

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26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
基金简称	嘉实国债ETF
场内简称	国债ETF
基金代码	159926
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013/5/10
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
报告期末基金总资产	2,572,698.00元
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013/8/5

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动式指数化投资，通过严格的证券投资纪律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跟踪偏离度绝对值不超过0.25%，跟踪误差不超过0.3%。
投资策略	本基金将借鉴国际成熟市场的经验，通过定期评估和调整，对投资组合进行优化调整，择机调整投资组合，根据宏观经济、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及变化趋势，适时调整投资品种的配置比例，以期在风险控制的前提下，获取超越基准的超额收益。
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。本基金为指数基金，主要采用完全复制法，紧密地跟踪业绩比较基准指数，具有与标的指数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
姓名	胡勇钢	王永民
信息披露负责人	联系人电话	010)65215588
电子邮件	service@fund.sj.com	fdgbank@china.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的管理人互联网网址	http://www.jrfund.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

金额单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		本期		本报告期	
本期实现收益	-7,649,284.33	本期利润	18,473,813.85	加权平均基金份额本期利润	0.4384
本期平均基金份额利润	0.43%	加权平均基金份额本期利润	0.4384	加权平均基金份额本期利润	0.43%
本期末基金份额净值	1.0089	本期末基金份额净值	1.0089	本期末基金份额净值	0.87%
报告期期末	(2014年6月30日)	报告期期末	(2014年6月30日)	报告期期末	(2014年6月30日)

注:(1)本报告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)上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；(3)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

阶段	份额净值增长 率(①)	份额净值增 长标准差 (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	0.40%	0.10%	0.43%	0.07%	0.03%	0.03%
过去三个月	2.63%	0.12%	1.88%	0.09%	0.75%	0.03%
过去六个月	4.60%	0.13%	3.88%	0.11%	1.22%	0.02%
过去一年	0.07%	0.15%	-2.32%	0.13%	2.39%	0.02%
成立以来	0.87%	0.14%	-2.91%	0.14%	3.78%	0.00%

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:嘉实中证金边国债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)投资范围和(七)投资禁止行为与限制”的有关规定。

注:2014年6月20日，本基金管理人发布了《关于嘉实中证中期国债ETF基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理，聘请裴晓晖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，具体包括嘉实理财产品、嘉实成长收益混合、嘉实稳健混合、嘉实稳健组合、嘉实债券、嘉实回报增值行业混合、嘉实品质企业股票、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)、嘉实优势债券、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(ODII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实货币(ODII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(ODII)、嘉实理财宝货币基金、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、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证沪深300ETF、嘉实3个月定期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(或基金经理助理)及基金经理简介

姓名	性别	任本基金的基金基金经理期限	任本基金的基金基金经理助理期限	说明
裴晓晖	女	2014年6月20日	—	曾任嘉实回报增值债券基金经理，嘉实中证中期企业债指数基金基金经理，2014年1月加入本基金基金管理公司，担任执行总监、基金经理、研究员、研究报告员，具有基金从业资格。

杨宇，嘉实中证金边国债ETF基金经理，2013年5月10日-2014年6月20日，嘉实中证金边国债ETF基金基金经理，2014年6月20日至今，嘉实中证金边国债ETF基金基金经理。

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起，基金经理裴晓晖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合规性情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格遵循《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

报告期内，基金管理人严格遵循《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。

4.4 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；通过完善交易内幕信息知悉人员范围、建立公平交易制度、完善异常交易监控机制等措施，确保旗下各投资组合公平对待所有投资对象，防范不公平交易行为。

4.5 投资组合的重大关联交易

报告期内，基金管理人没有发生重大关联交易。

4.6 投资组合的关联交易定价政策

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.7 投资组合的关联交易的公平性说明

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.8 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.9 投资组合的关联交易的内部控制制度

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.10 投资组合的关联交易的监督制度

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.11 投资组合的关联交易的报告制度

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.12 投资组合的关联交易的法律责任

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.13 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.14 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.15 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.16 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.17 投资组合的关联交易的披露

报告期内，基金管理人没有发生关联交易。

4.18 投资组合的关联交易的披露