		126,511.23	305,672.55
交易性金融资产	6.4.7.2	134,039,600.67	423,688,020.93
其中：股票投资		-	-
基金投资		120,132,154.67	414,058,619.93
债券投资		13,907,446.00	9,629,401.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	9,614,636.85
应收利息	6.4.7.5	368,577.29	175,056.58
应收股利		-	-
应收申购款		1,195.53	796.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		144,160,464.91	461,733,651.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,487.68	-
应付赎回款		8,065,886.67	9,268,826.46
应付管理人报酬		4,621.41	11,676.76
应付托管费		1,540.46	3,892.25
应付销售服务费		3,389.56	14,281.27
应付交易费用	6.4.7.7	2,975.00	4,550.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,645.49	264,604.86
负债合计		8,265,546.27	9,567,831.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	133,237,169.37	462,702,844.28
未分配利润	6.4.7.10	2,657,749.27	-10,537,024.16
所有者权益合计		135,894,918.64	452,165,820.12
负债和所有者权益总计		144,160,464.91	461,733,651.72

注：报告截止日2014年6月30日，嘉实中证金边中期国债ETF联接A基金份额净值1.0202元，基金份额总额123,101,808.55份；嘉实中证金边中期国债ETF联接C基金份额净值1.0164元，基金份额总额10,135,360.82份。嘉实中证金边中期国债ETF联接基金份额总额合计为133,237,169.37份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入		12,723,175.53	8,193,267.45
1.利息收入		420,450.20	8,193,265.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,273.18	6,369,078.98
债券利息收入		349,177.02	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,824,186.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-1,482,627.37	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-4,707,112.53	-
债券投资收益	6.4.7.14	3,224,485.16	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	13,723,705.03	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	61,647.67	1.53
减：二、费用		328,272.68	986,170.23
1. 管理人报酬		46,555.32	563,376.08
2. 托管费		15,518.42	187,792.04
3. 销售服务费		50,679.27	196,081.81
4. 交易费用	6.4.7.19	20,307.40	-
5. 利息支出		304.12	-
其中：卖出回购金融资产支出		304.12	-
6. 其他费用	6.4.7.20	194,908.15	38,920.30
三、利润总额		12,394,902.85	7,207,097.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润		12,394,902.85	7,207,097.22

注：本基金基金合同生效日为2013年5月10日，上年度可比期间为2013年5月10日至2013年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	462,702,844.28	-10,537,024.16	452,165,820.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,394,902.85	12,394,902.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-329,465,674.91	799,870.58	-328,665,804.33
其中：1.基金申购款	1,851,167.57	-653.72	1,850,513.85
2.基金赎回款	-331,316,842.48	800,524.30	-330,516,318.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	133,237,169.37	2,657,749.27	135,894,918.64
项目	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,341,303,435.56	-	1,341,303,435.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,207,097.22	7,207,097.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,341,303,435.56	7,207,097.22	1,348,510,532.78

注：本基金合同生效日为2013年5月10日，上年度可比期间是指2013年5月10日至2013年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军　　　　李松林　　　　王红
基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	基金托管人、基金代销机构
嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金（"嘉实中证中期国债ETF"）	本基金是该基金的联接基金

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2014年1月1日至2014年6月30日）及上年度可比期间(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,555.32	563,376.08
其中：支付销售机构的客户维护费	180,925.95	225,143.60

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按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剩余部分（若为负数，则取0）的0.3%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=（前一日基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值）（若为负数，则取0）×0.3% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,518.42	187,792.04

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。支付基金托管人中国银行的基金托管费按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剩余部分（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=（前一日的基金资产净值-基金财产中目标ETF份额所对应资产净值）（若为负数，则取0）×0.1% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
嘉实基金管理有限公司	-	116.87	116.87
中国银行	-	46,114.32	46,114.32
合计	-	46,231.19	46,231.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
嘉实基金管理有限公司	-	230.63	230.63
中国银行	-	185,311.04	185,311.04
合计	-	185,541.67	185,541.67

注：（1） 支付基金销售机构的销售服务费按嘉实中期国债ETF联接C类基金份额前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.30%/当年天数。（2）嘉实中期国债ETF联接A类基金份额不收取销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2014年1月1日至2014年6月30日）及上年度可比期间(2013年5月10日（基金合同生效日）至2013年6月30日)，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2014年1月1日至2014年6月30日）及上年度可比期间(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，基金管理人未运用固有资金投资本产品。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2014年6月30日）及上年度末（2013年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,624,580.19	69,705.31	472,821,715.38	2,598,377.19

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，活期银行存款按银行同业利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。（2）本期末（2014年6月30日），本基金无存于中国银行的定期存款，本期（2014年1月1日至2014年6月30日），由中国银行保管的银行存款产生的利息收入无定期存款利息收入；上期末（2013年6月30日）由中国银行保管的银行存款余额含定期存款400,000,000.00元，上年度可比期间（2013年5月10日（基金合同生效日）至2013年6月30日），由中国银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入2,433,111.19元。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2014年1月1日至2014年6月30日）及上年度可比期间(2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2014年6月30日），本基金持有1,190,972.00份目标ETF 基金份额（2013年12月31日：4,293,655.00份），占其总份额的比例为46.29%(2013年12月31日：73.49%)。

6.4.5 期末（ 2014年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2014年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2014年6月30日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2014年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2014年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
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	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,624,580.19	6.68
8	其他各项资产	496,284.05	0.34
	合计	144,160,464.91	100.00

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,907,446.00	10.23
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	10.23

7.6 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

金额单位：人民币元

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（%）
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

注：报告期末，本基金仅持有上述2只债券。

7.7 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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 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

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	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	120,132,154.67	88.40

7.11 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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	126,511.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	368,577.29
5	应收申购款	1,195.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	496,284.05

7.13.4 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。

7.13.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉实中证金边中期国债ETF联接A	900	136,779.79	798,419.18	0.65%	122,303,389.37	99.35%
嘉实中证金边中期国债ETF联接C	187	54,199.79	-	0.00%	10,135,360.82	100.00%
合计	1,069	124,637.20	798,419.18	0.60%	132,438,750.19	99.40%

注：(1)嘉实中证中期国债ETF联接A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证中期国债ETF联接A份额占嘉实中证中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者持有嘉实中证中期国债ETF联接A份额占嘉实中证中期国债ETF联接A总份额比例；

(2)嘉实中证中期国债ETF联接C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证中期国债ETF联接C份额占嘉实中证中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者持有嘉实中证中期国债ETF联接C份额占嘉实中证中期国债ETF联接C总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

§9 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
基金合同生效日（2013年5月10日）基金份额总额	874,403,119.42	466,900,316.14
本报告期期初基金份额总额	409,348,827.73	53,354,016.55
本报告期基金总申购份额	1,138,571.98	712,595.59
减：本报告期基金总赎回份额	287,385,591.16	43,931,251.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	123,101,808.55	10,135,360.82

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2014年6月20日，本基金管理人发布《关于嘉实中证金边中期国债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；聘请裴晓辉先生担任本基金基金经理职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注1：本表"佣金"指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注2：交易单元的选择标准和程序

（1）经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

（2）公司财务状况良好；

（3）有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

（4）有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注3：报告期内，本基金退租以下交易单元：大通证券股份有限公司退租上海交易单元1个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券股份有限公司	8,768,403.82	100.00%	2,000,000.00	100.00%	3,653,980.59	100.00%

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E-mail：service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2014年8月25日