

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 3 月 8 日(合同生效日)起至 2013 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
§9 开放式基金份额变动	38

§10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 备查文件目录	41
11.1 备查文件目录.....	41
11.2 存放地点.....	41
11.3 查阅方式.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强信用定期债券
基金主代码	000005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 8 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,330,159,322.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争当期总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	本基金为达到控制基金组合风险，实现良好收益率的目标，优先考虑对短期融资券及债项信用评级在 AA-级以上（含 AA-级）的其他信用类固定收益金融工具的配置。同时密切关注经济运行趋势，深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，结合各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等方面因素，做出最佳的资产配置，在规避基金组合风险的同时进一步增强基金组合收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010) 66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100005	100140

法定代表人	安奎	姜建清
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 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(2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日) - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	21,880,127.98
本期利润	13,140,750.58
加权平均基金份额本期利润	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,674,611.68
期末可供分配基金份额利润	0.0050
期末基金资产净值	2,341,833,934.26
期末基金份额净值	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.50%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(4) 本基金合同生效日为 2013 年 3 月 8 日，本报告期自 2013 年 3 月 8 日起至 2013 年 6 月 30 日止。

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	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.59%	0.17%	0.35%	0.02%	-0.94%	0.15%
过去三个月	0.40%	0.11%	1.05%	0.01%	-0.65%	0.10%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.10%	1.33%	0.01%	-0.83%	0.09%

注：本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率+1.2%

上述“一年期银行定期存款收益率”是指年度开放期结束后的第一个封闭期首日（若为首个封闭期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”，以后每一个年度开放期结束后的第一个封闭期首日进行调整。

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：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

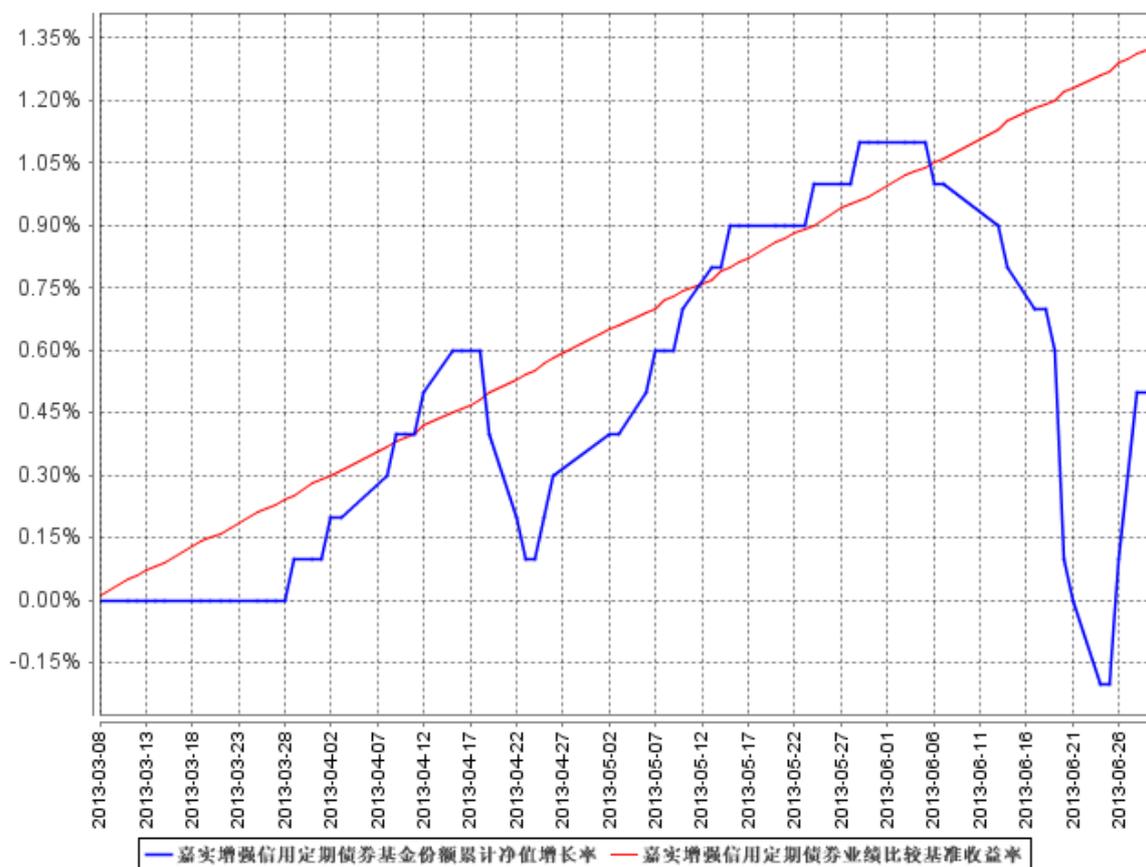
$$\text{Return}(t) = 100\% \times (\text{一年期银行定期存款税后收益率} + 1.2\%) / 365$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实增强信用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



图：嘉实增强信用定期债券累计份额净值增长率的历史走势对比图

(2013年3月8日至2013年6月30日)

注：本基金基金合同生效日 2013 年 3 月 8 日至报告期末未满 1 年。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，报告期末本基金仍处于建仓期内。

§ 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 2013 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、47 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、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、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 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）等证券投资基金。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	离任日期		
刘宁	本基金、嘉实如意宝定期债券基金经理	2013 年 3 月 8 日	-	9 年	经济学硕士，2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005 年开始从事投资相关工作，先后担任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。

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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实增强信用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规定和约定，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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、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

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

2013 年上半年，债券市场处在一个 GDP 从一季度的 7.7% 下降第二季度的 7.5% 的逐季回落大环境，GDP 数据低于预期；通胀中枢小幅提升。经济总体运行情况低于年初预期，一方面由于在经济转型的大背景下，政府对经济下行的容忍度提高，政策方面没有明显的放松和刺激迹象；另一方面，消费方面对“三公”的控制，从产业数据来看，第三产业今年受到了较为明显的负面影响；第三，外需仍然低迷，虽然整体看出口情况较前期最差的时候已经有所改善，但程度有限。如上因素叠加导致各大投行纷纷下调 2013 年中国经济预期，市场逐步怀疑年初对经济温和复苏的预期。

债券市场在 2013 年上半年走出了先扬后抑的行情，不同时点的推动力有所不同。一季度初期，在 GDP 温和复苏、CPI 压力不大的大背景下，配置压力以及央行启动 SLO、央行春节前巨额净投放等因素营造了资金面宽松的环境，推动债券收益率在一季度初期大幅下行，二月中下旬央行重启正回购、加大回笼给市场带来资金面的负面冲击，收益率大幅上行，三月底银监会 8 号文的发布再次点燃了市场对债券特别是信用债的热情，巨额非标资产规范的预期使得市场对信用债特别是高收益债的看法积极，收益率大幅下行并创年内新低。二季度开始，债券市场动荡加剧，二季度初，黑金事件爆发并迅速蔓延，使得债券市场在事件冲击下巨幅波动，随后事件平息，债市先跌后涨；二季度中后期，央行重启了三个月央票发行，随后因财政税收上缴、过节因素、临近银行年中考核时点、央行公开市场操作的“无为”等因素，资金面急速恶化并最终酿成“钱荒”，资

金面的极度紧张使得市场脱离了基本面决定的轨道，收益率出现巨幅平坦化上移。

本基金成立于今年 3 月 8 日，报告期内处于建仓期，本着稳健投资原则，在风险和收益之间进行平衡。策略上以绝对回报策略为主，配置上选择确定性强的品种，维持中性偏低杠杆，中短期品种在月末的资金紧张中受到较大影响，但资金紧张快速缓解后净值得到恢复，本基金在 6 月末市场随收益率调整过程中在保持杠杆比例稳定的前提下进行了仓位调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 1.005 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.50%，业绩比较基准收益率为 1.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，我们判断为贴地飞行，经济增速可能在低位出现企稳迹象，原因包括政府的托底效应，短期的库存回补，以及前期的低基数。CPI 下半年中枢较上半年有小幅提升，PPI 受到前期低基数影响回升幅度可能会更为明显，但绝对价格预计没有明显的上升动力。资金面方面，6 月份钱荒过后，资金利率保持平稳，同时叠加政府托底的政策基调，我们认为下半年资金面波动幅度会有所降低。

短期内，债市市场不排除面临一定的调整压力，主要因为：政府托底经济，再提稳增长，市场之前对经济过度悲观预期有修正需求；外汇占款负增长、利率市场化、市场监管等因素使得市场参与者变得更为谨慎，资金利率中枢上行，资金面这个因素是当前市场关注的主要因素；信用负面新闻频发，债券评级下调增多，强化对信用风险的关注；预期中的信用债供给放量；新基金、理财开户受限，需求跟不上。但正面因素为估值尚可，所以虽然对经济极度悲观的预期修正对债市中性偏负，但是考虑到当前 10 年收益率已经比较充分的反应了未来短期基本面的情况，因此也不具备大的风险。中长期来看，中国经济的中枢下移是确定趋势，我们仍然看好债券的长期配置价值。

本基金将继续本着稳健投资的原则，在纯债投资基础上择优参与可转债打新，整体操作中性和平衡类属配置，适当增加久期，提高利率债及高信用等级债券配置。

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与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、年中和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、法律稽核等部门负责人组成，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，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同生效于 2013 年 3 月 8 日，报告期内处于建仓期。根据本基金基金合同（第十七部分三、基金收益分配原则）的约定，本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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，本基金托管人在对嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，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等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,881,782.00
结算备付金		26,438,679.98
存出保证金		49,783.14
交易性金融资产	6.4.7.2	2,949,006,738.90
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		2,949,006,738.90
资产支持证券投资		-
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	43,653,880.48
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,021,030,864.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		656,498,794.05
应付证券清算款		20,246,459.81
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,592,726.35
应付托管费		398,181.60
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	46,516.77
应交税费		66,931.20
应付利息		304,463.66
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	42,856.80
负债合计		679,196,930.24
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,330,159,322.58
未分配利润	6.4.7.10	11,674,611.68
所有者权益合计		2,341,833,934.26
负债和所有者权益总计		3,021,030,864.50

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 8 日，本报告期自基金合同生效日 2013 年 3 月 8 日起至 2013 年 6 月 30 日止，报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 2,330,159,322.58 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 8 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		25,572,860.55
1.利息收入		33,986,773.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,764,896.29
债券利息收入		29,246,591.28
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,975,285.59
其他利息收入		-
2.投资收益		242,148.05
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	242,148.05
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-8,739,377.40
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.17	83,316.74
减：二、费用		12,432,109.97
1. 管理人报酬		6,201,289.11
2. 托管费		1,550,322.34
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	40,732.51
5. 利息支出		4,577,477.39

其中：卖出回购金融资产支出		4,577,477.39
6. 其他费用	6.4.7.19	62,288.62
三、利润总额		13,140,750.58
减：所得税费用		-
四、净利润		13,140,750.58

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 8 日，本期是指 2013 年 3 月 8 日至 2013 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 8 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 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）	2,493,064,197.15	-	2,493,064,197.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,140,750.58	13,140,750.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-162,904,874.57	-1,466,138.90	-164,371,013.47
其中：1.基金申购款	427,164.04	3,844.54	431,008.58
2.基金赎回款	-163,332,038.61	-1,469,983.44	-164,802,022.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,330,159,322.58	11,674,611.68	2,341,833,934.26

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 8 日，本期是指 2013 年 3 月 8 日至 2013 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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：

赵学军

基金管理人负责人

李松林

主管会计工作负责人

王红

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1763号《关于核准嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,每年定期开放一次申购和赎回,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,492,333,615.37 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,493,064,197.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 730,581.78 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行及上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不从二级市场买入股票,不参与一级市场股票首次公开发行或增发,但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票,本基金应在其可交易之日起的 6 个月内卖出。因上述原因持有的权证,本基金应在其可交易之日起的 1 个月内卖出。除每次季度开放期的前十个工作日和后十个工作日、年度开放期前三个月和后三个月以及开放期以外的期间,本基金投资于债券和银行存款等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%,其中对短期融资券及债项信用评级在 AA-级以上(含 AA-)的其他信用类固定收益金融工具(包括但不限于金融债券(不含政策性金融债)、企业债券、公司债券、中期票据、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债券)和银行存款的投资比例合计不低于基金固定收益类资产的 80%。开放期内,本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日和基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金

红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,881,782.00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,881,782.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		-	-	-
债券	交易所市场	605,411,855.05	604,310,738.90	-1,101,116.15
	银行间市场	2,352,334,261.25	2,344,696,000.00	-7,638,261.25
	合计	2,957,746,116.30	2,949,006,738.90	-8,739,377.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,957,746,116.30	2,949,006,738.90	-8,739,377.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2013年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2013年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2013年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	1,114.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,707.66
应收债券利息	43,642,037.91
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	20.16
合计	43,653,880.48

6.4.7.6 其他资产

本期末（2013年6月30日），本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	46,516.77

合计	46,516.77
----	-----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	42,856.80
合计	42,856.80

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,493,064,197.15	2,493,064,197.15
本期申购	427,164.04	427,164.04
本期赎回	-163,332,038.61	-163,332,038.61
本期末	2,330,159,322.58	2,330,159,322.58

注：本基金于2013年2月18日至2013年3月6日向社会公开募集，截至2013年3月8日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币2,492,333,615.37元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币730,581.78元，以上实收基金合计2,493,064,197.15元，折合为2,493,064,197.15份嘉实增强信用定期债券基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	21,880,127.98	-8,739,377.40	13,140,750.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,319,926.95	-146,211.95	-1,466,138.90
其中：基金申购款	3,461.15	383.39	3,844.54
基金赎回款	-1,323,388.10	-146,595.34	-1,469,983.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,560,201.03	-8,885,589.35	11,674,611.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6

	月 30 日
活期存款利息收入	253, 229. 22
定期存款利息收入	1, 385, 197. 22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	126, 323. 58
其他	146. 27
合计	1, 764, 896. 29

6.4.7.12 股票投资收益

本期（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6 月30日
卖出债券成交总额	1, 064, 001, 685. 85
减：卖出债券成本总额	1, 054, 352, 815. 33
减：应收利息总额	9, 406, 722. 47
债券投资收益	242, 148. 05

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本期（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8, 739, 377. 40
——股票投资	-
——债券投资	-8, 739, 377. 40
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8, 739, 377. 40

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年 6月30日
基金赎回费收入	82,401.19
其他	915.55
合计	83,316.74

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年 6月30日
交易所市场交易费用	2,495.01
银行间市场交易费用	38,237.50
合计	40,732.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013 年6月30日
审计费用	-
信息披露费	42,856.80
银行划款手续费	18,931.82
其他	500.00
合计	62,288.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东

立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,201,289.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,091,282.71

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,550,322.34

注：支付基金托管人中国工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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6月30日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	10,033,249.18	10,070,144.66	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6 月30日
基金合同生效日(2013年3月8日)持有的 基金份额	-
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	1,200,318.37
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	1,200,318.37
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.05%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2013年6月30日),其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,881,782.00	253,229.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2013年3月8日(基金合同生效日)至2013年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本期（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
124221	13 武地	2013 年 3 月 25 日	2013 年 7 月 2 日	新债未上市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-
124261	13 鞍城投	2013 年 4 月 26 日	-	新债未上市	100.00	100.00	180,000	18,000,000.00	18,000,000.00	-
122227	13 尖峰 01	2013 年 6 月 7 日	2013 年 7 月 2 日	新债未上市	100.00	100.00	80,000	8,000,000.00	8,000,000.00	-
112178	12 墨龙 01	2013 年 6 月 13 日	2013 年 7 月 23 日	新债未上市	100.00	100.00	80,000	8,000,000.00	8,000,000.00	-
112180	12 奥飞债	2013 年 6 月 14 日	2013 年 7 月 23 日	新债未上市	100.00	100.00	70,000	7,000,000.00	7,000,000.00	-
124310	13 洪水利	2013 年 6 月 25 日	2013 年 7 月 25 日	新债未上市	100.00	100.00	280,000	28,000,000.00	28,000,000.00	-
124309	13 弘燃气	2013 年 6 月 21 日	2013 年 7 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 348,499,035.25 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1282554	12 伊泰 MTN1	2013 年 7 月 1 日	102.51	500,000	51,255,000.00
1382135	13 龙农垦 MTN1	2013 年 7 月 1 日	100.15	1,100,000	110,165,000.00
1382217	13 天业 MTN1	2013 年 7 月 1 日	99.47	100,000	9,947,000.00
120242	12 国开 42	2013 年 7 月 4 日	100.74	200,000	20,148,000.00
1382060	13 中石油 MTN1	2013 年 7 月 4 日	99.55	300,000	29,865,000.00
1382081	13 豫水利 MTN1	2013 年 7 月 4 日	100.88	500,000	50,440,000.00
1382125	13 中粮 MTN1	2013 年 7 月 4 日	100.09	1,000,000	100,090,000.00
合计				3,700,000	371,910,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 307,999,758.80 元，于 2013 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在审慎的投资管理和风险控制下，力争当期总回报最大化，以谋求长期保值增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公

司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013年6月30日
A-1	756,052,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	756,052,000.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013年6月30日
AAA	408,230,092.50
AAA 以下	1,705,756,775.60
未评级	-
合计	2,113,986,868.10

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放期要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 656,498,794.05 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,881,782.00	-	-	-	1,881,782.00
结算备付金	26,438,679.98	-	-	-	26,438,679.98
存出保证金	49,783.14	-	-	-	49,783.14

交易性金融资产	855,983,613.20	1,481,243,395.80	611,779,729.90	-	2,949,006,738.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	43,653,880.48	43,653,880.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	884,353,858.32	1,481,243,395.80	611,779,729.90	43,653,880.48	3,021,030,864.50
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	656,498,794.05	-	-	-	656,498,794.05
应付证券清算款	-	-	-	20,246,459.81	20,246,459.81
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,592,726.35	1,592,726.35
应付托管费	-	-	-	398,181.60	398,181.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	46,516.77	46,516.77
应交税费	-	-	-	66,931.20	66,931.20
应付利息	-	-	-	304,463.66	304,463.66
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	42,856.80	42,856.80
负债总计	656,498,794.05	-	-	22,698,136.19	679,196,930.24
利率敏感度缺口	227,855,064.27	1,481,243,395.80	611,779,729.90	20,955,744.29	2,341,833,934.26

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2013年6月30日）
	市场利率下降 25 个基点	19,161,009.63
	市场利率上升 25 个基点	-18,933,918.54

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 604,310,738.90 元，属于第二层级的余额为 2,344,696,000.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,949,006,738.90	97.62
	其中：债券	2,949,006,738.90	97.62
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	28,320,461.98	0.94
6	其他各项资产	43,703,663.62	1.45
	合计	3,021,030,864.50	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

报告期末，本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2013 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2013 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	58,819,870.80	2.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,148,000.00	0.86
	其中：政策性金融债	20,148,000.00	0.86
4	企业债券	1,003,283,868.10	42.84
5	企业短期融资券	756,052,000.00	32.28
6	中期票据	1,110,703,000.00	47.43
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	2,949,006,738.90	125.93

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1382135	13 龙农垦 MTN1	1,100,000	110,165,000.00	4.70
2	1382125	13 中粮 MTN1	1,000,000	100,090,000.00	4.27
3	1382160	13 北排水 MTN1	700,000	69,818,000.00	2.98
4	041351015	13 中建一局 CP001	700,000	69,559,000.00	2.97
5	1382147	13 中南方 MTN1	600,000	59,844,000.00	2.56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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年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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	49,783.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,653,880.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	43,703,663.62

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
17,933	129,936.95	1,200,318.37	0.05%	2,328,959,004.21	99.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月8日）基金份额总额	2,493,064,197.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	427,164.04
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	163,332,038.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,330,159,322.58

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金的审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	420,419,238.23	68.72%	18,070,300,000.00	79.03%
海通证券股份有限公司	191,379,611.08	31.28%	4,796,100,000.00	20.97%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年3月9日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年4月1日
3	嘉实基金管理有限公司关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年4月9日
4	关于嘉实增强信用定期开放债券 2013 年 6 月 13 日开放申购和赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年6月6日
5	关于嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金季度开放期申购赎回结果公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年6月17日
6	嘉实基金管理有限公司关于增加杭州联合农村商业银行股份有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013年6月20日
7	嘉实基金管理有限公司关于开通支付宝	中国证券报、上海证券报、	2013年6月26

	直销网上交易和电话交易业务的公告	证券时报、管理人网站	日
--	------------------	------------	---

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2013 年 8 月 26 日