嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF) 2017年年度报告摘要

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 03 月 28 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 3 月 23 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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)
基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)
场内简称	中期企债
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 5 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	457, 895, 159.17 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年 4 月 1 日
下属分级基金的基金简称	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A 嘉实中证中期企业债指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	160720 160721
报告期末下属分级基金的份额总额	449, 998, 547.15 份 7, 896, 612.02 份

2.2 基金产品说明

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%,年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式指数基金,主要采用代表性分层抽样复制策略,投资于标的指数中具有代表性的部分成份债券,或选择非成份债券作为替代,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,通过“久期匹配”－“信用等级匹配”－“期限匹配”等优化策略对基金资产进行抽样组合调整,降低交易成本,以期在规定的风险承受限度之内,尽量控制跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率(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,高于货币市场基金,本基金为指数型基金,主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

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	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400- 600- 8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年		2016年		2015年	
	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C	嘉实中证中期企业债指数（LOF）A	嘉实中证中期企业债指数（LOF）C
本期已实现收益	70, 295.51	26, 235.94	31, 515, 757.98	2, 545, 626.49	7, 189, 244.30	1, 594, 702.62
本期利润	- 4, 418, 528.82	- 460, 918.83	1, 173, 076.92	502, 169.73	17, 280, 470.22	3, 290, 962.97
加权平均基金份额本期利润	- 0.0087	- 0.0286	0.0019	0.0105	0.1225	0.1143
本期加权平均净值利润率	- 0.80%	- 2.58%	0.16%	0.88%	10.78%	10.07%
本期基金份额净值增长率	- 1.03%	- 1.27%	0.15%	0.12%	10.50%	11.76%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配利润	214, 310.84	66, 059.44	29, 318, 997.34	1, 200, 572.55	29, 655, 795.14	4, 836, 862.49
期末可供分配基金份额利润	0.0005	0.0084	0.0525	0.0630	0.0596	0.0656
期末基金资产净值	474, 849, 607.04	8, 389, 509.13	622, 839, 257.07	21, 440, 436.22	582, 335, 796.44	86, 754, 020.77
期末基金份额净值	1.0552	1.0624	1.1159	1.1258	1.1702	1.1761
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末		2015年末	
基金份额累计净值增长率	15.98%	16.26%	17.19%	17.75%	17.02%	17.61%

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)嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 收取认(申)购费和赎回费,嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 不收取认(申)购费但收取赎回费,计提销售服务费;(3)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;(4) 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。

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

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.78%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.80%	0.03%
过去六个月	- 1.27%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.13%	0.02%
过去一年	- 1.03%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 0.90%	0.04%
过去三年	9.52%	0.12%	11.03%	0.07%	- 1.51%	0.05%
自基金合同生效起至今	15.98%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.84%	0.03%

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.85%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.87%	0.03%
过去六个月	- 1.38%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.24%	0.02%
过去一年	- 1.27%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 1.14%	0.04%
过去三年	10.48%	0.12%	11.03%	0.07%	- 0.55%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.26%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.56%	0.03%

注:本基金业绩比较基准为:中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×（中证中期企业债指数(t)/中证中期企业债指数(t-1)-1)+5%×银行活期存款利率(税后)

Benchmark(t)=(1+Return (t))× Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,…。

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

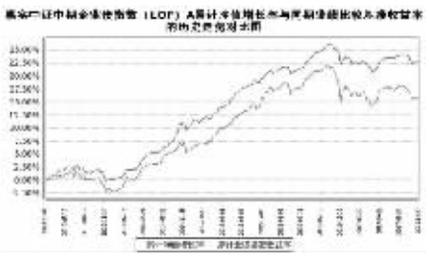


图 1: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

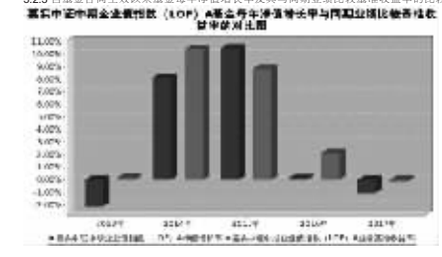
(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 日)

图 2: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 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“第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制”的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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)嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 收取认(申)购费和赎回费,嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 不收取认(申)购费但收取赎回费,计提销售服务费;(3)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;(4) 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。

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

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.78%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.80%	0.03%
过去六个月	- 1.27%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.13%	0.02%
过去一年	- 1.03%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 0.90%	0.04%
过去三年	9.52%	0.12%	11.03%	0.07%	- 1.51%	0.05%
自基金合同生效起至今	15.98%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.84%	0.03%

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.85%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.87%	0.03%
过去六个月	- 1.38%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.24%	0.02%
过去一年	- 1.27%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 1.14%	0.04%
过去三年	10.48%	0.12%	11.03%	0.07%	- 0.55%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.26%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.56%	0.03%

注:本基金业绩比较基准为:中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×（中证中期企业债指数(t)/中证中期企业债指数(t-1)-1)+5%×银行活期存款利率(税后)

Benchmark(t)=(1+Return (t))× Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,…。

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 1: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 日)

图 2: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 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“第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制”的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

图 1: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 日)

图 2: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 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“第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制”的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金业绩比较基准为:中证中期企业债指数×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×（中证中期企业债指数(t)/中证中期企业债指数(t-1)-1)+5%×银行活期存款利率(税后)

Benchmark(t)=(1+Return (t))× Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,…。

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 1: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 日)

图 2: 嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 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

(2013 年 2 月 5 日至 2017 年 12 月 31 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“第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制”的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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)嘉实中证中期企业债指数(LOF)A 收取认(申)购费和赎回费,嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 不收取认(申)购费但收取赎回费,计提销售服务费;(3)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;(4) 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。

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

嘉实中证中期企业债指数（LOF）A					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.78%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.80%	0.03%
过去六个月	- 1.27%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.13%	0.02%
过去一年	- 1.03%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 0.90%	0.04%
过去三年	9.52%	0.12%	11.03%	0.07%	- 1.51%	0.05%
自基金合同生效起至今	15.98%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.84%	0.03%

嘉实中证中期企业债指数（LOF）C					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	- 1.85%	0.09%	- 0.98%	0.06%	- 0.87%	0.03%
过去六个月	- 1.38%	0.07%	- 0.14%	0.05%	- 1.24%	0.02%
过去一年	- 1.27%	0.10%	- 0.13%	0.06%	- 1.14%	0.04%
过去三年	10.48%	0.12%	11.03%	0.07%	- 0.55%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.26%	0.11%	22.82%	0.08%	- 6.56%	0.03%