嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年08月25日

§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2018年8月22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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实定期宝6个月理财债券	
基金主代码	3880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月23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	3,738,573,513.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实定期宝6个月理财债券A / 嘉实定期宝6个月理财债券B	
下属分级基金的交易代码	3880 / 3881	
报告期末下属分级基金的份额总额	50,528,881.09份 / 3,688,044,632.31份	

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金通过对各类资产综合判断,决定各类资产的配置比例并动态调整。在期限配置上,根据对期限利率走势的判断确定并调整组合久期等风险因素。在个券选择方面,本基金综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。同时,通过分析期限市场机会、利取利用市场机会获得超额收益,控制基金组合风险,谋求组合收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的6个月定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为理财债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	胡博敏	王永民
	联系电话	(010)66215668	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	ksd@bank.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)66216689	(010)66594942

2.4 信息披露方式

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6层嘉实基金管理有限公司

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	嘉实定期宝6个月理财债券A	嘉实定期宝6个月理财债券B
本期已实现收益	3,188,172.85	70,216,637.06
本期利润	3,188,172.85	70,216,637.06
本期净值收益率	2.2788%	2.3747%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	50,528,881.09	3,688,044,632.31
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
累计净值收益率	5.2793%	5.5230%

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(3) 嘉实定期宝6个月理财债券A与嘉实定期宝6个月理财债券B适用不同的销售服务费率;(4)本基金收益在基金份额 “6 个月持有周期到期日”集中结转为基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实定期宝6个月理财债券A						
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3542%	0.0007%	0.1062%	0.0000%	0.2480%	0.0007%
过去三个月	1.1165%	0.0011%	0.3225%	0.0000%	0.7940%	0.0011%
过去六个月	2.2788%	0.0009%	0.6426%	0.0000%	1.6362%	0.0009%
过去一年	4.2297%	0.0015%	1.2000%	0.0000%	2.9297%	0.0015%
自基金合同生效起至今	5.2793%	0.0015%	1.6591%	0.0000%	3.6202%	0.0015%

嘉实定期宝6个月理财债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3899%	0.0007%	0.1062%	0.0000%	0.2837%	0.0007%
过去三个月	1.2639%	0.0011%	0.3225%	0.0000%	0.9414%	0.0011%
过去六个月	2.3747%	0.0009%	0.6426%	0.0000%	1.7321%	0.0009%
过去一年	4.4219%	0.0015%	1.2000%	0.0000%	3.1219%	0.0015%
自基金合同生效起至今	5.5230%	0.0015%	1.6591%	0.0000%	3.8639%	0.0015%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

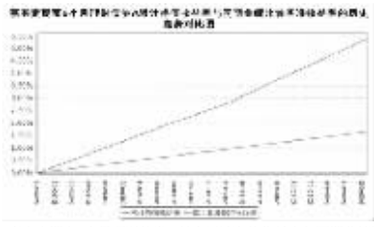

图1:嘉实定期宝6个月理财债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月23日至2018年6月30日)

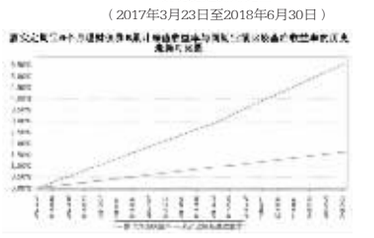

图2:嘉实定期宝6个月理财债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月23日至2018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(十二(二)投资范围和(四)投资限制)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、北京怀柔设有分公司。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2018年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、142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300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合(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)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、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)、嘉实信用债券、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、嘉实快钱货币、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、嘉实惠泽混合(LOF)、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、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。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		
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2017年5月25日	-	8年	曾任Futex Trading Ltd期货交易员、北京科创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员,2012年8月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员、现任副于固定收益业务体系短期alpha策略组、硕士研究生,CFA,具有基金从业资格。
李曈	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活钱包货币、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实现金宝货币、嘉实稳益宝货币、嘉实稳金添利货币基金经理	2017年5月25日	-	8年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务商业务经理,2014年12月加入嘉实基金管理有限公司,现任副于固定收益业务体系短期alpha策略组、硕士研究生,具有基金从业资格。
张文明	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实稳益宝货币、嘉实稳金添利货币基金经理	2017年3月23日	-	10年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部资产市场交易员及投资经理,2014年4月加入嘉实基金管理有限公司,现任副于固定收益业务体系短期alpha策略组、硕士,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理张文明的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理李金灿、李曈的任职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。(3)本基金基金经理张文明女士休产假,在其休假期间,本基金暂由我公司基金经理李金灿先生、李曈先生代为履行基金经理职责。该事项已于2017年7月5日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露;(4)本基金基金经理张文明女士已结束休假,自2018年1月12日起恢复履行基金经理职务。该事项已于2018年1月12日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

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、《嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金基金合同》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4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

2018年上半年,全球经济出现的风险点和困难日益增多,主要经济体增长速度回落、通胀水平抬升,紧缩货币政策周期开始。美国贸易保护主义逐渐强化,对中国、欧盟等国家和地区均发起贸易挑战,全球经济复苏进程受到冲击。2018年上半年,美国经济增长相对平稳,美联储延续了渐进加息的操作,加上特朗普多项政策实施,资金从新兴市场国家回流至美国。欧洲经济则表现出相对疲弱,经济增长的动能减缓,货币政策收紧节奏较慢。日本经济增长较为平稳,货币宽松有所收敛。新兴市场经济体,受美联储加息和资本外流等影响,大部分上半年波动较大,风险显现较多。整体来看,2018年上半年全球经济形势较2018年有所弱化。

2018年上半年,在面临中美贸易摩擦和国内金融稳杠杆的背景下,我国经济形势整体相对稳健,供给侧改革扎实推进,但是经济下行压力和债务风险问题日益严重。上半年GDP增速达到了6.8%,与去年全年持平,但名义GDP增速略有下降。分季度看,一季度同比增长6.8%,二季度增长6.7%。具体来看,工业增加值稳中有降,上半年同比增速均值为6.52%,低于去年同比增速均值6.58%;“克强指数”前五个月均值为7.02%, 明显低于去年均值11.52%; 中国制造业采购经理指数(PMI)均值站到荣枯线以上,上半年均值为51.32%,低于去年均值51.61%。以投资、消费和出口为代表的“三驾马车”增速均呈现回落,固定资产投资整体呈现回落态势,上半年累计同比增速均值为5.75%,低于去年均值7.46%,其中房地产开发投资因统计口径因素整体相对维稳,上半年累计同比增速均值为6.98%,略高于去年均值6.0%,基础设施投资大幅回落,上半年累计同比增速均值为4%,低于去年均值15.58%,民间固定资产投资低位徘徊,上半年累计同比增速为6.98%,高于去年均值6.0%;社会消费品零售总额也呈现回落,上半年同比增速均值为7.78%,低于去年均值9.43%;受国际市场需求回暖等影响,出口形势整体略有好转,出口金额上半年同比增速均值分别为14.42%,高于去年均值7.65%。另外,上半年价格水平整体出现温和小幅上行,全国居民消费价格总水平同比增速均值为2.00%,高于去年均值1.55%;上半年PPI同比增速为3.88%,低于去年均值6.33%。从金融数据来看,货币供应量整体依然处于高位,M2全年同比增速均值为12.04%,略低于去年均值12.32%; 社会融资规模持续走低,上半年新增规模均值为1.52万亿元,低于去年均值1.62万亿元;新增人民币贷款继续上升,上半年新增均值为1.50万亿元,高于去年均值1.13万亿元。全上半年人民币汇率整体呈现先升后贬走势,CNY上年累计贬值1.73%,CNH上年累计贬值1.87%,上半年央行外汇资产新增为405亿元,去年同期大幅减少4272亿元,跨境资金流出规模在管控下明显减少。

由去杠杆向稳杠杆过度,叠加应对经济下行风险, 央行货币政策整体维持稳健,边际放松,政策节奏呈现渐进放松,上半年央行定向降准2次,央行还通过公开市场操作、国库现金定存、MLF和PSL等政策工具适时补充和调节市场流动性,上半年公开市场操作(含国库现金定存)累计净投放资金2790亿元。银行间市场资金利率震荡下落,2018年半年末隔夜、7天、1个月和3个月回购加权利率较去年末分别-43BP、-184BP、-189BP和-153BP;银行间市场国债收益率曲线呈现下移,2018年上半年末国债收益率曲线1年、3年、5年、7年和10年期收益率较去年末分别-63BP、-47BP、-49BP、-41BP和-41BP,10年期与1年期国债期限利差为32BP,较去年末扩大13BP。

2018年上半年,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性和流动性为首要任务;灵活配置债券、同业存单和同业存款,管理现金流分布,保障组合充足流动性;控制债券整体仓位。整体看,2018年上半年本基金成功应对了市场波动,投资业绩平稳提高,实现了安全性、流动性和收益性的目标,并且整体组合的持仓结构相对安全,流动性和弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实定期宝6个月理财债券A的基金份额净值收益率为2.2788%,嘉实定期宝6个月理财债券B的基金份额净值收益率为2.3747%, 业绩比较基准收益率为0.6426%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

IMF最新版的《世界经济展望报告》指出,国际货币基金组织预计2018年和2019年全球经济增长将达到3.9%,与今年4月的预测值一样。与此同时,报告继续维持对美国经济今明两年增长2.9%和2.7%的预测,但下调了欧元区国家以及英国和日本的增长预期。国际货币基金组织在报告中表示,尽管维持最近两年全球经济增速不变的预期,但经济下行风险正在增加,而最大的威胁来自于美国引起的全球贸易紧张局势。报告指出,美国最近宣布的提高关税政策以及来自贸易伙伴的反制措施,有可能使紧张局势持续升级,从而对资源配置和生产率产生直接影响,也将导致全球经济增长下降。

2018年下半年, 除美国之外全球主要经济体的经济增长都将受到贸易战影响。预计2018年美国GDP增速将高于3%,甚至达4%。而2018年欧元区的GDP增速将低于2%,达1-1.5%之间。而日本的GDP增速将低于1%,可能为负。而新兴经济体则受贸易争端引起的全球经济和进出口低迷以及美元强势升值而带来的国内经济波动和增速下滑。国内经济下行压力较大,目前固定资产投资、消费和社融以及M2增速均创历史新低,在中美贸易战背景下,贸易顺差逐步收窄。在国内经济风险隐患突显和中美升级的贸易战背景下,下半年经济完成年度GDP增速6.5%目标压力较大。

在经济下行周期,2018年信用风险继续曝露,违约范围和金额继续扩大。2018年上半年,信用债市场共出现27只违约债券,涉及违约主体15家,违约额度总计266.27亿元。其中,10家违约主体为2018年首次违约主体,新增违约主体基本都为民企。

今年以来,货币政策边际放松,央行一季度货币政策执行报告中将“去杠杆”转为“稳杠杆”;央行货币政策二季度例会释放信号,稳健的货币政策保持中性,要松紧适度,保持流动性合理充裕,管好货币供给总闸门,引导货币信贷及社会融资规模合理增长。7月23日,国务院常务会议部署更好发挥财政金融政策作用,支持扩内需调结构促进实体经济发展,同时还推出了推动有效投资的措施。国务院常务会议明确指出,财政金融政策要协同发力,更有效服务实体经济,更有力服务宏观大局。一是积极财政政策要更加积极。二是稳健的货币政策要松紧适度。三是加快国家融资担保基金出资到位, 努力实现每年新增支持15万家(次)小微企业和1400亿元贷款目标。四是坚决出清“僵尸企业”,减少无效资金占用。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性和流动性为首要任务,兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,平衡配置同业存款和债券投资,谨慎控制组合的信用配置,保持合理流动性资产配置,细致管理现金流,以控制利率风险和应对组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

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

根据本基金基金合同第十六部分(三)收益分配原则的约定:“3. 本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,在基金份额“6 个月持有周期到期日”集中支付。”、“ 5.本基金每日进行收益计算并分配时,在基金份额“6 个月持有周期到期日”累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式”的内容,本期A类份额已实现收益为3,188,172.85元,每日分配,到期支付,合计分配3,188,172.85元,B类份额已实现收益为70,216,637.06元,每日分配,到期支付,合计分配70,216,637.06元,符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

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”)在嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金(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、基金净值收益率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:嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	2,521,191,062.27	1,001,139,431.36
结算备付金		227,272.73	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,763,502,425.80	609,853,212.90
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,763,502,425.80	609,853,212.90
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	90,000,255.00	149,960,344.94
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	40,391,989.73	6,379,618.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,415,312,996.53	1,767,332,607.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		632,298,611.55	224,533,023.20
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		936,493.72	227,364.90
应付托管费		312,164.57	75,788.33
应付销售服务费		39,709.26	46,643.22
应付交易费用	6.4.7.7	30,103.87	13,376.86
应交税费		16,313.35	-
应付利息		690,763.26	127,691.97
应付利润		42,211,461.57	5,185,972.46
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,860.99	184,500.00
负债合计		676,739,482.13	230,394,272.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,738,573,513.40	1,536,938,334.56
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,738,573,513.40	1,536,938,334.56
负债和所有者权益总计		4,415,312,996.53	1,767,332,607.47

注:报告截止日2018年6月30日,嘉实定期宝6个月理财债券A基金份额总额50,528,881.09份,份额净值1.0000元;嘉实定期宝6个月理财债券B基金份额总额3,688,044,632.31份, 份额净值1.0000元。基金份额总额合计为3,738,573,513.40份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月23日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
一、收入		88,743,330.44	23,815,991.96
1.利息收入		88,316,321.26	23,829,827.09
其中:存款利息收入	6.4.7.11	56,840,535.44	23,170,751.83
债券利息收入		29,307,336.56	689,075.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,168,449.26	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		427,009.19	-13,847.50
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	427,009.19	-13,847.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	-	12.37
减:二、费用		15,338,520.53	2,987,202.98
1. 管理人报酬		4,625,561.18	1,596,148.37
2. 托管费		1,541,854.41	532,048.43
3. 销售服务费		284,493.13	825,206.08
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		8,648,471.44	-
其中:卖出回购金融资产支出		8,648,471.44	-
6. 税金及附加		3,306.04	-
7. 其他费用	6.4.7.15	234,848.33	33,802.10
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		73,404,809.91	20,828,788.98
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		73,404,809.91	20,828,788.98

注:本基金合同生效日为2017年3月23日,上年度可比期间是指2017年3月23日至2017年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018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)	1,536,938,334.56	-	1,536,938,334.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	73,404,809.91	73,404,809.91
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)	2,201,635,178.85	-	2,201,635,178.85
其中:1.基金申购款	2,676,161,309.24	-	2,676,161,309.24
2.基金赎回款	-474,526,130.39	-	-474,526,130.39
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)	-	-73,404,809.91	-73,404,809.91
五、期末所有者权益(基金净值)	3,738,573,513.40	-	3,738,573,513.40

项目	上年度可比期间 2017年03月23日(基金合同生效日)至 2017年06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)	1,959,039,948.99	-	1,959,039,948.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,828,788.98	20,828,788.98
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)	24,253,491.41	-	24,253,491.41
其中:1.基金申购款	24,253,491.41	-	24,253,491.41
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-20,828,788.98	-20,828,788.98
五、期末所有者权益(基金净值)	1,983,293,440.40	-	1,983,293,440.40

注:本基金合同生效日为2017年3月23日,上年度可比期间是指2017年3月23日至2017年6月30日。

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:

经雷王红张公允

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 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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、基金注册登记机构、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

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月23日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,625,561.18	1,596,148.37
其中:支付销售机构的客户维护费	114,292.26	966,425.86

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0.30%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×0.30% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月23日(基金合同生效日)至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,541,854.41	532,048.43

注: