

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25日

§ 1重要提示

基金管理人的董事及董事会对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基金合同的规定，于2017年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期截至2017年7月1日止。

§ 2基金产品概况

2017年7月1日至2017年9月30日止。

报告期基金资产净值

1,234.1

单位:人民币元

基金简称 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 000087

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年5月10日

报告期末基金总资产 10,756,657.52元

投资目标 在投资过程中，本基金将在综合考虑风险、波段、成本的基础上，寻求资产配置和投资误差的最小化，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 在投资过程中，本基金将综合考虑风险、波段、成本的基础上，寻求资产配置和投资误差的最小化，力争实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 中证综合债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征 本基金为债券型基金，主要投资于经中国证监会批准的交易型开放式基金，其投资风险与业绩表现直接相关，因此，本基金的业绩表现将主要取决于所持有的交易型开放式基金的业绩表现，同时本基金的预期风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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

§ 3主要财务指标和基金净值表现

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 4基金管理人报告

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 5基金业绩表现

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 6开 放 式 基 金 预 期 变 动

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 7基金业绩表现

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 8开 放 式 基 金 预 期 变 动

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 9备查文件目录

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 10备查文件

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 11备查文件

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 12备查文件

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1

报告期基金份额总额

10,756,657.52份

报告期基金份额变动

-2,252,993.00份

报告期基金份额累计净值

1,059.3

报告期基金份额净值

1,059.3

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)上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 13备查文件

报告期截至2017年7月1日止 2017年9月30日止

报告期基金资产净值

1,234.1