

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、监事会对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。

本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
报告期末基金资产净值	133,237,169.37元
基金份额净值	不定期
下一开放日的基金简称	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
下一开放日的基金代码	000087 000088
报告期基金份额总额	123,808,855份
报告期基金份额净值总额	10,135,360.82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	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
基金的上市地	深圳证券交易所
上市日期	2013年5月10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	本基金通过投资于嘉实沪深300ETF，追求超越基准收益的绝对回报，力争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。
投资策略	本基金主要采取代表公司股票的复制策略，投资于标的指数中具有代表性的成份股，通过定期调整股票组合，使基金的净值增长率与标的指数的表现尽可能地一致。
业绩比较基准	中证金边中证国债指数×95%+银行活期存款(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，主要投资于嘉实中证金边中期国债ETF来实现对业绩比较基准的超越，本基金的风险收益特征与嘉实沪深300ETF的业绩风险相仿。
2.2.1 目标基金产品说明	本基金在业绩比较基准上还考虑了基金费率的抽样调整、降低交易成本，以期在规定的风险承受限度内，取得超越基准的收益。

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
法定代表人	胡学军	王永民
信息披露负责人	胡波	(010)65215588
电子邮箱	service@jrufund.com	fxd@bankofchina.com
客户服务电话	400-8800-8800	95566
传真	(010)65182266	(010)66694942

2.4 信息披露方式

信息披露方式	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街1号嘉富大厦B座嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

基金净值		金额单位:人民币元	
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	1.0000	1.0000
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至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	0.0090	
本期加权平均利润率	4.13%	3.93%	
本期基金资产净值增长率	4.37%	4.20%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2014年6月30日)		
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末基金资产净值	125,135,180.42	10,301,768.22	
期末基金份额净值	1.0202	1.0164	
3.1.3 累计净值增长率	报告期(2014年6月30日)		
基金资产净值增长率	2.02%	1.93%	
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C			
阶段	份额净值增长 率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	份额净值增 长率相对基 准收益率(%)
过去一个月	0.69%	0.14%	0.41%
过去二个月	2.52%	0.13%	1.79%
过去六个月	4.37%	0.12%	3.21%
过去一年	1.46%	0.13%	-2.19%
自基金合同生 效以来	1.12%	0.13%	-2.19%
3.2.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较			
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认购(申)购费,嘉实中证金边中期国债ETF联接C认购(申)购费即支付申购费时扣除销售服务费; (3) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用,费用影响会导致基金份额的申购价格和赎回价格的变化,与实际申购或赎回价格有所差异。			
(4) 期末可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。			

3.2.3 基金净值表现

基金净值		金额单位:人民币元	
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	1.0000	1.0000
3.3.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至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	0.0090	
本期加权平均利润率	4.13%	3.93%	
本期基金资产净值增长率	4.37%	4.20%	
3.3.2 期末数据和指标	报告期(2014年6月30日)		
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末基金资产净值	125,135,180.42	10,301,768.22	
期末基金份额净值	1.0202	1.0164	
3.3.3 累计净值增长率	报告期(2014年6月30日)		
基金资产净值增长率	2.02%	1.93%	

基金净值		金额单位:人民币元	
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	1.0000	1.0000
3.4.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至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	0.0090	
本期加权平均利润率	4.13%	3.93%	
本期基金资产净值增长率	4.37%	4.20%	
3.4.2 期末数据和指标	报告期(2014年6月30日)		
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末基金资产净值	125,135,180.42	10,301,768.22	
期末基金份额净值	1.0202	1.0164	
3.4.3 累计净值增长率	报告期(2014年6月30日)		
基金资产净值增长率	2.02%	1.93%	

基金净值		金额单位:人民币元	
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	1.0000	1.0000
3.5.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至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	0.0090	
本期加权平均利润率	4.13%	3.93%	
本期基金资产净值增长率	4.37%	4.20%	
3.5.2 期末数据和指标	报告期(2014年6月30日)		
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末可供分配利润	-674,999.02	-93,330.27	
期末基金资产净值	125,135,180.42	10,301,768.22	
期末基金份额净值	1.0202	1.0164	
3.5.3 累计净值增长率	报告期(2014年6月30日)		
基金资产净值增长率	2.02%	1.93%	

<tbl