

# 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:2018年08月25日

基金管理人承诺: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2018年8月22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。  
本报告自2018年1月1日起至2018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
基金代码	000087
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年04月01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	7,515,507.78份
基金合同存续期	不定期
本基金为基金中的基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接
本基金为基金中的基金代码	000087
报告期末基金份额总额	7,515,507.78份
报告期末基金份额净值	1.497,854.00元

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联接基金
基金代码	000087
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年04月01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	7,515,507.78份
基金合同存续期	不定期
本基金为基金中的基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接
本基金为基金中的基金代码	000087
报告期末基金份额总额	7,515,507.78份
报告期末基金份额净值	1.497,854.00元

2.2 投资目标  
本基金的投资目标:追求超越业绩比较基准的绝对收益,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0.2%,年化跟踪误差不超过2%。

2.2.1 目标基金产品说明  
本基金为被动式指数化投资,通过严格的跟踪偏离度控制,力求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0.2%,年化跟踪误差不超过2%。

2.3 基金管理人及基金托管人  
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

2.3 基金管理人及基金托管人  
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

§ 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

项目	本报告期末(2018年06月30日)	本报告期末(2018年06月30日)	本报告期末(2018年06月30日)
本期已实现收益	14,976.08	-5.44	
本期基金份额净值增长率	0.22%	0.10%	0.07%
业绩比较基准收益率	0.10%	0.07%	0.03%
跟踪误差	0.12%	0.03%	0.04%

3.2 基金净值表现  
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	跟踪误差③	①-②	①-③
过去一个月	0.25%	0.11%	0.14%	0.07%	0.03%
过去三个月	1.04%	0.23%	0.81%	0.23%	0.02%
过去六个月	1.59%	0.10%	1.49%	0.07%	-0.41%
过去一年	-0.43%	0.10%	0.56%	0.07%	-0.09%
过去二年	0.64%	0.11%	-0.23%	0.08%	0.03%

注:(1)本期已实现收益扣除基金本期利息收入、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:(1)申购费、嘉实中证金边中期国债ETF联接C不收取(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据;(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。

注:(1)任职日期、离任日期是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 管理人及基金托管人  
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

4.3 基金管理人及基金托管人  
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

4.4 基金管理人及基金托管人  
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

4.5 基金管理人及基金托管人  
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

4.6 基金管理人及基金托管人  
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

4.7 基金管理人及基金托管人  
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

“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、法规和基金合同及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有关规定,对本基金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内容的真实、准确和完整发表意见  
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有关规定,对本基金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。

6.1 资产负债表  
单位:人民币元

资产	期末	本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
货币资金	6,471	21,794,011	676,688,611
结算备付金	-	2,488,033	49,406
存出保证金	-	80,070	38,906
交易性金融资产	6,472	7,963,007.87	9,836,396.20
其中:股票投资	-	7,449,900.00	9,630,639.70
债券投资	-	513,107.87	205,756.50
其他金融资产	-	-	-
应收利息	-	1,497,854.00	1,497,854.00
应收股利	-	-	-
其他应收款	-	-	-
资产总计	6,473	29,744,862.87	10,613,986.90

负债和所有者权益	期末	本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
短期借款	-	-	-
应付账款	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他应付款	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	6,472	29,744,862.87	10,613,986.90
其中:基金份额持有人权益	6,472	29,744,862.87	10,613,986.90

6.2 利润表  
单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年6月30日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年6月30日)
一、营业收入	208,483.23	-268,193.33
其中:利息收入	7,979.46	6,013.26
其中:公允价值变动收益	1,466,688.77	2,566.51
其他收入	8,298.77	3,509.46
二、费用	-	-
其中:管理费用	-	-
其中:销售费用	-	-
其中:利息支出	-	-
其他费用	-	-
三、利润总额	208,483.23	-268,193.33
四、净利润	208,483.23	-268,193.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年6月30日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年6月30日)
一、期初基金份额总额	7,515,507.78	7,515,507.78
二、本期基金份额变动	-	-
其中:申购份额	-	-
其中:赎回份额	-	-
三、期末基金份额总额	7,515,507.78	7,515,507.78

6.4 基金管理人及基金托管人  
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

6.5 基金管理人及基金托管人  
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

6.6 基金管理人及基金托管人  
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

6.7 基金管理人及基金托管人  
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

6.8 基金管理人及基金托管人  
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

6.9 基金管理人及基金托管人  
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

6.10 基金管理人及基金托管人  
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

6.11 基金管理人及基金托管人  
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

6.12 基金管理人及基金托管人  
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

6.13 基金管理人及基金托管人  
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

6.14 基金管理人及基金托管人  
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

“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、法规和基金合同及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有关规定,对本基金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内容的真实、准确和完整发表意见  
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有关规定,对本基金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。

6.1 资产负债表  
单位:人民币元

资产	期末	本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
货币资金	6,471	21,794,011	676,688,611
结算备付金	-	2,488,033	49,406
存出保证金	-	80,070	38,906
交易性金融资产	6,472	7,963,007.87	9,836,396.20
其中:股票投资	-	7,449,900.00	9,630,639.70
债券投资	-	513,107.87	205,756.50
其他金融资产	-	-	-
应收利息	-	1,497,854.00	1,497,854.00
应收股利	-	-	-
其他应收款	-	-	-
资产总计	6,473	29,744,862.87	10,613,986.90

负债和所有者权益	期末	本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
短期借款	-	-	-
应付账款	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他应付款	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	6,472	29,744,862.87	10,613,986.90
其中:基金份额持有人权益	6,472	29,744,862.87	10,613,986.90

6.2 利润表  
单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年6月30日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年6月30日)
一、营业收入	208,483.23	-268,193.33
其中:利息收入	7,979.46	6,013.26
其中:公允价值变动收益	1,466,688.77	2,566.51
其他收入	8,298.77	3,509.46
二、费用	-	-
其中:管理费用	-	-
其中:销售费用	-	-
其中:利息支出	-	-
其他费用	-	-
三、利润总额	208,483.23	-268,193.33
四、净利润	208,483.23	-268,193.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
单位:人民币元

项目	本期(2018年1月1日至2018年6月30日)	上年度可比期间(2017年1月1日至2017年6月30日)
一、期初基金份额总额	7,515,507.78	7,515,507.78
二、本期基金份额变动	-	-
其中:申购份额	-	-
其中:赎回份额	-	-
三、期末基金份额总额	7,515,507.78	7,515,507.78

6.4 基金管理人及基金托管人  
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

6.5 基金管理人及基金托管人  
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

6.6 基金管理人及基金托管人  
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

6.7 基金管理人及基金托管人  
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

6.8 基金管理人及基金托管人  
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

6.9 基金管理人及基金托管人  
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

6.10 基金管理人及基金托管人  
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

6.11 基金管理人及基金托管人  
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

6.12 基金管理人及基金托管人  
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

6.13 基金管理人及基金托管人  
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

6.14 基金管理人及基金托管人  
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

# 2018年半年度报告摘要

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。

7.1.3 期末其他各项资产构成  
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存保证金	806.70
2	应收证券清算款	102,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,170.06
5	其他应收款	9,584.61
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,962.29

7.1.3 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。

7.1.3.5 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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.5 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.6 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.8 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.9 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.10 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.11 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.12 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.13 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.14 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.15 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.16 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

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。

7.1.3 期末其他各项资产构成  
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存保证金	806.70
2	应收证券清算款	102,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,170.06
5	其他应收款	9,584.61
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,962.29

7.1.3 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。

7.1.3.5 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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.5 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.6 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.8 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.9 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.10 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.11 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.12 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.13 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.14 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.15 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.16 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

图2:嘉实中证金边中期国债ETF联接基金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



图3:嘉实中证金边中期国债ETF联接基金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



图4:嘉实中证金边中期国债ETF联接基金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



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。

7.1.3 期末其他各项资产构成  
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存保证金	806.70
2	应收证券清算款	102,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,170.06
5	其他应收款	9,584.61
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,962.29

7.1.3 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。

7.1.3.5 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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构  
报告期末,本基金未持有股票。