

## 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

## [2014] 年度报告摘要

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值 占基金资产净值比例(%)

8.10 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实中证金边中期国债ETF	债券型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	45,880,888.25	91.33

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末，本基金未参与股指期货交易。
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末，本基金未参与国债期货交易。
8.13 报告期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。
8.135 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之外的股票。
8.136 期末其他各项资产构成
单位：人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 51,063.50
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 20,879.99
5 应收申购款 13,300.00
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 85,171.49

8.137 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。
8.138 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。
9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有份额

单位：份

序号	持有人户数(户)	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18	1.77%
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-	2,821,196.29
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%	47,039,972.44

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.3 期末基金管理人员的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

单位：份

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	-	-	-
嘉实中证金边中期国债ETF	-	-	-
嘉实中证金边中期国债ETF	-	-	-
合计	-	-	-

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.4 期末开放式基金份额变动

单位：份

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.5 期末开放式基金负债总额

单位：人民币元

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.6 期末基金资产净值

单位：人民币元

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.7 期末基金资产估值

单位：人民币元

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.8 期末基金资产份额

单位：份

项目	份额级		
	持有人户数(户)	持有人数	占比
嘉实中证金边中期国债ETF	451	99,816.18	798,419.18
嘉实中证金边中期国债ETF	131	21,535.85	-
合计	84,319.95	798,419.18	1.67%

(注)嘉实中证金边中期国债ETF联接A:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接A份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接A总份额比例；个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例；

(2)嘉实中证金边中期国债ETF联接C:机构投资者持有量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例、个人投资者有持仓量中证金边中期国债ETF联接C份额占嘉实中证金边中期国债ETF联接C总份额比例。

9.9 期末基金资产净值

单位：人民币元

项目	份额级		
持有人户数(户)	持有人数	占比</	