

## 嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司  
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。

基金托管人中国邮政储蓄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       | 嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 嘉实丰安6个月定期债券          |
| 基金代码       | 004930               |
| 基金运作方式     | 契约型封闭式               |
| 基金合同生效日期   | 2016年12月29日          |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,500,066,746.00份    |
| 基金合同存续期限   | 不定期                  |

## 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金通过综合分析国内外宏观经济走势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并综合考虑资产配置策略下各资产类别经济形势下的估值水平,调整投资组合期限结构特征,符合本基金资产配置比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和配置比例,在风险收益之上实现风险和收益的最佳组合,以期获得较高的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数全价收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金,属于混合基金。   |

## 2.3 基金管理人及基金托管人

| 项目    | 基金管理人        | 基金托管人           |
|-------|--------------|-----------------|
| 名称    | 嘉实基金管理有限公司   | 中国邮政储蓄银行股份有限公司  |
| 注册地址  | 北京市朝阳区望京东路2号 | 北京市西城区宣武门大街131号 |
| 法定代表人 | 刘峰           | 李国华             |
| 负责人   | 曹伟           | 曹伟              |
| 电话    | 010-59198888 | 010-68881111    |
| 传真    | 010-59198888 | 010-68881111    |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                              |
|-------------------|------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的互联网网址 | http://www.jsfund.cn         |
| 基金半年度报告备置地点       | 北京市建国门内大街18号华润大厦8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 本期数据和指标(本期指2018年01月01日至2018年06月30日) |                  |
| 本期已实现收益                                   | 24,894,756.07    |
| 本期利润                                      | 49,176,273.31    |
| 加权平均基金份额本期利润                              | 0.0328           |
| 本期加权平均净值增长率                               | 3.25%            |
| 本期基金份额净值增长率                               | 3.27%            |
| 3.1.2 期末数据指标                              |                  |
| 期末可供分配利润                                  | 48,039,307.88    |
| 期末可供分配基金份额利润                              | 0.0320           |
| 期末基金资产净值                                  | 1,563,504,340.29 |
| 期末基金份额净值                                  | 1.0366           |
| 3.1.3 累计净值指标                              |                  |
| 自基金合同生效以来净值增长率                            | 5.30%            |

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;(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表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

| 比较        | 份额净值增长率① | 业绩比较基准收益率② | ①-②    | ③-④    |
|-----------|----------|------------|--------|--------|
| 过去一个月     | 0.57%    | 0.04%      | 0.07%  | -0.34% |
| 过去三个月     | 1.48%    | 0.06%      | 1.76%  | -0.28% |
| 过去六个月     | 3.27%    | 0.06%      | 2.99%  | -0.07% |
| 过去一年      | 3.0%     | 0.06%      | 1.1%   | -0.06% |
| 自基金合同生效以来 | 5.32%    | 0.04%      | -0.94% | 0.10%  |

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

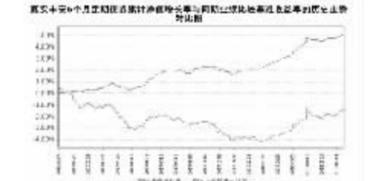


图:嘉实丰安6个月定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月29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)的有关规定。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人的基本情况

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月26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(ODI)、嘉实研究精选混合、嘉实多策略混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本50指数(LOF)、嘉实优化红利混合、嘉实固收增强债券、嘉实H股指数(ODI-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(ODI-POF-LOF)、嘉实信用增强、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(ODI)、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、嘉实中债中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中债中期国债ETF、嘉实中证红利中期国债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(ODI)、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A/B、嘉实活期货币、嘉实1个月理财债券、嘉实货币混合、嘉实泰和混合、嘉实薪金货币、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、嘉实定向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实研究驱动股票、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、嘉实稳健纯债债券、嘉实瑞瑞纯债债券、嘉实新常

态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实精选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实沪深深精选股票、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、嘉实策略优选混合、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、嘉实信用增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实安心货币、嘉实增益货币、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、嘉实沪深港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油(ODI-LOF)、嘉实前沿科技沪深港股票、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、嘉实合润双债两年定期债券、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(POF)、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、嘉实现金添利货币和嘉实债券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            | 聘任日期   |   |
| 王亚伟 | 本基金基金经理、嘉实中证中大型企业混合基金经理、嘉实中证中大型企业股票ETF、嘉实中证红利ETF联接、嘉实中证红利ETF联接、嘉实稳健债券、嘉实稳怡债券、嘉实稳宏债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券 | 2016年12月19日     | -      | 曾任国泰基金管理有限责任公司基金经理,2004年4月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部任基金经理,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰安6个月定期开放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,本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,投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资建议、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%,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  
今年以来债券市场收益率大幅下行。年初在全球通胀和加息预期走强的背景下,收益率明显走高。1月下旬,央行针对春节期间资金面开展临时准备金调用制度,2月春节前后资金面超预期宽松,而两季期间以及一季度末资金面也保持平稳;此外,监管政策并未落地,中美贸易战风波、节后复工缓慢和大宗商品下跌引发基本面预期的下行。多种因素叠加带动长端利率债和中等等级信用债收益率大幅下行,市场也修复年初对于经济过分乐观的预期,二季度信用收缩情况加剧,地方政府规范融资的举措下,社融进一步下滑,其中表外部分压力更大。另一方面,二季度央行两次降准,公开市场利率也没有跟随美联储加息而上调,保持总体流动性充裕,资管新规过渡期也于2019年6月底延迟到2020年末。上半年,债市交投结构都总体较好,不过不同信用资质品种之间分化仍较大。

组合运作期内保持积极主动的操作,年初市场调整后逐渐增加组合久期杠杆,并调整组合持仓结构,降低组合的信用风险暴露,更为积极的承担久期风险,尤其在二季度,提升组合利率债仓位,组合整体在上半年运作良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.0366元;本报告期基金份额净值增长率为3.27%,业绩比较基准收益率为2.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望下半年,经济仍存在一定下行压力。在稳杠杆的大背景下,地方政府的投资意愿仍难明显恢复,房地产投资分项中的上半年正贡献最大的土地购置费有一定的下行压力;消费上看,居民部门的负债能力有所减弱,市场对消费开始体现出效应,进出口在贸易战的氛围中也存在不确定性。整体宏观环境对利率尤其是无风险利率仍将是正面影响,不过在半年维度,我们需要关注几个边际上的变化是不是会成为潜在的风险点,主要包括,低库存、高新开工下地产投资的韧性,财政政策尤其在政策节奏方面是否会有一些变化,此外汇率对国内政策的制约也比上半年增加,综上,我们整体对市场的判断偏正面,但市场的表现将明显小于上半年,相对价值的头寸可能会对组合的表现有更大的帮助。

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及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验。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,基金经理兼任估值专业委员会委员,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(十六(三)基金收益分配原则)约定,报告期内本基金未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关规定。

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,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在嘉实丰安6个月定期开放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约定,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。本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

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、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:嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金  
报告截止日:2018年6月30日

| 资产         | 附注号              | 本期末<br>2018年6月30日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|------------|------------------|-------------------|---------------------|
| 资产:        |                  |                   |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1          | 1,574,688.20      | 4,879,467.21        |
| 结算备付金      |                  | 12,482,220.46     | 8,860,339.14        |
| 存出保证金      |                  | 47,269.69         | 46,370.42           |
| 交易保证金      | 6.4.7.2          | 1,996,879,800.00  | 1,989,689,414.40    |
| 其中:融资融券    |                  | -                 | -                   |
| 其他应收款      |                  | -                 | -                   |
| 债券投资       |                  | 1,996,879,800.00  | 1,989,689,414.40    |
| 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    |                  | -                 | -                   |
| 应收利息       | 6.4.7.5          | 38,848,793.51     | 31,170,202.39       |
| 应收股利       |                  | -                 | -                   |
| 应收申购款      |                  | -                 | -                   |
| 其他资产       |                  | -                 | -                   |
| 资产总计       | 2,048,832,793.06 | 1,625,344,763.06  |                     |
| 负债和所有者权益:  |                  |                   |                     |
| 负债:        |                  |                   |                     |
| 短期借款       |                  | -                 | -                   |
| 交易性金融负债    |                  | -                 | -                   |
| 应付短期融资款    | 6.4.7.3          | -                 | -                   |
| 卖出回购金融资产款  |                  | 494,128,200.81    | 119,999,620.00      |
| 应付证券清算款    |                  | -                 | -                   |
| 应付赎回款      |                  | -                 | -                   |
| 应付管理人报酬    |                  | 381,484.63        | 381,433.03          |
| 应付托管费      |                  | 127,166.30        | 129,477.70          |
| 应付销售服务费    |                  | -                 | -                   |
| 应付利息       | 6.4.7.7          | 26,810.42         | 29,363.16           |
| 应付股利       |                  | -                 | -                   |
| 其他负债       |                  | 119,603.04        | -                   |
| 应付利息       | 312,728.57       | 79,220.80         |                     |
| 应付利润       |                  | -                 | -                   |
| 递延所得税负债    |                  | -                 | -                   |
| 其他负债       | 6.4.7.8          | 193,386.69        | 380,000.00          |
| 负债合计       | 495,328,418.66   | 121,016,714.58    |                     |
| 所有者权益:     |                  |                   |                     |
| 实收基金       | 6.4.7.9          | 1,500,066,746.00  | 1,500,066,746.00    |
| 未分配利润      | 6.4.7.10         | 53,427,594.29     | 4,268,002.36        |
| 所有者权益合计    | 1,543,944,340.29 | 1,504,328,068.96  |                     |
| 负债和所有者权益总计 | 2,048,832,793.06 | 1,625,344,763.06  |                     |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0366元,基金份额总额1,500,066,746.00份。

## 6.2 利润表

会计主体:嘉实丰安6个月定期开放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

| 项目                          | 附注号      | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------------------|----------|----------------------|---------------------------------|
| 一、收入                        |          | 59,829,393.63        | 30,823,066.01                   |
| 1.利息收入                      |          | 41,311,969.34        | 31,834,660.61                   |
| 其中:存款利息收入                   | 6.4.7.11 | 54,696.77            | 36,030.31                       |
| 债券利息收入                      |          | 41,263,696.62        | 29,620,519.60                   |
| 资产支持证券投资收入                  |          | -                    | -                               |
| 买入返售金融资产收入                  |          | 3,686.08             | 4,800,322.94                    |
| 2.投资收益(损失以“-”填列)            |          | -6,754,080.96        | 169,915.76                      |
| 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 | -6,754,080.96        | 169,915.76                      |
| 其他投资收益                      |          | -                    | -                               |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)       |          | -                    | -                               |
| 4.其他收入(损失以“-”号填列)           | 6.4.7.17 | 2,274,887.29         | 2,242,159.64                    |
| 二、费用                        |          | 10,663,120.31        | 9,576,443.21                    |
| 1.管理人报酬                     |          | 2,274,887.29         | 2,242,159.64                    |
| 2.托管费                       |          | 758,285.77           | 747,388.64                      |
| 3.销售服务费                     |          | -                    | -                               |
| 4.交易费用                      | 6.4.7.18 | 19,893.89            | 28,261.40                       |
| 5.利息支出                      |          | 7,302,214.21         | 4,514,261.52                    |
| 其中:卖出回购金融资产支出               |          | 7,302,214.21         | 4,514,261.52                    |
| 6.税金及附加                     |          | 89,466.63            | -                               |
| 7.其他费用                      | 6.4.7.19 | 211,988.69           | 44,383.76                       |
| 其中:计提的“应付赎回款”、“应付利息”、“应付股利” |          | 49,176,273.31        | 23,347,512.80                   |
| 8.其他                        |          | -                    | -                               |
| 三、净利润(净亏损以“-”号填列)           |          | 49,176,273.31        | 23,347,512.80                   |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0366元,基金份额总额1,500,066,746.00份。

## 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实丰安6个月定期开放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

| 项目                                      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>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)                         | 1,500,066,746.00           | 4,261,320.98                    | 1,504,328,068.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)                | -                          | -                               | -                |
| 三、本期基金份额交易产生的基金份额变动数(净值减少以“-”号填列)       | -2,001                     | -2,001                          | -2,001           |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金份额变动数(净值减少以“-”号填列) | -                          | -                               | -                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                         | 1,500,066,746.00           | 53,427,594.29                   | 1,563,504,340.29 |

| 项目                                      | 上年度可比期间<br>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)                         | 1,500,067,749.45                | 91,294.92     | 1,500,159,044.37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)                | -                               | 23,347,512.80 | 23,347,512.80    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金份额变动数(净值减少以“-”号填列)       | -690.46                         | -105.09       | -1,015.04        |
| 其中:1.基金申购款                              | -                               | -             | -                |
| 2.基金赎回款                                 | -690.46                         | -105.09       | -1,015.04        |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金份额变动数(净值减少以“-”号填列) | -                               | -             | -                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                         | 1,500,066,750.00                | 23,438,792.13 | 1,523,505,542.13 |

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:

雷磊

王虹

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 报告