

## 嘉实增强收益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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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,应阅读半年度报告全文。

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	嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强收益定期债券
基金代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年09月24日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金总份额	76,106,343.24份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	嘉实增强收益定期债券A 嘉实增强收益定期债券C
下属分级基金的交易代码	070023 070023C
报告期末下开分级基金的份额	76,087,082.79份 41,492.45份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的风险管理控制下,力争实现长期资本增值,以谋求长期投资回报。
投资策略	本基金在债券类资产中,综合考虑信用资质、流动性、久期、收益率等因素,优选AAA级及以上信用评级、期限、收益率具有优势的债券品种,并适度参与可转债投资。在固定收益类资产中,通过信用下沉、期限下沉、行业配置调整及自下而上挖掘等方式,寻找具有超额收益的个券。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率
风险提示	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

## 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	招商银行股份有限公司
住所	北京经济技术开发区东兴南路9号	深圳市福田区深南大道1286号
办公地址	北京市朝阳区望京东路26号院2号楼19层	深圳市福田区深南大道1286号
联系人	电子信箱:service@gsfund.com	招商银行股份有限公司
电话	400-600-8800	95568
传真	8719021568	8779021631

## 2.4 信息披露方式

本基金半年度报告正文及财务报表互联网网址	http://www.gsfund.com
基金半年度报告备查地点	北京望京东路26号院2号楼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	报告期期初至本报告期末(2018年01月01日至2018年06月30日)	报告期期初至本报告期末(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期已实现收益	970,494.92	604.80
本期利润	47,063.91	-65.08
加权平均基金份额本期收益	0.0004	-0.0011
本期加权平均净值增长率	0.00%	-0.11%
本报告期末基金份额净值	0.9996	-0.0301
3.1.2 期末数据和指标	本报告期末(2018年06月30日)	本报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	-2,228,233.33	-947.50
期末可供分配基金份额净值	-0.0228	-0.0123
期末基金资产净值	76,276,027.98	41,300.05
期末基金份额净值	1.0003	0.9996
3.1.3 累计期末数据	本报告期末(2018年06月30日)	本报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	34.43%	63.9%

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)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;(3)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;(4)自2015年9月22日起本基金增加C类基金份额类别;(5)嘉实增强收益定期债券A收取认(申)购费,嘉实增强收益定期债券C不收取认(申)购费。

## 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

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	1 ④	⑤-④
过去一个月	-0.83%	0.17%	-1.00%	-0.00%	0.16%
过去三个月	-0.89%	0.16%	-1.05%	-0.07%	0.08%
过去六个月	0.15%	0.15%	0.00%	-0.00%	0.15%
过去一年	0.66%	0.14%	0.52%	0.01%	0.09%
过去三年	9.80%	0.16%	9.64%	0.00%	0.02%
自基金合同生效至今	34.43%	0.20%	34.23%	0.00%	0.11%

## 嘉实增强收益定期债券C

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	1 ④	⑤-④
过去一个月	-0.00%	0.16%	-0.16%	0.00%	0.16%
过去三个月	-1.09%	0.14%	-1.23%	-0.07%	0.07%
过去六个月	-0.16%	0.17%	-0.33%	0.00%	-0.13%
过去一年	0.06%	0.14%	-0.08%	0.00%	0.08%
自基金合同生效至今	63.9%	0.16%	63.74%	0.00%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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“第十三部分(二)投资范围及(六)投资禁止行为与限制”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(L)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(ODI)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(L)、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、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、嘉实中债企业债指数(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、嘉实中证金债中期国债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、嘉实货币宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱货币、嘉实泰和混合、嘉实新金货币、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指数研究增强混合、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、嘉实保偏债股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新能源汽车灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实超祥纯债债券、嘉实瑞福纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新兴优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实沪深港精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实A混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实纯泽纯债债券、嘉实惠泽混合(L)、嘉实成长增强混合、嘉实领先优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实荣泰债券、嘉实产业股票、嘉实价值增值混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实添益货币、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、嘉实稳德纯债债券、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)、嘉实前沿科技沪深港深股票、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、嘉实合润双两年定期债券、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添泽定期混合、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、嘉实海洋量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实基金精选混合、嘉实新添荣定期混合、嘉实兴发定期混合混合、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、特定客户资产管理组合。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况

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。

4.3 管理人对于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)根据本报告嘉实增强收益3.1.2“期末可供分配利润”为-2,228,233.33元;嘉实增强收益C 3.1.1“本期利润”为-45.58元、3.1.2“期末可供分配利润”为-547.55元,以及本基金基金合同(十七)(三)基金收益分配原则)的约定,因此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约定。

4.4 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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金经理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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:嘉实增强收益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	本报告期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
流动资产			
银行存款	64.73	3,139,387.60	589,133.17
结算备付金		686,466.52	304,310.00
交易保证金		8,959.69	7,283.13
应收利息	64.72	76,962,343.33	62,369,662.30
其中:应收债券利息		-	-
基金投资		-	-
债券投资		76,962,343.33	62,369,662.30
资产支持证券投资		-	-
买入返售金融资产		4,300,100.00	-
其他流动资产		7,010,103.88	-
流动资产合计		87,009,900.29	76,801,392.20
非流动资产			
可供出售金融资产		-	-
持有至到期投资		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产		-	-
固定资产		-	-
无形资产		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
非流动资产合计		-	-
资产总计		87,009,900.29	76,801,392.20
负债			
短期借款		-	-
应付账款		-	-
预收账款		-	-
应付职工薪酬		-	-
应交税费		-	-
其他流动负债		-	-
负债合计		-	-
所有者权益(或股东权益)			
实收资本		76,106,343.24	76,106,343.24
未分配利润		-2,228,233.33	-2,228,233.33
所有者权益合计		73,878,109.91	73,878,109.91
负债和所有者权益总计		87,009,900.29	76,801,392.20

注:报告截止日2018年6月30日,嘉实增强收益定期债券A份额净值1.003元,基金份额总额75,067,068.79份;嘉实增强收益定期债券C份额净值0.9995元,基金份额总额41,492.45份。基金份额总额合计为75,108,561.24份。

## 6.2 利润表

会计主体:嘉实增强收益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	本报告期 2018年01月01日至 2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年06月30日
一、收入		589,489.61	42,611,268.80
利息收入		1,695,220.00	62,409,122.00
其中:存款利息收入	64.71	13,915.88	59,730.33
债券利息收入		1,681,304.12	62,349,391.67
买入返售金融资产收入		36,438.34	103,172.23
其他利息收入		-	-
投资收益(损失以“-”号填列)		-117,120.00	-8,796,460.67
其中:股权投资收益	64.73	-	-
基金投资收益		-117,120.00	-8,796,460.67
资产支持证券投资损益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	64.74	-	-
其他收入	64.75	-	-
二、费用		562,038.69	18,667,479.76
1. 管理人报酬		303,810.02	8,276,660.72
2. 托管费		76,340.48	2,069,462.00
3. 销售服务费		72.89	292.14
4. 利息支出	64.73	2,007.91	14,562.94
5. 其他费用		53,696.33	8,008,902.20
其中:卖出回购金融资产支出		53,696.33	8,008,902.20
6. 税金及附加		5,181.26	-
7. 其他费用	64.73	114,713.79	236,398.67
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		47,818.33	23,943,779.04
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		47,818.33	23,943,779.04

## 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实增强收益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	本报告期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年06月30日
一、所有者权益(基金净值)		
1. 期初所有者权益(基金净值)	76,106,343.24	76,220,300.60
2. 本期新增基金份额产生的所有者权益变动(本期申购)	-	47,818.33
3. 本期赎回基金份额产生的所有者权益变动(本期赎回)(净申购减少以“-”号填列)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-	-
其中:本期赎回基金份额产生的所有者权益变动(本期赎回)(净申购减少以“-”号填列)	-	-
4. 本期所有者权益(基金净值)	76,106,343.24	76,317,927.98

注:本报告期为财务报表的组成部分,本报告期资产负债表由下表中数据计算得出:

项目	本报告期 2018年1月1日至 2018年6月30日	所有者权益合计
一、所有者权益(基金净值)	2,096,343,170.06	2,096,343,170.06
二、本期新增基金份额产生的所有者权益变动(本期申购)	-	33,943,779.04
三、本期赎回基金份额产生的所有者权益变动(本期赎回)(净申购减少以“-”号填列)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-	-
其中:本期赎回基金份额产生的所有者权益变动(本期赎回)(净申购减少以“-”号填列)	-	-
四、本期所有者权益(基金净值)	2,096,343,170.06	2,130,286,949.10

## 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一致的说明

## 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
招商银行股份有限公司	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

6.4.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.2 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.3 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

项目	本报告 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	303,810.02	8,276,660.72
其中:支付销售机构的客户维护费	93,547.22	134,046.67

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0.8%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×0.8%/当年天数。

## 6.4.4.2.2 基金托管费

项目	本报告 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,340.48	2,069,462.00

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%/当年天数。