

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
送出日期:2013年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对报告所载资料不承担虚假记载、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。本半年度报告经全部董事签字确认，并由董事长签章。

基金托管人中行国际银行有限公司根据本基金合同规定，于2013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、报告期末基金资产净值、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏。

基金持有人承诺以诚信原则，勤勉尽责的履行管理责任，运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本报告期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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年3月22日 合同生效日至2013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500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500ETF联接

基金主代码 000008

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2013年3月22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

报告期末基金份额总额 95,383,519.10份

基金合同存续期 不定期

2.2 基金基本概况

基金名称 嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 159922

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2013年2月6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

报告期末基金份额总额 95,383,519.10份

基金合同存续期 不定期

2.3 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，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过0.4%。

本基金为跟踪ETF的联接基金，主要通过投资于目标-ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金相对于业绩比较基准的日常跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过0.4%。本基金拟通过指数化投资方法，对标的指数的成分股及权重进行有效跟踪，以达到基金净值与标的指数的走势相一致。

投资策略 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金，及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动态跟踪的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

业绩比较基准 中证500指数收益×95%+银行定期存款后利率×5%

本基金为嘉实中证500ETF的联接基金，主要通过投资于目标-ETF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500指数及嘉实中证500指数的表现在长期及风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金，及货币市场基金。

2.4 基金产品说明

投资目标 本基金将进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪误差的最小化。

本基金将采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

业绩比较基准 中证500指数

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金，及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动态跟踪的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.5 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 中国建设银行股份有限公司

姓名 胡勇 赵青

信息披露负责人 联系电话 (010)65215588 (010)67595096

电子邮箱 service@fund.cn tianqing.lzh@cch.com

客户服务电话 400-600-8800 (010)67595096

传真 (010)65182266 (010)66275853

2.6 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

北京市建国门北大街9号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

基金半年度报告备置地点 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

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年3月22日(基金合同生效日) - 2013年6月30日)

本期已实现收益 11,248,192.69

本期利润 5,126,819.48

加权平均基金份额本期利润 0.0244

本期平均净值利润率 2.42%

本期基金份额净值增长率为 -5.87%

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配利润 -5,597,068.10

期末可供分配基金份额利润 -0.0587

期末基金份额净值 89,786,451.00

期末可供分配基金份额净值 0.9413

报告期末(2013年6月30日)

基金份额净值增长率 -5.87%

报告期末(2013年6月30日)本基金的份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期末(2013年6月30日