

B192 信息披露

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第一季度报告

<p>基金管理人：嘉实基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 报告送出日期：2019年4月20日</p>	
<p>§1 重要提示</p> <p>基金管理人的董事会及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责任。</p> <p>基金管理人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年4月17日编制了本报告中的财务数据。本报告所载财务数据经审计，但仅反映报告期末的财务状况，因审计报告的审计基准日与报告编制基准日存在时间差异，本报告中的财务数据可能与审计报告的财务数据存在微小差异。</p> <p>基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者应了解，投资者作出投资决策前应仔细阅读本报告的全部内容。</p> <p>本报告期间的财务资料未经审计。</p> <p>本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。</p>	
<p>§2 基金产品概况</p>	
<p>2.1 基金基本情况</p>	
基金简称	嘉实中证500ETF联接
基金代码	000008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月22日
报告期末资产净值总额	1,130,213,389.09
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值力争不超过0.35%，年跟踪误差不超过0.4%。
投资策略	本基金为纯股票型基金，主要通过投资于目标ETF实现对中证500指数的紧密跟踪。本基金将力争通过投资组合的持续动态调整将跟踪误差控制在0.35%。年化跟踪误差不得超过4%，如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超出上述范围，基金管理人应采取合理措施使跟踪误差回归至上述范围。
业绩比较基准	中证500指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%。
风险收益特征	本基金属于中证500ETF的联接基金。主要通过投资于标的ETF跟踪中证500ETF的走势，为中证500指数的紧密跟踪。因此，本基金的风险收益特征与中证500ETF指数及其衍生证券高度相关。本基金为长期平衡风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
<p>基金投资业绩的基准名称 嘉实中证500ETF联接A 嘉实中证500ETF联接B</p>	
<p>2.2 基金投资业绩的基准名称</p>	
基金名称	嘉实中证500ETF联接A
基金代码	000008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月22日
基金业绩比较的基准	中证500指数
报告期末基金投资业绩的基准	1,064,676,797.55%
报告期末基金投资业绩的基准	75,306,109.14%

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第一季度报告

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日至2019年3月31日)	报告期(2018年1月1日至2018年3月31日)
嘉实中证500ETF联接A	嘉实中证500ETF联接B	嘉实中证500ETF联接C
1.本期已实现收益	-4,176,363.13	362,887.65
2.期末可供分配利润	363,207,487.72	6,011,677.18
3.期末可供基金份额持有人分配的利润	0.3667	0.2634
4.期末基金资产净值	1,561,287,194.51	88,562,166.94
5.期末基金资产净值增长率	1.4833	1.1722

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)扣除相关费用的余额。本期已实现收益与上期已实现收益相比，(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)自2018年10月1日起对本基金增加收取基金管理费，自2018年10月13日起对投资嘉实中证500ETF联接B的投资者收取；(4)嘉实中证500ETF联接A收取认(申)购费和赎回费，嘉实中证500ETF联接B不收取认(申)购费但收取赎回费、计提销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期本基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	30.71%	1.61%	31.27%	1.63%	-0.56%	-0.02%

嘉实中证500ETF联接A

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	30.09%	1.61%	31.27%	1.63%	-0.58%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

图1：嘉实中证500ETF联接A自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率的历史走势图对比图
(2013年3月22日至2019年3月31日)

图2：嘉实中证500ETF联接C自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率的历史走势图对比图
(2018年9月14日至2019年3月31日)

注：按照基金合同招募说明书约定，本基金自基金合同生效之日起3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“第十二条(二)投资组合限制”的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名

职务

任本基金的基金经理时间

任职日期

离任日期

证券从业年限

说明

陈玉刚

本基金、嘉实沪深300ETF联接LOF、嘉实中证500ETF联接LOF、嘉实中证红利ETF联接LOF、嘉实中证500ETF联接A、嘉实中证500ETF联接B、嘉实中证500ETF联接C、嘉实中证红利ETF联接A、嘉实中证红利ETF联接B、嘉实中证红利ETF联接C、嘉实中证红利ETF联接D、嘉实中证红利ETF联接E、嘉实中证红利ETF联接F、嘉实中证红利ETF联接G、嘉实中证红利ETF联接H、嘉实中证红利ETF联接I、嘉实中证红利ETF联接J、嘉实中证红利ETF联接K、嘉实中证红利ETF联接L、嘉实中证红利ETF联接M、嘉实中证红利ETF联接N、嘉实中证红利ETF联接O、嘉实中证红利ETF联接P、嘉实中证红利ETF联接Q、嘉实中证红利ETF联接R、嘉实中证红利ETF联接S、嘉实中证红利ETF联接T、嘉实中证红利ETF联接U、嘉实中证红利ETF联接V、嘉实中证红利ETF联接W、嘉实中证红利ETF联接X、嘉实中证红利ETF联接Y、嘉实中证红利ETF联接Z、嘉实中证红利ETF联接AA、嘉实中证红利ETF联接AB、嘉实中证红利ETF联接AC、嘉实中证红利ETF联接AD、嘉实中证红利ETF联接AE、嘉实中证红利ETF联接AF、嘉实中证红利ETF联接AG、嘉实中证红利ETF联接AH、嘉实中证红利ETF联接AI、嘉实中证红利ETF联接AJ、嘉实中证红利ETF联接AK、嘉实中证红利ETF联接AL、嘉实中证红利ETF联接AM、嘉实中证红利ETF联接AN、嘉实中证红利ETF联接AO、嘉实中证红利ETF联接AP、嘉实中证红利ETF联接AQ、嘉实中证红利ETF联接AR、嘉实中证红利ETF联接AS、嘉实中证红利ETF联接AT、嘉实中证红利ETF联接AU、嘉实中证红利ETF联接AV、嘉实中证红利ETF联接AW、嘉实中证红利ETF联接AX、嘉实中证红利ETF联接AY、嘉实中证红利ETF联接AZ、嘉实中证红利ETF联接BA、嘉实中证红利ETF联接BB、嘉实中证红利ETF联接BC、嘉实中证红利ETF联接BD、嘉实中证红利ETF联接BE、嘉实中证红利ETF联接BF、嘉实中证红利ETF联接BG、嘉实中证红利ETF联接BH、嘉实中证红利ETF联接BI、嘉实中证红利ETF联接BJ、嘉实中证红利ETF联接BK、嘉实中证红利ETF联接BL、嘉实中证红利ETF联接BM、嘉实中证红利ETF联接BN、嘉实中证红利ETF联接BO、嘉实中证红利ETF联接BP、嘉实中证红利ETF联接BQ、嘉实中证红利ETF联接BR、嘉实中证红利ETF联接BS、嘉实中证红利ETF联接BT、嘉实中证红利ETF联接BU、嘉实中证红利ETF联接BV、嘉实中证红利ETF联接BW、嘉实中证红利ETF联接BX、嘉实中证红利ETF联接BY、嘉实中证红利ETF联接BZ、嘉实中证红利ETF联接CA、嘉实中证红利ETF联接CB、嘉实中证红利ETF联接CC、嘉实中证红利ETF联接CD、嘉实中证红利ETF联接CE、嘉实中证红利ETF联接CF、嘉实中证红利ETF联接CG、嘉实中证红利ETF联接CH、嘉实中证红利ETF联接CI、嘉实中证红利ETF联接CJ、嘉实中证红利ETF联接CK、嘉实中证红利ETF联接CL、嘉实中证红利ETF联接CM、嘉实中证红利ETF联接CN、嘉实中证红利ETF联接CO、嘉实中证红利ETF联接CP、嘉实中证红利ETF联接CQ、嘉实中证红利ETF联接CR、嘉实中证红利ETF联接CS、嘉实中证红利ETF联接CT、嘉实中证红利ETF联接CU、嘉实中证红利ETF联接CV、嘉实中证红利ETF联接CW、嘉实中证红利ETF联接CX、嘉实中证红利ETF联接CY、嘉实中证红利ETF联接CZ、嘉实中证红利ETF联接DA、嘉实中证红利ETF联接DB、嘉实中证红利ETF联接DC、嘉实中证红利ETF联接DD、嘉实中证红利ETF联接DE、嘉实中证红利ETF联接DF、嘉实中证红利ETF联接DG、嘉实中证红利ETF联接DH、嘉实中证红利ETF联接DI、嘉实中证红利ETF联接DJ、嘉实中证红利ETF联接DK、嘉实中证红利ETF联接DL、嘉实中证红利ETF联接DM、嘉实中证红利ETF联接DN、嘉实中证红利ETF联接DO、嘉实中证红利ETF联接DP、嘉实中证红利ETF联接DQ、嘉实中证红利ETF联接DR、嘉实中证红利ETF联接DS、嘉实中证红利ETF联接DT、嘉实中证红利ETF联接DU、嘉实中证红利ETF联接DV、嘉实中证红利ETF联接DW、嘉实中证红利ETF联接DX、嘉实中证红利ETF联接DY、嘉实中证红利ETF联接DZ、嘉实中证红利ETF联接EA、嘉实中证红利ETF联接EB、嘉实中证红利ETF联接EC、嘉实中证红利ETF联接ED、嘉实中证红利ETF联接EE、嘉实中证红利ETF联接EF、嘉实中证红利ETF联接EG、嘉实中证红利ETF联接EH、嘉实中证红利ETF联接EI、嘉实中证红利ETF联接EJ、嘉实中证红利ETF联接EK、嘉实中证红利ETF联接EL、嘉实中证红利ETF联接EM、嘉实中证红利ETF联接EN、嘉实中证红利ETF联接EO、嘉实中证红利ETF联接EP、嘉实中证红利ETF联接EQ、嘉实中证红利ETF联接ER、嘉实中证红利ETF联接ES、嘉实中证红利ETF联接ET、嘉实中证红利ETF联接EU、嘉实中证红利ETF联接EV、嘉实中证红利ETF联接EW、嘉实中证红利ETF联接EX、嘉实中证红利ETF联接EY、嘉实中证红利ETF联接EZ、嘉实中证红利ETF联接FA、嘉实中证红利ETF联接FB、嘉实中证红利ETF联接FC、嘉实中证红利ETF联接FD、嘉实中证红利ETF联接FE、嘉实中证红利ETF联接FF、嘉实中证红利ETF联接FG、嘉实中证红利ETF联接FH、嘉实中证红利ETF联接FI、嘉实中证红利ETF联接FJ、嘉实中证红利ETF联接FK、嘉实中证红利ETF联接FL、嘉实中证红利ETF联接FM、嘉实中证红利ETF联接FN、嘉实中证红利ETF联接FO、嘉实中证红利ETF联接FP、嘉实中证红利ETF联接FQ、嘉实中证红利ETF联接FR、嘉实中证红利ETF联接FS、嘉实中证红利ETF联接FT、嘉实中证红利ETF联接FU、嘉实中证红利ETF联接FV、嘉实中证红利ETF联接FW、嘉实中证红利ETF联接FX、嘉实中证红利ETF联接FY、嘉实中证红利ETF联接FZ、嘉实中证红利ETF联接GA、嘉实中证红利ETF联接GB、嘉实中证红利ETF联接GC、嘉实中证红利ETF联接GD、嘉实中证红利ETF联接GE、嘉实中证红利ETF联接GF、嘉实中证红利ETF联接GG、嘉实中证红利ETF联接GH、嘉实中证红利ETF联接GI、嘉实中证红利ETF联接GJ、嘉实中证红利ETF联接GK、嘉实中证红利ETF联接GL、嘉实中证红利ETF联接GM、嘉实中证红利ETF联接GN、嘉实中证红利ETF联接GO、嘉实中证红利ETF联接GP、嘉实中证红利ETF联接GQ、嘉实中证红利ETF联接GR、嘉实中证红利ETF联接GS、嘉实中证红利ETF联接GT、嘉实中证红利ETF联接GU、嘉实中证红利ETF联接GV、嘉实中证红利ETF联接GW、嘉实中证红利ETF联接GX、嘉实中证红利ETF联接GY、嘉实中证红利ETF联接GZ、嘉实中证红利ETF联接HA、嘉实中证红利ETF联接HB、嘉实中证红利ETF联接HC、嘉实中证红利ETF联接HD、嘉实中证红利ETF联接HE、嘉实中证红利ETF联接HF、嘉实中证红利ETF联接HG、嘉实中证红利ETF联接HH、嘉实中证红利ETF联接HI、嘉实中证红利ETF联接HJ、嘉实中证红利ETF联接HK、嘉实中证红利ETF联接HL、嘉实中证红利ETF联接HM、嘉实中证红利ETF联接HN、嘉实中证红利ETF联接HO、嘉实中证红利ETF联接HP、嘉实中证红利ETF联接HQ、嘉实中证红利ETF联接HR、嘉实中证红利ETF联接HS、嘉实中证红利ETF联接HT、嘉实中证红利ETF联接HU、嘉实中证红利ETF联接HV、嘉实中证红利ETF联接HW、嘉实中证红利ETF联接HX、嘉实中证红利ETF联接HY、嘉实中证红利ETF联接HZ、嘉实中证红利ETF联接IA、嘉实中证红利ETF联接IB、嘉实中证红利ETF联接IC、嘉实中证红利ETF联接ID、嘉实中证红利ETF联接IE、嘉实中证红利ETF联接IF、嘉实中证红利ETF联接IG、嘉实中证红利ETF联接IH、嘉实中证红利ETF联接II、嘉实中证红利ETF联接IJ、嘉实中证红利ETF联接IK、嘉实中证红利ETF联接IL、嘉实中证红利ETF联接IM、嘉实中证红利ETF联接IN、嘉实中证红利ETF联接IO、嘉实中证红利ETF联接IP、嘉实中证红利ETF联接IQ、嘉实中证红利ETF联接IR、嘉实中证红利ETF联接IS、嘉实中证红利ETF联接IT、嘉实中证红利ETF联接IU、嘉实中证红利ETF联接IV、嘉实中证红利ETF联接IW、嘉实中证红利ETF联接IX、嘉实中证红利ETF联接IY、嘉实中证红利ETF联接IZ、嘉实中证红利ETF联接JA、嘉实中证红利ETF联接JB、嘉实中证红利ETF联接JC、嘉实中证红利ETF联接JD、嘉实中证红利ETF联接JE、嘉实中证红利ETF联接JF、嘉实中证红利ETF联接JG、嘉实中证红利ETF联接JH、嘉实中证红利ETF联接JI、嘉实中证红利ETF联接JJ、嘉实中证红利ETF联接JK、嘉实中证红利ETF联接JL、嘉实中证红利ETF联接JM、嘉实中证红利ETF联接JN、嘉实中证红利ETF联接JO、嘉实中证红利ETF联接JP、嘉实中证红利ETF联接JQ、嘉实中证红利ETF联接JR、嘉实中证红利ETF联接JS、嘉实中证红利ETF联接JT、嘉实中证红利ETF联接JU、嘉实中证红利ETF联接JV、嘉实中证红利ETF联接JW、嘉实中证红利ETF联接JX、嘉实中证红利ETF联接JY、嘉实中证红利ETF联接JZ、嘉实中证红利ETF联接KA、嘉实中证红利ETF联接KB、嘉实中证红利ETF联接KC、嘉实中证红利ETF联接KD、嘉实中证红利ETF联接KE、嘉实中证红利ETF联接KF、嘉实中证红利ETF联接KG、嘉实中证红利ETF联接KH、嘉实中证红利ETF联接KI、嘉实中证红利ETF联接KJ、嘉实中证红利ETF联接KL、嘉实中证红利ETF联接KM、嘉实中证红利ETF联接KN、嘉实中证红利ETF联接KO、嘉实中证红利ETF联接KP、嘉实中证红利ETF联接KQ、嘉实中证红利ETF联接KR、嘉实中证红利ETF联接KS、嘉实中证红利ETF联接KT、嘉实中证红利ETF联接KU、嘉实中证红利ETF联接KV、嘉实中证红利ETF联接KW、嘉实中证红利ETF联接KX、嘉实中证红利ETF联接KY、嘉实中证红利ETF联接KZ、嘉实中证红利ETF联接LA、嘉实中证红利ETF联接LB、嘉实中证红利ETF联接LC、嘉实中证红利ETF联接LD、嘉实中证红利ETF联接LE、嘉实中证红利ETF联接LF、嘉实中证红利ETF联接LG、嘉实中证红利ETF联接LH、嘉实中证红利ETF联接LI、嘉实中证红利ETF联接LJ、嘉实中证红利ETF联接LK、嘉实中证红利ETF联接LM、嘉实中证红利ETF联接LN、嘉实中证红利ETF联接LO、嘉实中证红利ETF联接LP、嘉实中证红利ETF联接LQ、嘉实中证红利ETF联接LR、嘉实中证红利ETF联接LS、嘉实中证红利ETF联接LT、嘉实中证红利ETF联接LU、嘉实中证红利ETF联接LV、嘉实中证红利ETF联接LW、嘉实中证红利ETF联接LX、嘉实中证红利ETF联接LY、嘉实中证红利ETF联接LZ、嘉实中证红利ETF联接MA、嘉实中证红利ETF联接MB、嘉实中证红利ETF联接MC、嘉实中证红利ETF联接MD、嘉实中证红利ETF联接ME、嘉实中证红利ETF联接MF、嘉实中证红利ETF联接MG、嘉实中证红利ETF

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

2019年第一季度报告

[illegible][illegible]

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

2019年第一季度报告

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 报告送出日期：2019年4月20日	
§1 重要提示	
基金管理人的董事会及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责任。	
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2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复验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。	
本报告期中的财务数据未经审计。 本报告自2019年1月1日起至2019年3月31日止。	
一、基金基本情况	
基金名称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)
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6日
报告期末基金份额总额	13,255,296.40份
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，力争使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%，年跟踪误差不得超过1%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要采用代表性成分股抽样复制策略、投资目标的消歧中具有代表性的成份证券替代、或选择非标的债券作为替代，综合考虑期限结构、操作风险等因素构成组合，并根据本基金资产配置、币种申赎情况、市场流动性以及银行间交易所债券交易特征及交易所等情况，通过“久期匹配”、“信用等级调整”、“期限限制”等优化策略对投资组合进行实时调整，降低跟踪误差。 在严格控制跟踪误差最小化、以期望在预期的风险承受范围之内，选择价格合适的衍生工具来对冲或放大某些资产的风险敞口。
业绩比较基准	中证中期企业债指数×95%+银行存款利率(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，高于货币型基金。本基金为指数型基金，主要投资于固定收益类金融工具和具有良好流动性的低风险权益类品种，具有较高的预期风险和预期收益，其风险和预期收益水平略高于其所跟踪的标的指数的市场整体风险收益特征。
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
基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF A)
下属分级基金的基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF C)
下属分级基金的场内简称	中期企债
下属分级基金的交易代码	160720
报告期末下属分级基金的份额总额	9,917,268.21份 4,338,038.19份

§ 2 主要投资指标及基金业绩说明

[illegible][illegible]

序号	债券代码	债券名称	数量(国)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	141813	17年中国铁路债	15,000	1,546,690.00	9.84
2	136401	16年信邦债	15,000	1,501,200.00	9.56
3	130776	16年中信02	15,000	1,470,250.00	9.12
4	143360	17年国开02	12,000	1,243,800.00	7.87
5	143620	18建信01	10,000	1,027,500.00	6.34

6.6 报告期内被投企业公允价值高于净资产值比例最大排序的前十名资产支持证券投资明细
 报告期内,本基金未持有资产支持证券。

6.7 报告期内被投企业公允价值占基金资产净值比例最大排序的前五名股票投资明细
 报告期内,本基金未持有非公开发行股票。

6.8 报告期内被投企业公允价值占基金资产净值比例最大排序的前五名权证投资明细
 报告期内,本基金未持有权证。

6.9 报告期内被投企业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。

6.10 报告期内本基金投资股指期货的交易情况
 报告期内,本基金未参与股指期货交易。

6.11 投资组合报告附注
 6.11.1 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个月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。
 6.11.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
 6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,000.46
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	263,529.99
6	预付账款	119,426.10
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,956.55

6.11.4 报告期内本基金持有的于转股期可转换债券明细
 报告期末,本基金持有处于转股期的可转债情况:
 6.11.5 报告期内本基金前十名被投资公司,在沪深两市交易所披露的说明
 报告期内,本基金未有持仓。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实中证中期国债指数证券投资基金(LOF A类)	嘉实中证中期国债指数证券投资基金(LOF C类)
报告期期初基金份额总额	11,467,899.96	5,426,930.84
报告期内基金总申购份额	8,154,202.22	2,498,077.62
减:报告期内基金总赎回份额	9,704,698.08	4,568,987.42
报告期内期间基金净申购份额 (=申购份额-赎回份额)	-1,482,596.10	-2,570,839.18
基金本报告期末基金份额总额	9,917,254.21	2,348,039.19

注:报告期内期间基金总申购份额含转入份额,基金总赎回份额含转出份额。
 注:报告期内期间基金净申购份额=报告期内基金总申购份额-基金总赎回份额。

7 基金管理人持有本基金基金份额的情况
 报告期内,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。
 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
 报告期内,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。

§ 8 备查文件目录

- (一)中国证监会核准注册《证通证券股份有限公司证券投资基金LOF》募集的文件;
- (二)《嘉实中证中期国债指数证券投资基金(LOF)基金合同》;
- (三)《嘉实中证中期国债指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;
- (四)《嘉实中证中期国债指数证券投资基金LOF托管协议》;
- (五)基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (六)报告期内嘉实中证中期国债指数证券投资基金LOF公告的各项资料;

8.2 存放地点
 北京市西城区大街98号华润大厦A座嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式
 (一)现场查询:查询时间每周工作日8:30—11:30、13:00—17:30。投资者可免费查阅,也可通过邮件或传真的方式进行预先申请。

(二)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn
 投资者对本页如有任何疑问,可向嘉实基金管理有限公司,咨询电话
 680-8800,或电邮信件,地址:mail-service@jsfund.cn.

嘉实基金管理有限公司
2018年03月01日