

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金

[2014]第三季度报告

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
报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等,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基金,但不保证基金一定盈利。

本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。

本报告期的中期财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证金边国债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年5月10日
报告期末基金份额总额	722,698,094.00

本基金进行被动指数化投资,通过严格的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误差不超过0.2%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在改革预期的持续推动下,我们预计国债市场会震荡回升,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,延续三季度以来总量中性偏松,定点发力的态势。

4.6 季度投资展望: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有限,对弱势经济,央行采取宽松货币政策的预期,债市整体性风险仍然不大,但有可能进行短期调整。

本基金将谨慎跟踪债券指数,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。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

名称	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1 权益投资		—	—
2 固定收益投资	66,931,414.40	90.37	
3 其他投资	66,931,414.40	90.37	
4 货币市场基金	—	—	
5 金融衍生品投资	—	—	
6 小额新股投资	—	—	
7 债券投资	—	—	
8 其他	—	—	
9 债券回购	5,676,622.00	7.66	
10 其他资产	1,496,536.15	1.97	
11 合计	74,064,535.35	100.00	

5.2 报告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。

5.3 报告期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。

5.4 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金仅持有上述3只债券。

5.6 报告期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。

5.7 报告期未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。

5.8 报告期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。

5.9 报告期按基金资产的股息红利交易情况说明

报告期内,本基金未参与股息红利交易。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.12 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。

5.13 其他资产构成

报告期末,本基金没有其他资产。

5.14 报告期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。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期内,本基金未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期末,本基金未持有股票。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金交易明细。

7.3 备查文件目录

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 中国证监会核准准予本基金中期国债交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

7.2 报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金交易明细。

7.3 报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金交易明细。

7.4 管理人报告

7.5 备查文件目录

§ 8 备查文件目录

§ 9 基金份额持有人数

§ 10 报告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。

§ 11 报告期末基金投资的国债期货情况说明

报告期内,基金管理人未参与国债期货交易。

§ 12 报告期内基金投资的前十名证券中存在流通受限情况的说明

报告期内,本基金未持有股票。

§ 13 其他资产构成

报告期末,本基金没有其他资产。

§ 14 报告期未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

报告期末,本基金未持有债券。

§ 15 报告期未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。

§ 16 报告期未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。

§ 17 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 18 报告期未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。

§ 19 报告期未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。

§ 20 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 21 报告期未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。

§ 22 报告期未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。

§ 23 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 24 报告期未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。

§ 25 报告期未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。

§ 26 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 27 报告期未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。

§ 28 报告期未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。

§ 29 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 30 报告期未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。

§ 31 报告期未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。

§ 32 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 33 报告期未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。

§ 34 报告期未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。

§ 35 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 36 报告期未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。

§ 37 报告期未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。

§ 38 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 39 报告期未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。

§ 40 报告期未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。

§ 41 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 42 报告期未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。

§ 43 报告期未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。

§ 44 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 45 报告期未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。

§ 46 报告期未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。

§ 47 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§ 48 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小