

# 嘉实债券开放式证券投资基金 2015 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：2016 年 3 月 29 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。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 2016 年 3 月 24 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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 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       | 嘉实债券开放式证券投资基金    |
| 基金简称       | 嘉实债券             |
| 基金主代码      | 070005           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2003 年 7 月 9 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 | 380,788,068.27 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 以本金安全为前提，追求较高的组合回报。   |
| 投资策略   | 采取主动的自上而下的投资策略，通过对投资组合的相对价值分析，充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会；应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合，实现基金的保值增值。 |
| 业绩比较基准 | 中央国债登记结算公司的中国债券指数   |
| 风险收益特征 | 本基金属于低风险证券投资基金，长期平均的风险和预期收益率低于股票基金，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) 65182266    | (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 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 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 | 2015 年         | 2014 年         | 2013 年         |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 40,950,530.06  | 29,605,591.03  | 33,120,294.90  |
| 本期利润          | 54,013,085.30  | 56,391,713.32  | 9,401,114.67   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1458         | 0.1301         | 0.0144         |
| 本期加权平均净值利润率   | 9.43%          | 9.13%          | 1.03%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 10.06%         | 9.68%          | 0.47%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末        | 2014 年末        | 2013 年末        |
| 期末可供分配利润      | 149,982,314.61 | 115,015,872.10 | 117,198,646.97 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3939         | 0.3130         | 0.2522         |
| 期末基金资产净值      | 614,612,234.75 | 549,573,846.19 | 638,453,836.23 |
| 期末基金份额净值      | 1.614          | 1.496          | 1.374          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末        | 2014 年末        | 2013 年末        |
| 基金份额累计净值增长率   | 150.18%        | 127.31%        | 107.25%        |

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。

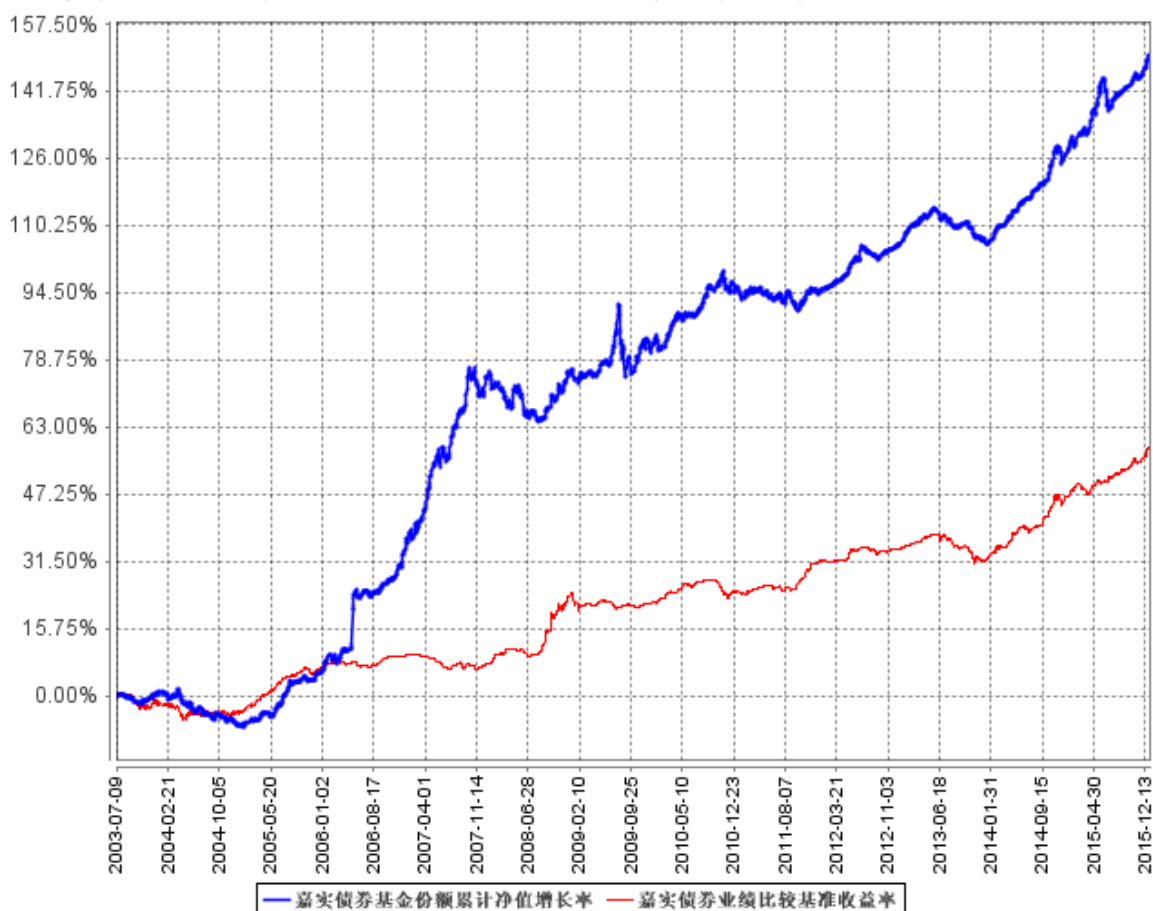
#### 3.2 基金净值表现

##### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 2.93%    | 0.08%       | 3.10%      | 0.11%         | -0.17% | -0.03% |
| 过去六个月      | 4.47%    | 0.10%       | 5.29%      | 0.10%         | -0.82% | 0.00%  |
| 过去一年       | 10.06%   | 0.19%       | 8.03%      | 0.11%         | 2.03%  | 0.08%  |
| 过去三年       | 21.28%   | 0.14%       | 17.63%     | 0.13%         | 3.65%  | 0.01%  |
| 过去五年       | 28.07%   | 0.14%       | 27.49%     | 0.11%         | 0.58%  | 0.03%  |
| 自基金合同生效起至今 | 150.18%  | 0.28%       | 58.28%     | 0.17%         | 91.90% | 0.11%  |

### 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



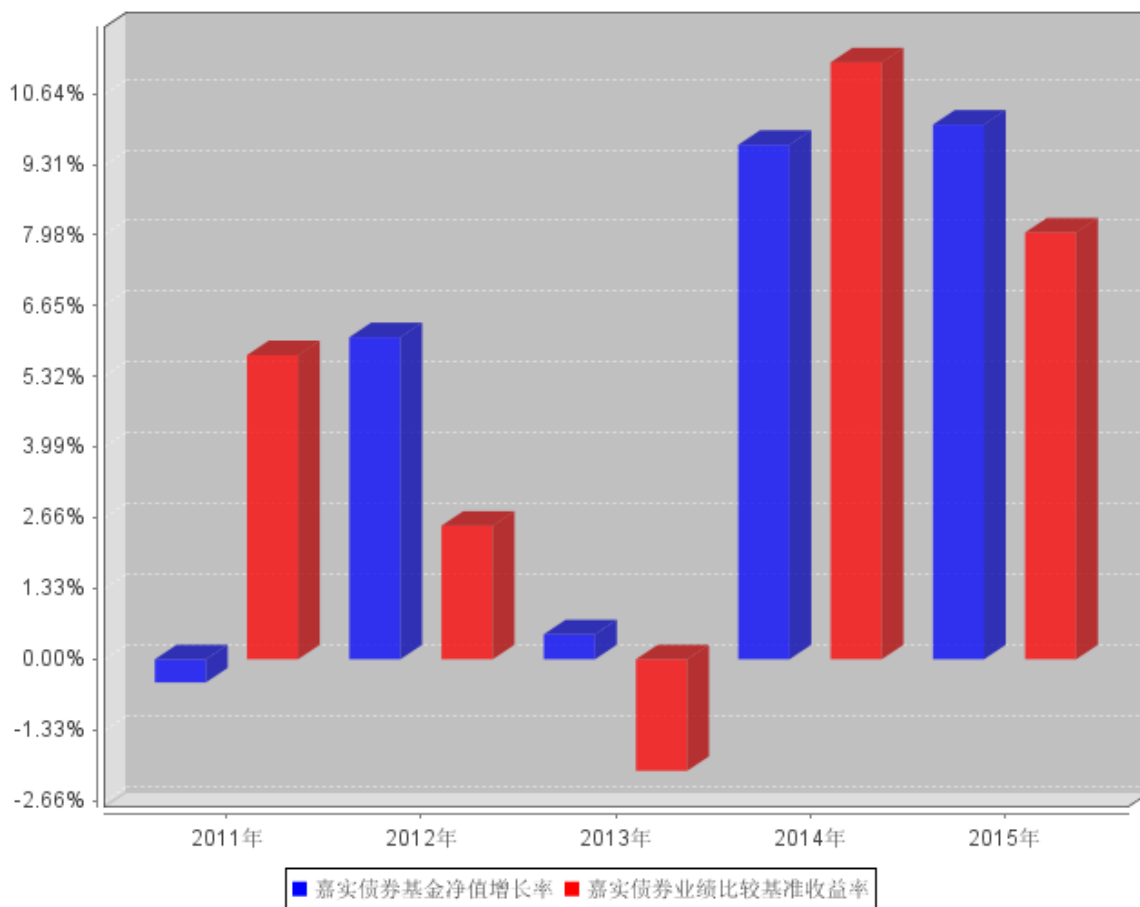
图：嘉实债券份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日)

注：按基金合同规定，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三部分（四、（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（3）投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上（或者有高信用等级机构或相当优质资产担保）的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级；（4）本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月；（5）新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

## 3.2.3 过去五年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

嘉实债券过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2015 | 0.3000          | 3,622,616.24  | 7,373,681.41  | 10,996,297.65 |    |
| 2014 | 0.1000          | 1,344,506.94  | 3,209,512.73  | 4,554,019.67  |    |
| 2013 | 0.5000          | 9,922,824.31  | 24,226,784.71 | 34,149,609.02 |    |
| 合计   | 0.9000          | 14,889,947.49 | 34,809,978.85 | 49,699,926.34 |    |

## §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 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、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 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、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)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 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)、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、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、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、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、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、嘉实机构快线货币、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、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。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 |        |   |
| 曲扬 | 本基金基金经理，嘉实纯债债券、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实稳固收益债券，嘉实中证中期企业债指数，嘉实中证中期国债ETF，嘉实中证中期国债ETF联接、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券基金经理 | 2011年11月18日     | -    | 11年    | 曾任中信基金债券研究员和债券交易员、光大银行债券自营投资业务副主管，2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。 |

注：（1）任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日；（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

在报告期内，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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建

议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

### 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

2015 年基本面回顾：

从目前已经陆续披露的 2015 年宏观数据来看，整体上经济呈现出逐渐下行的趋势，在临近年末期间经济数据有阶段性企稳的迹象。指标来看，以工业增加值为例，1 季度增速在 6.4% 左右，之后逐渐回落，截至 11 月份，累计增速在 6.1% 左右。从三驾马车的角度来分析，对于经济的主要拖累项还是集中在固定资产投资方面。全年来看，城镇固定资产投资增速由 1 季度的 13.5% 回落至 12 月份的 10.0%。

通胀角度，受到经济低迷，以及大宗商品价格下跌的影响，全年通胀不断低于市场预期。其



中，CPI 在 8 月份达到将近 2% 的高点之后重新开始回落，全年水平预计在 1.5% 左右。PPI 同比数据更是全年持续下滑，最终累计下跌幅度大约在 5.2% 左右，创近年最大跌幅。

货币政策方面，全年央行维持较为宽松的货币环境，先后进行了五次降息降准，提供抵押补充贷款，开展中期借贷便利操作等一系列调控手段。

汇率政策在去年出现较大变化，8 月人民币汇率一次性贬值，汇率波动幅度较以往明显放大。人民币汇率超预期的大幅波动带领全球市场震荡，风险资产波动率指标中枢显著抬升。

2015 年资本市场回顾：

债券方面：全年债市表现强劲，机会主要集中在 15 年下半年。分时间来看，上半年债市整体进入震荡走势，10 年国债波动中枢在 3.5% 左右。进入下半年，受到股市动荡、经济数据持续低迷等因素的推动，债市整体收益率出现快速下行，10 年国债收益率最低到 2.8% 左右的水平。信用债利差整体也呈现持续下行的走势，年末来看中高等级信用利差已经回落至历史最低位区间。全年回顾来看，10 年国债收益率下行 80BP 左右。5 年期 AAA 信用债收益率下行超过 150BP。

股市方面：15 年经历了比较少有的大幅动荡，上半年以创业板为代表的中小盘股票持续大幅上涨，我们的理解是一方面货币政策宽松，经济低迷但无系统性风险，同时政策面对于新兴产业的支持给投资者带来乐观预期。进入年中期，受到政策去杠杆，以及人民币汇率大幅波动的影响，股市开始出现剧烈动荡。进入 4 季度，在政策宽松延续，同时汇率逐渐稳定以及一系列救市措施的推动下，市场开始重新回暖。全年来看，创业板、中小板大幅上涨，而以沪深 300 为代表的大盘权重股则涨幅非常有限。

报告期内本基金本着稳健投资原则，在风险和收益之间进行平衡。在获取绝对回报为前提的前提下，上半年积极参与转债投资，下半年积极参与转债打新，大类资产配置上以利率债和高等级信用债投资为主，维持组合较高杠杆和久期，自下而上精选信用债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.614 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.06%，业绩比较基准收益率为 8.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，预计 GDP 增速先稳后跌，前期政策托底效应依然延续，后期经济内生压力持续显现。核心关注点在于：煤炭、钢铁等产业链上游最终去杠杆的进度、形式。我们认为上述行业的去杠杆压力已经临近，2016 年将会对经济产生一定的下行压力。

2016 年，讨论的焦点在于美联储加息的大背景下，国内货币政策是否还有继续宽松的空间。

我们认为，一方面美联储的加息进程在 2016 年不会一蹴而就，而是一个逐步渐进的过程，因此对国内政策的实质性制约较小。另一方面，历史经验来看在外部环境相对稳定的情况下，内部因素主导政策变动。因此，我们预计 2016 年央行仍然有 1-2 次左右的降息空间，主要将集中于下半年，而降准概率和频率也将更高，全年 5-8 次。

就全球而言，需要关注美联储加息节奏，发达国家基本面相对稳健，黑天鹅可能出现在部分新兴经济体当中，尤其一些经常项目持续存在压力，已经呈现典型滞胀格局的经济体。新兴经济体和汇率政策的黑天鹅可能会成为触发我们内部经济调整的稻草。

本基金将继续本着稳健投资的原则，以中高等级信用债为主，积极运用杠杆策略，自下而上精选中低等级信用债提高票息收益，控制久期，积极参与可转债再融资增强组合收益，提高对权益类关注度，整体操作上中性，平衡类属配置。

#### 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、监察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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 20 日发布《嘉实债券开放式证券投资基金 2014 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.300 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实债券开放式证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.10 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 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形的说明

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实债券证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 审计报告

嘉实债券开放式证券投资基金 2015 年度财务会计报告已由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师汤骏、贺耀签字出具了“无保留意见的审计报告”（安永华明（2016）审字第 60468756\_A01 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,177,005.23                    | 21,888,698.31                    |
| 结算备付金           |            | 8,942,118.69                    | 14,883,374.15                    |
| 存出保证金           |            | 163,447.54                      | 51,438.45                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 864,856,923.76                  | 748,224,954.98                   |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 864,856,923.76                  | 748,224,954.98                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 48,502,486.14                   | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 19,071,918.66                   | 15,095,387.78                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,073,238.03                    | 178,000.57                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 943,787,138.05                  | 800,321,854.24                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 327,232,360.00                  | 230,299,974.10                   |
| 应付证券清算款         |            | -                               | 17,975,970.68                    |
| 应付赎回款           |            | 904,010.69                      | 1,508,456.12                     |
| 应付管理人报酬         |            | 306,417.19                      | 297,002.46                       |
| 应付托管费           |            | 102,139.06                      | 99,000.83                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 33,184.68                       | 60,603.53                        |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | 185,618.48     | 95,603.94      |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 411,173.20     | 411,396.39     |
| 负债合计          |          | 329,174,903.30 | 250,748,008.05 |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 380,788,068.27 | 367,447,161.89 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 233,824,166.48 | 182,126,684.30 |
| 所有者权益合计       |          | 614,612,234.75 | 549,573,846.19 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 943,787,138.05 | 800,321,854.24 |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.614 元，基金份额总额 380,788,068.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目           | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|---------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|               |          | 2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>   |          | 66,272,117.76                       | 73,846,603.43                       |
| 1. 利息收入       |          | 39,167,669.70                       | 46,701,498.39                       |
| 其中：存款利息收入     | 7.4.7.11 | 245,432.02                          | 307,453.17                          |
| 债券利息收入        |          | 38,922,237.68                       | 46,266,442.47                       |
| 资产支持证券利息收入    |          | -                                   | 127,602.75                          |
| 买入返售金融资产收入    |          | -                                   | -                                   |
| 其他利息收入        |          | -                                   | -                                   |
| 2. 投资收益       |          | 13,628,773.73                       | 204,341.49                          |
| 其中：股票投资收益     | 7.4.7.12 | 1,273,211.13                        | -                                   |
| 基金投资收益        |          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益        | 7.4.7.13 | 12,161,766.81                       | 204,341.49                          |
| 资产支持证券投资收益    |          | -                                   | -                                   |
| 贵金属投资收益       |          | -                                   | -                                   |
| 衍生工具收益        | 7.4.7.14 | -                                   | -                                   |
| 股利收益          | 7.4.7.15 | 193,795.79                          | -                                   |
| 3. 公允价值变动收益   | 7.4.7.16 | 13,062,555.24                       | 26,786,122.29                       |
| 4. 汇兑收益       |          | -                                   | -                                   |
| 5. 其他收入       | 7.4.7.17 | 413,119.09                          | 154,641.26                          |
| <b>减：二、费用</b> |          | 12,259,032.46                       | 17,454,890.11                       |

|               |          |                      |                      |
|---------------|----------|----------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬      |          | 3,448,157.22         | 3,704,412.13         |
| 2. 托管费        |          | 1,149,385.80         | 1,234,804.15         |
| 3. 销售服务费      |          | -                    | -                    |
| 4. 交易费用       | 7.4.7.18 | 303,592.73           | 156,891.11           |
| 5. 利息支出       |          | 7,119,829.43         | 12,115,610.29        |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |          | 7,119,829.43         | 12,115,610.29        |
| 6. 其他费用       | 7.4.7.19 | 238,067.28           | 243,172.43           |
| <b>三、利润总额</b> |          | <b>54,013,085.30</b> | <b>56,391,713.32</b> |
| 减：所得税费用       |          | -                    | -                    |
| <b>四、净利润</b>  |          | <b>54,013,085.30</b> | <b>56,391,713.32</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）           | 367,447,161.89                              | 182,126,684.30  | 549,573,846.19  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -   | 54,013,085.30   | 54,013,085.30   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | 13,340,906.38                               | 8,680,694.53    | 22,021,600.91   |
| 其中：1. 基金申购款               | 478,083,594.04                              | 261,832,342.34  | 739,915,936.38  |
| 2. 基金赎回款                  | -464,742,687.66                             | -253,151,647.81 | -717,894,335.47 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -   | -10,996,297.65  | -10,996,297.65  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）           | 380,788,068.27                              | 233,824,166.48  | 614,612,234.75  |
| 项目                        | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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               | 464,627,056.48                              | 173,826,779.75  | 638,453,836.23  |

|                           |                 |                 |                 |
|---------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 金净值)                      |                 |                 |                 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)  | -               | 56,391,713.32   | 56,391,713.32   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -97,179,894.59  | -43,537,789.10  | -140,717,683.69 |
| 其中: 1. 基金申购款              | 197,303,080.57  | 86,791,656.28   | 284,094,736.85  |
| 2. 基金赎回款                  | -294,482,975.16 | -130,329,445.38 | -424,812,420.54 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -               | -4,554,019.67   | -4,554,019.67   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)           | 367,447,161.89  | 182,126,684.30  | 549,573,846.19  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>赵学军</u> | <u>王红</u> | <u>常旭</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致, 会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### 7.4.1.1 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。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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、基金注册登记人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金代销机构         |
| 中诚信托有限责任公司         | 基金管理人股东              |
| 立信投资有限责任公司         | 基金管理人股东              |
| 德意志资产管理（亚洲）有限公司    | 基金管理人股东              |

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,448,157.22                     | 3,704,412.13                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 221,784.76                       | 249,362.47                       |

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

###### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,149,385.80                     | 1,234,804.15                     |

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：



$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.4.3 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日      |        |               |       |      |                |            |
|---|--------|---------------|-------|------|----------------|------------|
| 银行间市场交易<br>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       |
| 中国银行  | -      | -             | -     | -    | 85,040,000.00  | 63,793.84  |
| 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |        |               |       |      |                |            |
| 银行间市场交易<br>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       |
| 中国银行  | -      | 44,101,923.02 | -     | -    | 361,848,000.00 | 217,229.75 |

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.4.4.2 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（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

#### 7.4.4.5 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |           |
|-------|--|------------|---|-----------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 1,177,005.23                           | 101,521.92 | 21,888,698.31                               | 87,807.28 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券****7.4.5.1.1 受限证券类别：股票**

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

**7.4.5.1.2 受限证券类别：债券**

金额单位：人民币元

| 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<br>(单位:<br>张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注   |
|--------|------|------------------------|----------------------|--------|--------|--------|------------------|------------|------------|------|
| 123001 | 蓝标转债 | 2015 年<br>12 月<br>23 日 | 2016 年<br>1 月<br>8 日 | 未上市    | 100.00 | 100.00 | 2,330            | 233,000.00 | 233,000.00 | 网下申购 |

**7.4.5.1.3 受限证券类别：其他**

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

**7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 159,999,360.00 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        |
|-----------|------------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| 101456074 | 14 豫高管<br>MTN001 | 2016 年 1 月<br>5 日 | 105.44 | 300,000 | 31,632,000.00 |
| 101460036 | 14 渝城投<br>MTN001 | 2016 年 1 月<br>5 日 | 107.16 | 180,000 | 19,288,800.00 |

|           |                |                |        |           |                |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 101459029 | 14 常熟经营 MTN001 | 2016 年 1 月 5 日 | 111.74 | 200,000   | 22,348,000.00  |
| 101459032 | 14 云南公开 MTN001 | 2016 年 1 月 5 日 | 110.97 | 338,000   | 37,507,860.00  |
| 140209    | 14 国开 09       | 2016 年 1 月 4 日 | 108.02 | 200,000   | 21,604,000.00  |
| 140219    | 14 国开 19       | 2016 年 1 月 4 日 | 106.80 | 100,000   | 10,680,000.00  |
| 130004    | 13 付息国债 04     | 2016 年 1 月 4 日 | 100.07 | 300,000   | 30,021,000.00  |
| 合计        |                |                |        | 1,618,000 | 173,081,660.00 |

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 167,233,000.00 元，于 2016 年 1 月 25 日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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            | 864,856,923.76 | 91.64         |
|    | 其中：债券             | 864,856,923.76 | 91.64         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,119,123.92  | 1.07          |
| 7  | 其他各项资产            | 68,811,090.37  | 7.29          |
|    | 合计                | 943,787,138.05 | 100.00        |

### 8.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600016 | 民生银行 | 26,733,292.38 | 4.86            |
| 2  | 603993 | 洛阳钼业 | 14,351,745.39 | 2.61            |
| 3  | 600037 | 歌华有线 | 13,333,007.70 | 2.43            |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 8,904,633.00  | 1.62            |
| 5  | 600219 | 南山铝业 | 8,729,368.65  | 1.59            |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 8,259,703.09  | 1.50            |
| 7  | 600023 | 浙能电力 | 7,553,727.17  | 1.37            |
| 8  | 002408 | 齐翔腾达 | 7,494,059.91  | 1.36            |
| 9  | 000089 | 深圳机场 | 4,469,337.78  | 0.81            |
| 10 | 601929 | 吉视传媒 | 3,605,123.01  | 0.66            |
| 11 | 600085 | 同仁堂  | 2,765,454.52  | 0.50            |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 2,629,966.00  | 0.48            |
| 13 | 600026 | 中海发展 | 1,248,394.24  | 0.23            |

注：报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金累计买入金额前 20 名的股票明细仅包括上述 13 只股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600016 | 民生银行 | 26,443,310.80 | 4.81            |
| 2  | 603993 | 洛阳钼业 | 13,861,050.50 | 2.52            |
| 3  | 600037 | 歌华有线 | 12,259,353.54 | 2.23            |
| 4  | 600028 | 中国石化 | 9,899,601.70  | 1.80            |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 9,514,197.39  | 1.73            |
| 6  | 600219 | 南山铝业 | 8,713,071.09  | 1.59            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7  | 600023 | 浙能电力 | 7,725,482.57 | 1.41 |
| 8  | 002408 | 齐翔腾达 | 5,975,378.38 | 1.09 |
| 9  | 601929 | 吉视传媒 | 4,368,283.16 | 0.79 |
| 10 | 600085 | 同仁堂  | 4,060,316.18 | 0.74 |
| 11 | 000089 | 深圳机场 | 3,877,299.47 | 0.71 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 3,336,267.20 | 0.61 |
| 13 | 600026 | 中海发展 | 1,317,411.99 | 0.24 |

注：报告期（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金累计卖出金额前20名的股票明细仅包括上述13只股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 110,077,812.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 111,351,023.97 |

注：8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

### 8.5 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      | 112,782,040.30 | 18.35        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 42,964,000.00  | 6.99         |
|    | 其中：政策性金融债 | 42,964,000.00  | 6.99         |
| 4  | 企业债券      | 324,118,583.46 | 52.74        |
| 5  | 企业短期融资券   | 42,343,800.00  | 6.89         |
| 6  | 中期票据      | 342,415,500.00 | 55.71        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 233,000.00     | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
|    | 合计        | 864,856,923.76 | 140.72       |

### 8.6 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

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 | 1382081   | 13 豫水利<br>MTN1    | 400,000 | 42,104,000.00 | 6.85 |
| 2 | 101459023 | 14 人福<br>MTN001   | 400,000 | 40,636,000.00 | 6.61 |
| 3 | 101459032 | 14 云南公开<br>MTN001 | 350,000 | 38,839,500.00 | 6.32 |
| 4 | 010213    | 02 国债(13)         | 335,110 | 33,745,577.00 | 5.49 |
| 5 | 101456074 | 14 豫高管<br>MTN001  | 300,000 | 31,632,000.00 | 5.15 |

### 8.7 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。

### 8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 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   | 163,447.54    |
| 2  | 应收证券清算款 | 48,502,486.14 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | -             |
| 4 | 应收利息  | 19,071,918.66 |
| 5 | 应收申购款 | 1,073,238.03  |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
|   | 合计    | 68,811,090.37 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 19,511       | 19,516.58     | 104,631,819.31 | 27.48%     | 276,156,248.96 | 72.52%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 12,173.92 | 0.00%    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2003年7月9日）基金份额总额 | 586,521,597.17 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 367,447,161.89 |
| 本报告期基金总申购份额              | 478,083,594.04 |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 464,742,687.66 |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -              |
| 本报告期末基金份额总额              | 380,788,068.27 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

2015年5月8日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 70,000.00 元，该审计机构已连续 13 年提供审计服务。



## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 中信证券股份有限公司   | 1      | 101,498,346.12 | 91.15%       | 144,496.75 | 91.26%     | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | 9,852,677.85   | 8.85%        | 13,835.02  | 8.74%      | -  |
| 华泰证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 宏信证券有限责任公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东方证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

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。

### 11.7.2 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            |                | 权证交易 |              |
|--------------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|              | 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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司   | 816,768,287.56 | 81.85%       | 14,333,200,000.00 | 82.26%         | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 181,133,276.11 | 18.15%       | 3,091,172,000.00  | 17.74%         | -    | -            |

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2016年3月29日