

嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金

嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金... 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金... 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金...

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

注: (1) 基金经理曲杨的任职日期是指本基金合同生效之日, 基金经理崔思维的任职日期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 管理人对于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、《嘉实稳熙纯债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。

4.3 管理人对于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政策和流程独立决策, 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。

4.4 管理人对于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
报告期内, 债券市场触底反弹, 长端利率债收益率自年初高点呈一路下行动态。年初在全球通胀和加息预期走强的背景下, 收益率大幅走高。1月下旬到2月, 资金面超预期宽松且基本维持平稳; 二季度初经济数据显示, 春节后开工持续偏弱, 生产经营预期下降, 中美贸易战有愈演愈烈的趋势, 引致风险偏好下降, 经济预期上升, 而后央行超市场预期进行“置换式降准”, 债券收益率大幅下行。4月底资管新规正式出台, 带来实体经济融资趋紧, 信用收缩成为市场主基调。5月中旬, 受到油价创新高、美债收益率回升, 国内信用债违约事件频现等多项利空因素刺激, 债市持续回调。6月受金融数据、经济数据不及预期, 央行第二次宣布降准准备金影响, 利率品种得以进一步上涨。但信用利差扩大的趋势短期内依然难以缓解, 风险偏好持续维持在低位。整体看, 上半年流动性宽松叠加主动信用收缩, 带来利率的整体走低, 但品种之间分化加大。

4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0163元, 本报告期基金份额净值增长率为3.39%, 业绩比较基准收益率为2.99%。

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

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
(1) 本基金基金管理人于2018年3月20日发布《嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金2018年第一次收益分配公告》, 收益分配基准日为2018年3月8日, 每10份基金份额发放现金红利0.1610元, 具体参见本报告“6.4.1.1 利润分配情况”。

分配公告》, 收益分配基准日为2018年3月8日, 每10份基金份额发放现金红利0.1610元, 具体参见本报告“6.4.1.1 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于2018年5月18日发布《嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金2018年第二次收益分配公告》, 收益分配基准日为2018年5月8日, 每10份基金份额发放现金红利0.1670元, 具体参见本报告“6.4.1.1 利润分配情况”。

(3) 本基金的基金管理人于2018年8月10日发布《嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金2018年第三次收益分配公告》, 收益分配基准日为2018年7月31日, 每10份基金份额发放现金红利0.1440元, 具体参见本报告“6.4.1.1 利润分配情况”。

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况的说明
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, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 其他尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内本基金实施利润分配的金额: 163.975, 827.40元。

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

本托管人复核审查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。

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: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年6月30日

Table with columns: 资产, 负债, 所有者权益. Shows financial statements for the fund.

注: (1) 基金管理人于2018年6月30日, 按照公允价值对基金资产进行估值, 公允价值计量所使用的估值技术为市场报价法。

6.2 利润表

会计主体: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows profit and loss statements for the fund.

注: 本报告期基金管理人于2018年6月30日, 按照公允价值对基金资产进行估值, 公允价值计量所使用的估值技术为市场报价法。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows changes in equity for the fund.

注: 本基金合同生效日为2017年3月16日, 上年度可比期间是指2017年3月16日至2017年6月30日。

6.4 现金流量表

会计主体: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows cash flow statements for the fund.

注: 本基金合同生效日为2017年3月16日, 上年度可比期间是指2017年3月16日至2017年6月30日。

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows changes in equity for the fund.

注: 本基金合同生效日为2017年3月16日, 上年度可比期间是指2017年3月16日至2017年6月30日。

6.6 现金流量表

会计主体: 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
报告截止日: 2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows cash flow statements for the fund.

注: 本基金合同生效日为2017年3月16日, 上年度可比期间是指2017年3月16日至2017年6月30日。

2018年半年度报告摘要

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所有关联方

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
6.4.4.1.1 股票交易
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16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 关联方承销
6.4.4.2.1 基金管理费

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Shows management fees for the fund.

注: 支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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16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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.4.4.6 基金托管人报酬

6.4.4.7 基金管理人报酬

6.4.4.8 基金管理人报酬

6.4.4.9 基金管理人报酬

6.4.4.10 基金管理人报酬

6.4.4.11 基金管理人报酬

6.4.4.12 基金管理人报酬

6.4.4.13 基金管理人报酬

6.4.4.14 基金管理人报酬

6.4.4.15 基金管理人报酬

6.4.4.16 基金管理人报酬

6.4.4.17 基金管理人报酬

6.4.4.18 基金管理人报酬

6.4.4.19 基金管理人报酬

6.4.4.20 基金管理人报酬

6.4.4.21 基金管理人报酬

6.4.4.22 基金管理人报酬

6.4.4.23 基金管理人报酬

6.4.4.24 基金管理人报酬

6.4.4.25 基金管理人报酬

6.4.4.26 基金管理人报酬

6.4.4.27 基金管理人报酬

6.4.4.28 基金管理人报酬

6.4.4.29 基金管理人报酬

6.4.4.30 基金管理人报酬

6.4.4.31 基金管理人报酬

6.4.4.32 基金管理人报酬

6.4.4.33 基金管理人报酬

6.4.4.34 基金管理人报酬

6.4.4.35 基金管理人报酬

6.4.4.36 基金管理人报酬

6.4.4.37 基金管理人报酬

6.4.4.38 基金管理人报酬

6.4.4.39 基金管理人报酬

6.4.4.40 基金管理人报酬

6.4.4.41 基金管理人报酬

6.4.4.42 基金管理人报酬

6.4.4.43 基金管理人报酬

6.4.4.44 基金管理人报酬

6.4.4.45 基金管理人报酬

6.4.4.46 基金管理人报酬

6.4.4.47 基金管理人报酬

6.4.4.48 基金管理人报酬

6.4.4.49 基金管理人报酬

6.4.4.50 基金管理人报酬

6.4.4.51 基金管理人报酬

6.4.4.52 基金管理人报酬

6.4.4.53 基金管理人报酬

6.4.4.54 基金管理人报酬

6.4.4.55 基金管理人报酬

6.4.4.56 基金管理人报酬

金额单位: 人民币元

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注: 报告期末, 本基金仅持有上述2只资产支持证券。

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

7.9 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权证投资明细

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期末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 报告期末本基金投资的前十名股票, 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

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Shows other assets.

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.1 报告期末, 本基金未持有股票。

8.2 报告期末, 本基金未持有股票。

8.3 报告期末, 本基金未持有股票。

8.4 报告期末, 本基金未持有股票。

8.5 报告期末, 本基金未持有股票。

8.6 报告期末, 本基金未持有股票。

8.7 报告期末, 本基金未持有股票。

8.8 报告期末, 本基金未持有股票。

8.9 报告期末, 本基金未持有股票。

8.10 报告期末, 本基金未持有股票。

8.11 报告期末, 本基金未持有股票。

8.12 报告期末, 本基金未持有股票。

8.13 报告期末, 本基金未持有股票。

8.14 报告期末, 本基金未持有股票。

8.15 报告期末, 本基金未持有股票。

8.16 报告期末, 本基金未持有股票。

8.17 报告期末, 本基金未持有股票。

8.18 报告期末, 本基金未持有股票。

8.19 报告期末, 本基金未持有股票。

8.20 报告期末, 本基金未持有股票。

8.21 报告期末, 本基金未持有股票。

8.22 报告期末, 本基金未持有股票。

8.23 报告期末, 本基金未持有股票。

8.24 报告期末, 本基金未持有股票。

8.25 报告期末, 本基金未持有股票。

8.26 报告期末, 本基金未持有股票。

8.27 报告期末, 本基金未持有股票。

8.28 报告期末, 本基金未持有股票。

8.29 报告期末, 本基金未持有股票。

8.30 报告期末, 本基金未持有股票。

8.31 报告期末, 本基金未持有股票。

8.32 报告期末, 本基金未持有股票。

8.33 报告期末, 本基金未持有股票。

8.34 报告期末, 本基金未持有股票。

8.35 报告期末, 本基金未持有股票。

8.36 报告期末, 本基金未持有股票。

8.37 报告期末, 本基金未持有股票。

8.38 报告期末, 本基金未持有股票。

8.39 报告期末, 本基金未持有股票。

8.40 报告期末, 本基金未持有股票。

8.41 报告期末, 本基金未持有股票。

8.42 报告期末, 本基金未持有股票。

8.43 报告期末, 本基金未持有股票。

8.44 报告期末, 本基金未持有股票。

8.45 报告期末, 本基金未持有股票。

8.46 报告期末, 本基金未持有股票。

8.47 报告期末, 本基金未持有股票。

8.48 报告期末, 本基金未持有股票。

8.49 报告期末, 本基金未持有股票。

8.50 报告期末, 本基金未持有股票。

8.51 报告期末, 本基金未持有股票。

8.52 报告期末, 本基金未持有股票。