



(上接B65版)

中证中债企业债指数由上海证券交易所、深圳证券交易所市场以及银行间市场上交易的AAA级及以上信用评级、剩余期限在7年之内、固定利率付息和一次还本付息的企业债、公司债和中票等信用品种组成。

如果发生机构变更或者停止上述的指数编制及发布,或者上述的指数由其他机构代编,或由其他编制方法发生重大变更导致上述数据不能客观真实的反映,或证券市场其他类似事件更严重,更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,通过适当的程序变更基金的指数,并同时对其他基金的名称中与该指数名称,若新的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金份额持有人同意后变更标的指数,报中国证监会备案并及时公告。

**14. 本基金的风险收益特征**  
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证券市场相似的风险收益特征。

**15. 基金投资组合管理**  
本基金管理人承诺本基金确保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。  
本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1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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	--	--
2	固定收益	--	--
3	基金投资	--	--
4	其他资产	11,643,676.17	98.00
5	衍生金融资产	--	--
6	其他负债	454,300.39	3.80
7	资产支持证券	--	--
8	贵金属投资	--	--
9	金融衍生品投资	--	--
10	买入返售金融资产	--	--
11	其他	--	--
12	应收利息	502,684.32	4.20
13	其他应收款	12,097,736.56	1.92
14	合计	603,313,970.48	100.00

**2.报告期末按行业分类的股票投资组合**  
报告期内,本基金未持有股票。  
**3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**  
报告期末,本基金未持有股票。  
**4.报告期末按品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	--	--
2	央行票据	49,100,000.00	10.16
3	金融债券	49,100,000.00	10.16
4	企业债券	279,043,509.69	57.54
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	289,566,000.00	59.93
7	可转换公司债券	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	617,711,509.69	12.83

**5.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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1408080	14广通债01	36,000	6.03
2	101552013	15广通MTN001	30,000	6.00
3	101561009	15广通MTN01	30,000	5.99
4	101560202	16广通MTN1	30,000	5.89
5	101654100	16广通MTN01	30,000	5.75

**6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**  
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

**7.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**  
报告期末,本基金未持有贵金属投资。

**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权证投资明细**  
报告期末,本基金未持有权证投资。

**9.报告期末本基金投资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。

**10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

**11.投资组合报告附注**  
(1) 报告期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。  
(2) 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。  
(3) 其他资产构成

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期内,本基金未持有处于转股期的可转换债券。  
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末,本基金未持有股票。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.11%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.28%	0.09%
2014年	8.18%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.25%	0.01%
2015年	10.50%	0.09%	8.85%	0.06%	1.65%	0.03%
2016年	0.15%	0.15%	2.13%	0.08%	-1.98%	0.07%
2017年	-1.03%	0.10%	-0.13%	0.06%	-0.90%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5月5日至2017年12月31日)

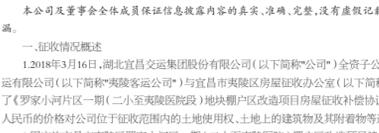


图2:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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

嘉实中证中债企业债指数(L0F)						
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	净值比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	-2.42%	0.09%	0.17%	0.09%	-2.59%	0.01%
2014年	7.84%	0.11%	10.43%	0.10%	-2.59%	0.01%
2015年	11.76%	0.09%	8.85%	0.06%	2.91%	0.03%
2016年	0.12%	0.15%	2.13%	0.08%	-2.01%	0.07%
2017年	-1.27%	0.10%	-0.13%	0.06%	-1.14%	0.04%

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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

2.本基金合同生效以来本基金资产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:嘉实中证中债企业债指数(L0F)基金份额净值累计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5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)投资组合范围”和“七)投资禁止行为”的相关规定。

**十二、基金的投资**  
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资过程并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。