嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 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 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§2 基金简介 6

2.1 基金基本情况 6

2.2 基金产品说明 6

2.3 基金管理人和基金托管人 7

2.4 信息披露方式 7

2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 9

§4 管理人报告 12

4.1 基金管理人及基金经理情况 12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 15

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 17

§5 托管人报告 18

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 18

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 18

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 19

6.1 资产负债表 19

6.2 利润表 20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 22

6.4 报表附注.....24
§7 投资组合报告.....46
7.1 期末基金资产组合情况.....46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....47
7.6 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.....47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....48
7.8 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贵金属投资明细.....48
7.9 期末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.....48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....48
7.12 投资组合报告附注.....48
§8 基金份额持有人信息.....50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....51
§9 开放式基金份额变动.....52
§10 重大事件揭示.....53
10.1 基金份额持有人大会决议.....53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....53
10.4 基金投资策略的改变.....53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....53
10.8 其他重大事件.....58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 60

§12 备查文件目录 60

12.1 备查文件目录 60

12.2 存放地点 61

12.3 查阅方式 61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)	
基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)	
场内简称	中期企债	
基金主代码	160720	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2013 年 2 月 5 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	
报告期末基金份额总额	545,473,340.73 份	
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 年 4 月 1 日	
下属分级基金的基金简称：	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码：	160720	160721
报告期末下属分级基金的份额总额	533,028,138.29 份	12,445,202.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格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偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份债券，或选择非成份债券作为替代，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，通过“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量控制跟踪误差最小化。

业绩比较基准	中证中期企业债指数×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，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场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
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	（010）65215588	（010）66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		（010）65182266	（010）66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		邓红国	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,563,405.04	193,424.80
本期利润	1,353,939.36	-344,898.04
加权平均基金份额本期利润	0.0025	-0.0152
本期加权平均净值利润率	0.23%	-1.36%
本期基金份额净值增长率	0.24%	0.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	35,597,158.80	945,659.86
期末可供分配基金份额利润	0.0668	0.0760
期末基金资产净值	596,245,870.69	14,026,774.39
期末基金份额净值	1.1186	1.1271
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	17.48%	17.89%

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）嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；（3）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（4）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的孰低数。

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

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.36%	0.09%	1.49%	0.05%	0.87%	0.04%
过去三个月	0.63%	0.12%	0.28%	0.08%	0.35%	0.04%
过去六个月	0.24%	0.12%	0.01%	0.07%	0.23%	0.05%
过去一年	-1.18%	0.15%	0.76%	0.08%	-1.94%	0.07%
过去三年	13.69%	0.12%	16.74%	0.08%	-3.05%	0.04%
自基金合同生效起至今	17.48%	0.11%	22.99%	0.08%	-5.51%	0.03%

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.34%	0.09%	1.49%	0.05%	0.85%	0.04%
过去三个月	0.57%	0.12%	0.28%	0.08%	0.29%	0.04%
过去六个月	0.12%	0.12%	0.01%	0.07%	0.11%	0.05%
过去一年	-1.28%	0.15%	0.76%	0.08%	-2.04%	0.07%
过去三年	14.65%	0.12%	16.74%	0.08%	-2.09%	0.04%
自基金合同生效起至今	17.89%	0.11%	22.99%	0.08%	-5.10%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×(中证中期企业债指数(t)/中证中期企业债指数(t-1)-1)＋5%×银行活期存款利率（税后）

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,…。

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

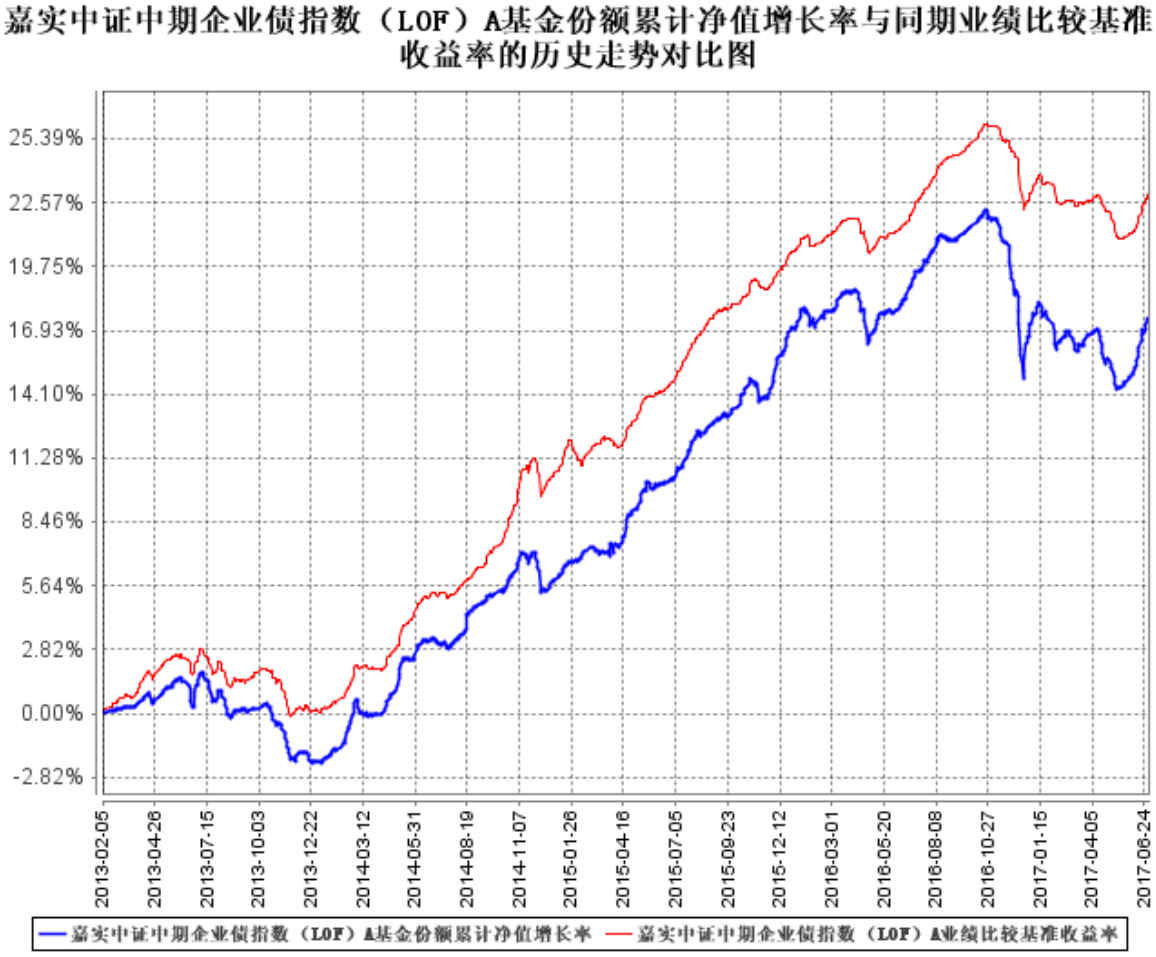

图 1：嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013 年 2 月 5 日至 2017 年 6 月 30 日）

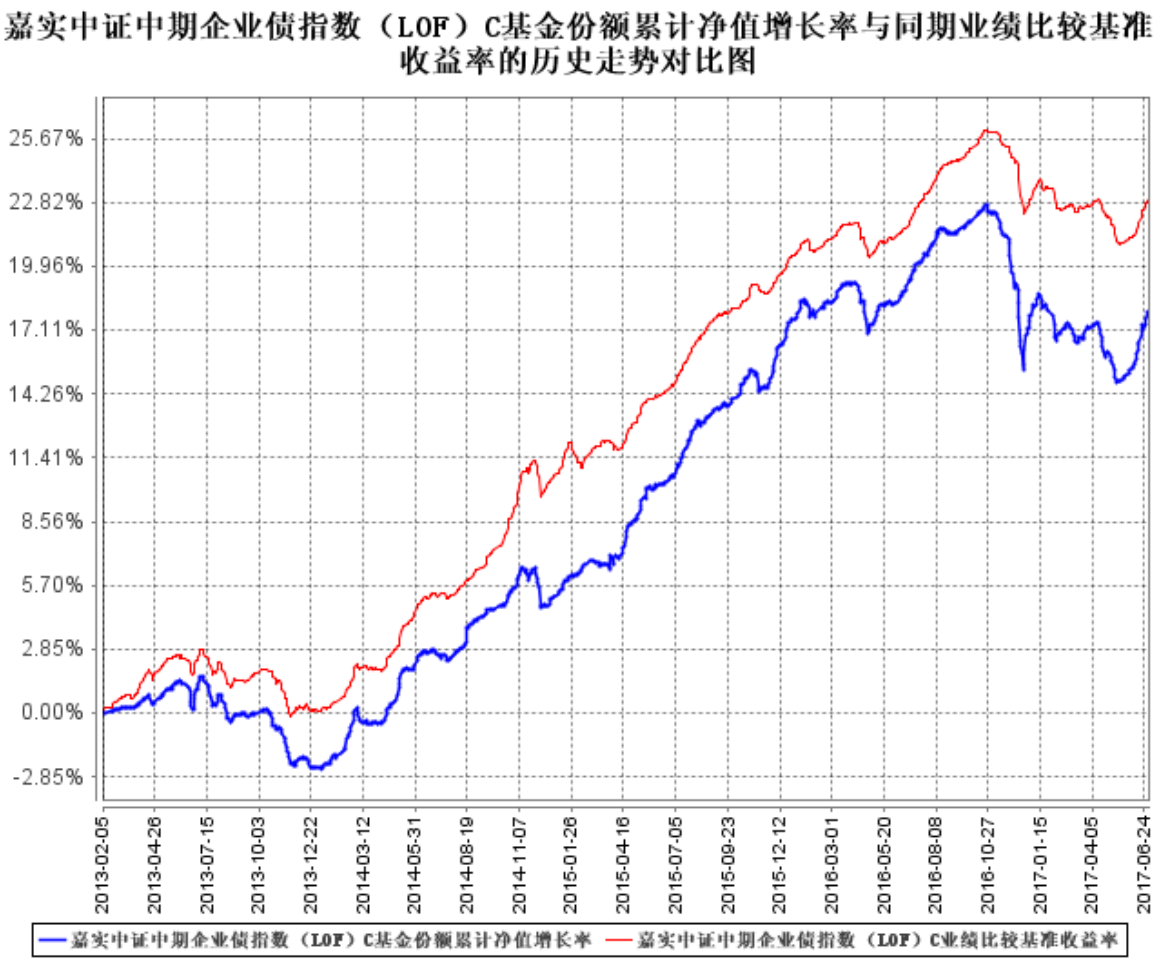

图 2：嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013 年 2 月 5 日至 2017 年 6 月 30 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 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”的有关约定。

§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。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、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、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、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 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债

券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。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（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡永青	本基金、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实元和、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债、嘉实稳盛债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混	2015 年 12 月 15 日	-	14 年	曾任天安保险股份有限公司固定收益组合经理，信诚基金管理有限公司投资经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系全回报策略组组长。硕士研究生，具有基金从业资格。

	合、嘉实价值增强混合、嘉实稳宏债券、嘉实稳怡债券、嘉实稳愉债券基金经理，公司固定收益业务体系全回报策略组组长				
曲扬	本基金、嘉实债券、嘉实稳固收益债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、嘉实稳丰纯债、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实稳怡债券基金经理	2015 年 4 月 18 日	-	13 年	曾任中信基金任债券研究员和债券交易员、光大银行债券自营投资业务副主管，2010 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理，现任职于固定收益业务体系全回报策略组。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
王亚洲	本基金、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳泰债	2015 年 7 月 9 日	-	5 年	曾任国泰基金管理有限公司债券研究员，2014 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司固

	券、嘉实稳盛债券、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实稳愉债券基金经理				定收益业务体系任研究员。具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期、离任日期是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《证券业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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)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

4.3.1 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《证券投资基金管理公司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；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 6 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年债券收益率整体上行，1-5 月市场整体震荡走高，5 月中旬之后,由于监管协调，

以及非银机构前期较为显著的减少仓位，市场情绪明显修复，收益率大幅下行。基本面方面，年初 CPI、PPI 走高，带动工业企业利润继续快速增长；去年地产调控之后，一二线城市销售虽有回调但部分城市价格依然快速上涨，三四线城市销量持续超预期；而海外方面，美国经济表现依然较好，欧洲复苏略超预期，对中国的出口仍有一定的拉动作用；但随着监管从金融逐渐过渡到财政、以及房地产各种政策的持续，市场对经济增长预期产较为负面，整体来看收益率曲线较为平坦。整个上半年来看，利率债和中高等级信用债收益率整体上行 40-60bp，十年国债收益率收于 3.57%左右。

本基金本着稳健投资原则，更加注重组合的绝对回报，一季度保持低久期运行，二季度提升组合久期，小幅提升组合杠杆。报告期内本基金日均跟踪误差为 0.06%（A 类、C 类），年度化拟合偏离度为 1.30%（A 类、C 类），符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 基金份额净值为 1.1186 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.24%；截至本报告期末嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 基金份额净值为 1.1271 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.12%；同期业绩比较基准收益率为 0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为债市收益率高点基本已经确认，但三季度前期仍是震荡为主的行情。经济基本面拉长来看，仍有在地产调控和 ppi 回落的背景下，仍有下行压力，但市场预期较为充分，超预期的因素短期难以见到。央行短期内对于货币政策的定调仍是不松不紧，但由于地方政府的融资行为将被较为严格的规范，叠加前期“去杠杆”对金融机构行为的影响，往后的两个季度整体的融资需求或将出现一定的萎缩。加之同业存单的增量空间有限，这一上半年主导债市的定价因素可能出现下行。综上，相较于长端品种，中短期品种的确定性更大，收益率曲线将陡峭化，杠杆操作仍是较优策略。

本基金将谨慎跟踪债券指数，以及通过对组合的适当调整，争取为持有人谋求长期稳定的正回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

（1）报告期内本基金未实施利润分配。

（2）本基金管理人于 2017 年 7 月 21 日发布《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）2017 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2017 年 7 月 12 日，收益分配方案为嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元；嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	930,071.29	7,543,742.13
结算备付金		5,000.40	5,967,894.87
存出保证金		3,639.93	16,989.45
交易性金融资产	6.4.7.2	792,850,352.20	830,813,205.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		792,850,352.20	830,813,205.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	8,064,000.00
应收利息	6.4.7.5	14,059,633.63	13,914,009.69
应收股利		-	-
应收申购款		269,540.82	146,676.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		808,118,238.27	866,466,517.83
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		196,999,264.50	220,047,069.92
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		67,815.24	1,039,665.53
应付管理人报酬		247,863.21	287,298.06
应付托管费		49,572.63	57,459.63
应付销售服务费		3,273.14	6,359.10
应付交易费用	6.4.7.7	13,862.26	12,512.51
应交税费		-	-
应付利息		120,744.50	326,148.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	343,197.71	410,311.40
负债合计		197,845,593.19	222,186,824.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	545,473,340.73	577,204,934.18
未分配利润	6.4.7.10	64,799,304.35	67,074,759.11
所有者权益合计		610,272,645.08	644,279,693.29
负债和所有者权益总计		808,118,238.27	866,466,517.83

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 基金份额净值 1.1186 元，基金份额总额 533,028,138.29 份；嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 基金份额净值 1.1271 元，基金份额总额 12,445,202.44 份。嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额总额合计为 545,473,340.73 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		5,973,854.26	18,014,751.42
1.利息收入		18,468,230.75	22,323,278.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,283.44	107,947.83
债券利息收入		18,390,261.60	22,215,330.21
资产支持证券利息收入		-	
买入返售金融资产收入		60,685.71	
其他利息收入		-	
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,771,222.47	-455,635.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	-5,771,222.47	-455,635.14
资产支持证券投资收益		-	
贵金属投资收益		-	
衍生工具收益	6.4.7.14	-	
股利收益	6.4.7.15	-	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,747,788.52	-3,943,437.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,634.50	90,546.19
减：二、费用		4,964,812.94	6,157,151.92
1．管理人报酬		1,549,287.68	1,831,190.47
2．托管费		309,857.51	366,238.09

3．销售服务费		38,488.38	102,640.11
4．交易费用	6.4.7.18	3,684.68	10,844.62
5．利息支出		2,770,065.94	3,547,433.70
其中：卖出回购金融资产支出		2,770,065.94	3,547,433.70
6．其他费用	6.4.7.19	293,428.75	298,804.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,009,041.32	11,857,599.50
减：所得税费用		-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,009,041.32	11,857,599.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	577,204,934.18	67,074,759.11	644,279,693.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,009,041.32	1,009,041.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号	-31,731,593.45	-3,284,496.08	-35,016,089.53

填列）			
其中：1.基金申购款	58,624,543.60	7,027,817.43	65,652,361.03
2.基金赎回款	-90,356,137.05	-10,312,313.51	-100,668,450.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	545,473,340.73	64,799,304.35	610,272,645.08
项目	**上年度可比期间** **2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	571,391,768.92	97,698,048.29	669,089,817.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,857,599.50	11,857,599.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	61,695,929.09	10,209,785.45	71,905,714.54
其中：1.基金申购款	222,188,836.56	39,211,943.95	261,400,780.51
2.基金赎回款	-160,492,907.47	-29,002,158.50	-189,495,065.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	633,087,698.01	119,765,433.24	752,853,131.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军	王红	张公允
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1681 号《关于核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,385,420,643.90 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 044 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2013 年 2 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,387,911,308.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,490,664.61 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认(申)购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为两个不同的类别。在投资人认(申)购时收取认(申)购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认(申)购费，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额，称为 C 类基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]105 号文审核同意，本基金 20,676,421.00 份 A 类基金份额于 2013 年 4 月 1 日在深交所挂牌交易。未上市交易的 A 类基金份额托管在场外，A 类基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。C 类基金份额托管在场外，不上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合的资产配置范围为：投资于中证中期企业债指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	930,071.29
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	930,071.29

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	71,200,664.08	69,542,202.20	-1,658,461.88
	银行间市场	749,132,333.43	723,308,150.00	-25,824,183.43
	合计	820,332,997.51	792,850,352.20	-27,482,645.31
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		820,332,997.51	792,850,352.20	-27,482,645.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	162.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.07
应收债券利息	14,059,466.01
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.79
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.53
合计	14,059,633.63

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	13,862.26
合计	13,862.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.64
预提费用	318,190.07

应付指数使用费	25,000.00
其他	-
合计	343,197.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	558,159,922.49	558,159,922.49
本期申购	30,517,262.54	30,517,262.54
本期赎回(以"-"号填列)	-55,649,046.74	-55,649,046.74
本期末	533,028,138.29	533,028,138.29

金额单位：人民币元

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,045,011.69	19,045,011.69
本期申购	28,107,281.06	28,107,281.06
本期赎回(以"-"号填列)	-34,707,090.31	-34,707,090.31
本期末	12,445,202.44	12,445,202.44

注：申购含转换入，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,318,997.34	35,360,337.24	64,679,334.58
本期利润	7,563,405.04	-6,209,465.68	1,353,939.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,285,243.58	-1,530,297.96	-2,815,541.54
其中：基金申购款	2,045,852.89	1,356,454.64	3,402,307.53
基金赎回款	-3,331,096.47	-2,886,752.60	-6,217,849.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,597,158.80	27,620,573.60	63,217,732.40

单位：人民币元

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,200,572.55	1,194,851.98	2,395,424.53
本期利润	193,424.80	-538,322.84	-344,898.04
本期基金份额交易产生的变动数	-448,337.49	-20,617.05	-468,954.54
其中：基金申购款	1,805,277.58	1,820,232.32	3,625,509.90
基金赎回款	-2,253,615.07	-1,840,849.37	-4,094,464.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	945,659.86	635,912.09	1,581,571.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,506.60
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,326.34
其他	1,450.50
合计	17,283.44

6.4.7.12 股票投资收益

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	219,574,383.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	221,435,841.45
减：应收利息总额	3,909,764.81
买卖债券差价收入	-5,771,222.47

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-6,747,788.52
——股票投资	-
——债券投资	-6,747,788.52

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-6,747,788.52

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,911.19
基金转出费收入	2,723.31
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	24,634.50

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	59.68
银行间市场交易费用	3,625.00
合计	3,684.68

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	18,000.00
银行划款手续费	6,638.68
指数使用费	50,000.00
上市年费	29,752.78
红利手续费	-
其他	600.00
合计	293,428.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

2017 年 7 月 21 日，本基金管理人发布《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）2017 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2017 年 7 月 12 日，权益登记日为 7 月 26 日，场内除息日为 2017 年 7 月 27 日，场内红利发放日为 2017 年 7 月 31 日，场外除息日为 7 月 26 日，场外红利发放日为 7 月 28 日。收益分配方案为嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元；嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,549,287.68	1,831,190.47
其中：支付销售机构的客户维护费	26,868.27	66,346.30

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	309,857.51	366,238.09

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	18,971.51	18,971.51
中国银行	-	4,119.54	4,119.54
合计	-	23,091.05	23,091.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	39,506.35	39,506.35
中国银行	-	24,978.95	24,978.95
合计	-	64,485.30	64,485.30

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费＝前一日 C 类基金份额资产净值×0.30%/当年天数。

（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	81,135,000.00	7,169.73

注：本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2017 年 6 月 30 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	930,071.29	14,506.60	20,032,033.32	30,521.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

（1）本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

（2）2017 年 7 月 21 日，本基金管理人发布《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）2017 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2017 年 7 月 12 日，权益登记日为 7 月 26 日，场内除息日为 2017 年 7 月 27 日，场内红利发放日为 2017 年 7 月 31 日，场外除息日为 7 月 26 日，场外红利发放日为 7 月 28 日。收益分配方案为嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元；嘉实中证中期企业债指数（LOF）C 每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 196,999,264.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101654088	16 苏国信 MTN001	2017 年 7 月 4 日	94.73	300,000	28,419,000.00
101654086	16 华能集 MTN005	2017 年 7 月 4 日	95.31	100,000	9,531,000.00
101661011	16 皖交通 MTN001A	2017 年 7 月 4 日	96.54	500,000	48,270,000.00
101654100	16 保利地产 MTN001	2017 年 7 月 4 日	95.22	300,000	28,566,000.00
101664009	16 鲁高速集 MTN001	2017 年 7 月 4 日	96.81	300,000	29,043,000.00
101652022	16 三峡	2017 年 7 月	96.65	200,000	19,330,000.00

	MTN002（5年期）	4 日			
101560022	15 闽高速 MTN002	2017 年 7 月 4 日	102.44	145,000	14,853,800.00
101556009	15 津城建 MTN001	2017 年 7 月 4 日	103.39	110,000	11,372,900.00
1580157	15 九江城投债	2017 年 7 月 7 日	101.35	100,000	10,135,000.00
合计				2,055,000	199,520,700.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，通过严格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偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核

部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年度末：无)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末（2017 年 06 月 30 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	578,269,538.00	469,606,100.00
AAA 以下	181,295,415.60	328,135,105.60
未评级	-	-
合计	759,564,953.60	797,741,205.60

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约

到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	930,071.29	-	-	-	930,071.29
结算备付金	5,000.40	-	-	-	5,000.40
存出保证金	3,639.93	-	-	-	3,639.93
交易性金融资产	42,772,298.60	750,078,053.60	-	-	792,850,352.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	14,059,633.63	14,059,633.63
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	269,540.82	269,540.82

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,711,010.22	750,078,053.60	-	14,329,174.45	808,118,238.27
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	196,999,264.50	-	-	-	196,999,264.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	67,815.24	67,815.24
应付管理人报酬	-	-	-	247,863.21	247,863.21
应付托管费	-	-	-	49,572.63	49,572.63
应付销售服务费	-	-	-	3,273.14	3,273.14
应付交易费用	-	-	-	13,862.26	13,862.26
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	120,744.50	120,744.50
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	343,197.71	343,197.71
负债总计	196,999,264.50	-	-	846,328.69	197,845,593.19
利率敏感度缺口	-153,288,254.28	750,078,053.60	-	13,482,845.76	610,272,645.08
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,543,742.13	-	-	-	7,543,742.13
结算备付金	5,967,894.87	-	-	-	5,967,894.87
存出保证金	16,989.45	-	-	-	16,989.45

交易性金融资产	36,066,105.60	663,790,750.00	130,956,350.00	-	830,813,205.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	8,064,000.00	8,064,000.00
应收利息	-	-	-	13,914,009.69	13,914,009.69
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	146,676.09	146,676.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,594,732.05	663,790,750.00	130,956,350.00	22,124,685.78	866,466,517.83
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	220,047,069.92	-	-	-	220,047,069.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,039,665.53	1,039,665.53
应付管理人报酬	-	-	-	287,298.06	287,298.06
应付托管费	-	-	-	57,459.63	57,459.63
应付销售服务费	-	-	-	6,359.10	6,359.10
应付交易费用	-	-	-	12,512.51	12,512.51
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	326,148.39	326,148.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	410,311.40	410,311.40
负债总计	220,047,069.92	-	-	2,139,754.62	222,186,824.54

利率敏感度缺口	-170,452,337.87	663,790,750.00	130,956,350.00	19,984,931.16	644,279,693.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	6,633,131.55	7,065,394.85
	市场利率上升 25 个基点	-6,553,072.98	-6,977,109.10

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。
(b) 持续的以公允价值计量的金融工具
(i) 各层次金融工具公允价值
于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 792,850,352.20 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：第二层次 830,813,205.60 元，无属于第一、第三层次的余额）。
(ii) 公允价值所属层次间的重大变动
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。
(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
无。
(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具
于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。
(d) 不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。
(2) 增值税
根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。
此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。
(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	792,850,352.20	98.11
	其中：债券	792,850,352.20	98.11
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	935,071.69	0.12
7	其他各项资产	14,332,814.38	1.77
8	合计	808,118,238.27	100.00

7.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

报告期末，本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,259,398.60	2.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,026,000.00	3.28
	其中：政策性金融债	20,026,000.00	3.28
4	企业债券	258,135,953.60	42.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	501,429,000.00	82.16
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	792,850,352.20	129.92

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101561009	15 中电投 MTN002	500,000	49,485,000.00	8.11
2	101661011	16 皖交通 MTN001A	500,000	48,270,000.00	7.91
3	101653029	16 东方电气 MTN001	400,000	38,404,000.00	6.29
4	1480580	14 大连融达债	360,000	36,846,000.00	6.04
5	101456072	14 津城建	300,000	31,374,000.00	5.14

		MTN002			

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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库之外的股票。

7.12.3 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	3,639.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,059,633.63
5	应收申购款	269,540.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	14,332,814.38

7.12.4 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。

7.12.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	947	562,859.70	514,988,653.85	96.62%	18,039,484.44	3.38%
嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	1,413	8,807.65	511,438.20	4.11%	11,933,764.24	95.89%
合计	2,278	239,452.74	515,500,092.05	94.51%	29,973,248.68	5.49%

注：(1)嘉实中证中期企业债 A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证中期企业债 A 份额占嘉实中证中期企业债 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证中期企业债 A 份额占嘉实中证中期企业债 A 总份额比例；

(2)嘉实中证中期企业债 C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证中期企业债 C 份额占嘉实中证中期企业债 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证中期企业债 C 份额占嘉实中证中期企业债 C 总份额比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额

			比例
1	彭雪松	59,100.00	23.41%
2	刘洪峰	46,300.00	18.34%
3	姜子毓	20,000.00	7.92%
4	王滋生	20,000.00	7.92%
5	金挺	16,489.00	6.53%
6	林思特	15,222.00	6.03%
7	金挺	14,891.00	5.90%
8	燕正山	10,000.00	3.96%
9	赵秀玉	9,984.00	3.95%
10	郑秀仙	7,900.00	3.13%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	0
	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	0
	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C
基金合同生效日（2013 年 2 月 5 日）基金份额总额	3,186,105,341.63	1,201,805,966.88
本报告期期初基金份额总额	558,159,922.49	19,045,011.69
本报告期基金总申购份额	30,517,262.54	28,107,281.06
减:本报告期基金总赎回份额	55,649,046.74	34,707,090.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	533,028,138.29	12,445,202.44

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称		股票交易	应支付该券商的佣金	

	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华泰证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	3	-	-	-	-	新增 1 个
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证	1	-	-	-	-	-

券有限责任公司						
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增 2 个
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中泰证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
浙商证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

（1）经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

（2）公司财务状况良好；

（3）有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

（4）有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：平安证券有限责任公司更名为平安证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租深圳交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	32,992,934.24	97.02%	14,900,000.00	100.00%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1,015,079.45	2.98%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加“新浪基金”为嘉实旗下基金代销机构 并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 2 月 21 日
2	关于嘉实旗下部分开放式基金转换业务更新的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 12 日
3	关于增加创金启富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 14 日
4	关于增加北京肯特瑞为嘉实	中国证券报、上海证	2017 年 5 月 31 日

	旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	券报、证券时报、管理人网站	
5	关于增加平安银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 26 日
6	关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 28 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/01/01 至 2017/06/30	514,067,373.05	-	-	514,067,373.05	94.24%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1） 中国证监会批核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）募集的文件；

（2）《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

（3）《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；

（4）《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

（5） 基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6） 报告期内嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

（1）书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日