

嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝 7 天债券	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 8 月 29 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	57,741,371.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码:	070035	070036
报告期末下属分级基金的份额总额	46,590,552.92 份	11,150,818.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据宏观经济指标决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布，根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例，根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别；根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标以及个别债券的收益率与剩余期限的配比等指标进行投资。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010) 65182266	(010) 68121816

2.4 信息披露方式

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

§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

基金级别	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	560,899.93	97,259.59
本期利润	560,899.93	97,259.59
本期净值收益率	0.7336%	0.8798%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	46,590,552.92	11,150,818.27
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	17.6789%	18.9958%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

（2）嘉实理财宝 7 天债券 A 与嘉实理财宝 7 天债券 B 适用不同的销售服务费率；（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（4）本基金收益在基金份额“7 天持有周期到期日”集中结转为基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实理财宝 7 天债券 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 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	0.0977%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	-0.0133%	0.0002%
过去三个月	0.3194%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	-0.0172%	0.0005%
过去六个月	0.7336%	0.0009%	0.6732%	0.0000%	0.0604%	0.0009%

过去一年	1.6511%	0.0046%	1.3537%	0.0000%	0.2974%	0.0046%
过去三年	14.5624%	0.0868%	4.0537%	0.0000%	10.5087%	0.0868%
自基金合同生效起至今	17.6789%	0.0768%	5.1855%	0.0000%	12.4934%	0.0768%

嘉实理财宝 7 天债券 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1216%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0106%	0.0002%
过去三个月	0.3919%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.0553%	0.0005%
过去六个月	0.8798%	0.0009%	0.6732%	0.0000%	0.2066%	0.0009%
过去一年	1.9471%	0.0046%	1.3537%	0.0000%	0.5934%	0.0046%
过去三年	15.5620%	0.0867%	4.0537%	0.0000%	11.5083%	0.0867%
自基金合同生效起至今	18.9958%	0.0767%	5.1855%	0.0000%	13.8103%	0.0767%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实理财宝 7 天债券 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

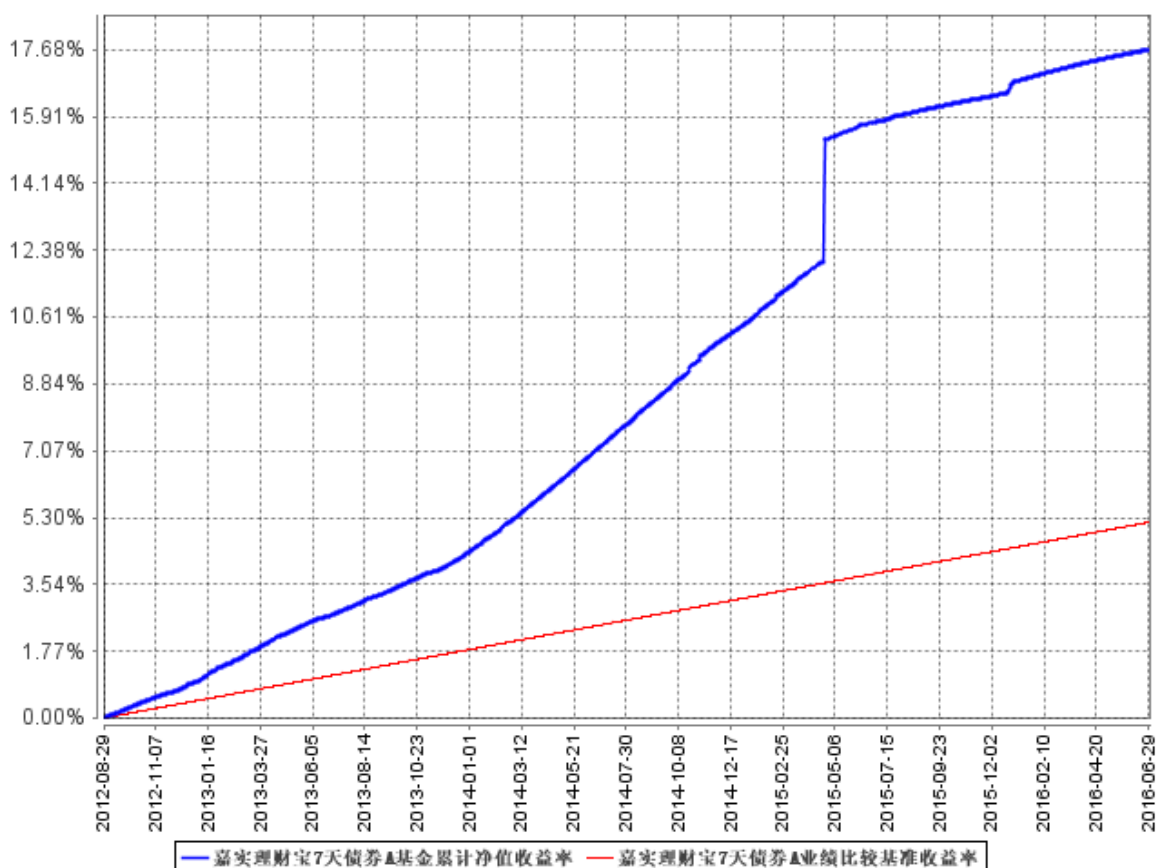


图 1：嘉实理财宝 7 天债券 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

(2012年8月29日至2016年6月30日)

嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

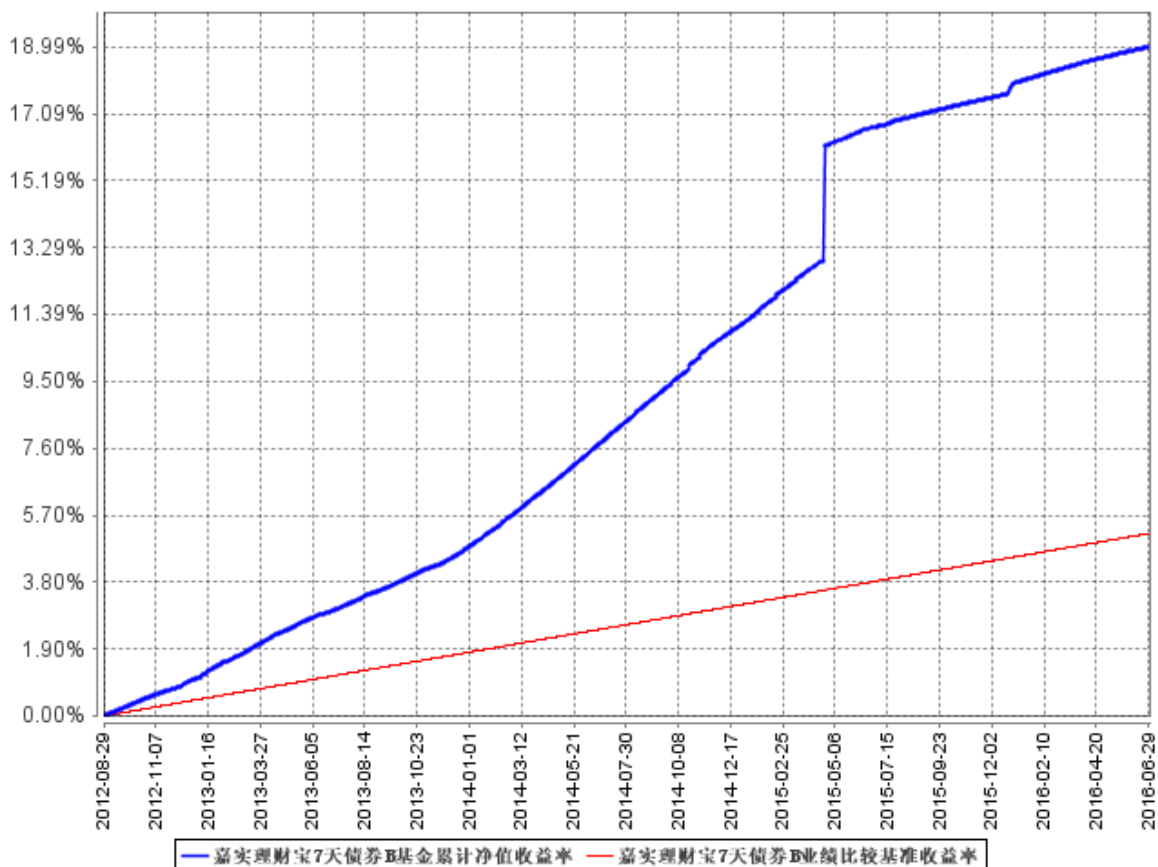


图2：嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年8月29日至2016年6月30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十二部分（二、投资范围和四、投资限制）的有关约定。

§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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 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、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。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		
魏莉	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实 1 个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2013 年 12 月 19 日	-	13 年	曾任职于国家开发银行国际金融局，中国银行澳门分行资金部经理。2008 年 7 月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士，CFA，CPA，具有基金从业资格，中国国籍。
张文玥	本基金、嘉实安心货币、嘉实货币、嘉实宝 A/B、嘉实 1 个月理财债券、嘉实 3 个月理财债券、嘉实机构快线货币基金经理	2014 年 8 月 13 日	-	8 年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士，具有基金从业资格。
李瞳	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实机构快线货币基金经理	2015 年 5 月 14 日	-	6 年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士研究生，具有基金从业资格。

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；（3）2016 年 7 月 23 日，本基金管理人发布《关于嘉实理财宝 7 天债券基金经理变更的公告》，魏莉女士不再担任本基金基金经理，聘请李金灿先生担任本基金基金经理职务，与张文玥女士、李瞳先生共同管理本基金。

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、《嘉实理财宝 7 天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，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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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 年是 2008 年国际金融危机爆发后，世界经济复苏力度最弱的一年。经济合作与发展组织近期发布的半年一次的经济展望报告中说，当前全球经济陷入了“低增长陷阱”，各国需要加大投入带动增长速度。发达国家增速缓慢，许多新兴经济体增速也在放缓，有的甚至在萎缩。鉴于企业投资新增乏力，消费者支出谨慎，经合组织预测今年全球经济增长幅将只有 3%。全球经济还将面临英国脱离欧盟的后续影响、新兴经济体的高信贷增长和债务风险，以及动荡的金融市场等等因素。世界银行 6 月初发布的《全球经济展望》中表示年初以来世界经济持续疲软，下行风险凸显，复苏仍在延续但力度差于预期。世行因此将今年世界经济增速预期从 1 月时的 2.9% 下调至 2.4%。

2016 年上半年国内经济整体呈现弱复苏，GDP 同比增速 6.7%，虽然政府积极实施稳增长措施、继续推进深化改革和执行宽松的货币政策，经济下行压力依然较大，复苏基础不牢固。具体来看，工业增加值趋于平稳，上半年同比增速均值为 5.96%，低于去年同比增速均值 6.09%；

“克强指数”上半年均值为 4.19%，明显高于去年均值 1.16%；中国制造业采购经理指数（PMI）在荣枯线附近徘徊，上半年均值为 49.80%，略低于去年均值 49.91%。以投资、消费和出口为代表的“三驾马车”增速持续处于低位，固定资产投资呈现震荡态势，上半年累计同比增速均值为 10.00%，低于去年均值 11.36%，其中房地产开发投资趋于向好，上半年累计同比增速均值为

5.90%，高于去年均值 4.48%，基础设施投资维持平稳，上半年累计同比增速均值为 18.95%，民间固定资产投资则呈现大幅回落，上半年累计同比增速为 4.88%，大幅低于去年均值 11.63%；社会消费品零售总额较为平稳，上半年同比增速均值为 10.28%，略低于去年均值 10.66%；受国际市场需求疲软影响，出口形势整体低迷，出口金额上半年同比增速均值分别为-7.33%，明显低于去年均值-1.19%。另外，上半年全国居民消费价格总水平同比增速均值为 2.10%，高于去年均值 1.44%；上半年 PPI 同比增速为-3.88%，高于去年均值-5.22%。从金融数据来看，货币供应量处于高位，M2 上半年同比增速均值为 12.85%，高于去年均值 12.32%；社会融资规模处于高位，上半年新增规模均值为 1.62 万亿元，高于去年均值 1.27 万亿元；新增人民币贷款处于高位，上半年新增均值为 1.25 万亿元，高于去年均值 0.98 万亿元。上半年人民币汇率呈现先升后贬走势，CNY 上半年累计贬值 2.3%，CNH 上半年累计贬值 1.5%，上半年央行外汇资产新增为-1.22 万亿元，较去年同期大幅减少 8700 亿元，跨境资金流出规模依然较大。

为兼顾维稳人民币汇率和应对经济下行风险，央行货币政策整体维持适度宽松，2016 年上半年央行仅降准 1 次，此外央行优化公开市场操作和加大定向政策工具使用，上半年公开市场操作累计净投放资金 9500 亿元，国库现金定存累计净投放资金 900 元，MLF 累计净投放资金 10797 亿元，PSL 累计净投放资金 5907 亿元。银行间市场资金利率整体维稳，2016 半年末隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较去年末分别持平、+39BP、-14BP 和-12BP；银行间市场国债收益率曲线也维持平稳，2016 半年末国债收益率曲线 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年期收益率较去年末分别+9BP、持平、-1BP、1BP 和 2BP，10 年期与 1 年期国债期限利差为 45BP，较去年末缩小 8BP。

2016 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券投资和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制债券整体仓位。整体看，2016 年上半年本基金成功应对了市场波动，投资业绩平稳提高，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝 7 天债券 A 的基金份额净值收益率为 0.7336%，嘉实理财宝 7 天债券 B 的基金份额净值收益率为 0.8798%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国人民银行近期发布的《中国金融稳定报告（2016）》在展望 2016 年全球经济时认为，

2016 年，全球经济将继续呈现不均衡复苏。IMF 预计 2016 年和 2017 年全球经济增速分别为 3.4% 和 3.6%，低于前期预测值。

2016 年下半年国际经济继续分化，黑天鹅事件突发将加剧国际市场波动，如 6 月底的英国公投脱欧已经成为影响上半年全球经济的最大的黑天鹅事件，并引发对欧洲一体化甚至全球化进程逆转的担忧。此外，还包括 11 月份美国大选对美国乃至全球经济的影响、美联储加息节奏、全球经济面临的高债务、低生产率增速和较窄的政策回旋空间等带来的风险。从国内经济来看，国内经济复苏基础不牢固，预计消费品零售增幅基本平稳，固定资产投资、房地产投资、货币供应增幅略有下降，出口增长延续低迷。

由于产能过剩和实际利率水平过高，信用风险开始逐渐暴露。2015 年债券市场违约事件频发，出现 8 起公募债券违约，2016 年上半年已有 17 个债券发行主体共计 34 只债券发生违约事件，2016 年下半年在去产能和去杠杆加速的背景下，预计债券违约将继续扩大，回归正常化。2016 年，中国债券市场到期偿还量创历史新高，尤其是下半年，将迎来偿还高峰，Wind 资讯统计显示，7-12 月期间，共 2.34 万亿元的信用债必须偿还，远高于上半年的 2.1 万亿元。违约债券覆盖面或有所扩大，从公募产品到私募产品，从国有企业到民营企业，从利息违约到本金违约等等。

预计 2016 年货币政策将延续中性偏松，鉴于国内外经济状况分化，人民币贬值压力依然较大，外汇占款仍然处于下行通道，国内流动性仍需央行通过降准或其他政策工具及时补充，加上国内经济下行压力依然较大，需货币政策予以支持。预计 2016 年下半年财政政策将更加积极，在经济下行和结构性改革背景下，财政政策更具优势，将加大新基建投资，弥补民间投资不足，稳定经济增长。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

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、合规部等

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

根据本基金基金合同第十六部分（二）收益分配原则的约定：“3. 本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，在基金份额“7 天持有周期到期日”集中支付”、“5. 本基金每日进行收益计算并分配时，在基金份额“7 天持有周期到期日”累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式”的内容，本期 A 类份额已实现收益为 560,899.93 元，每日分配，到期支付，合计分配 560,899.93 元，B 类份额已实现收益为 97,259.59 元，每日分配，到期支付，合计分配 97,259.59 元，符合本基金基金合同的约定。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：嘉实理财宝7天债券型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,724,261.41	1,450,340.64
结算备付金		-	66,666.67
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,096,663.46	70,143,610.38
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,096,663.46	70,143,610.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	75,000,187.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,087,480.90	1,738,286.00
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	32,900,032.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,908,705.77	181,299,123.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31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		-	-
应付证券清算款		-	30,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,210.26	18,934.66
应付托管费		3,914.20	5,610.27
应付销售服务费		12,029.37	18,681.10
应付交易费用	6.4.7.7	1,375.30	2,557.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		5,147.29	89,888.63
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	131,658.16	188,900.00
负债合计		167,334.58	30,324,572.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	57,741,371.19	150,974,550.87
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		57,741,371.19	150,974,550.87
负债和所有者权益总计		57,908,705.77	181,299,123.41

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，嘉实理财宝 7 天债券 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 46,590,552.92 份；嘉实理财宝 7 天债券 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,150,818.27 份。嘉实理财宝 7 天债券基金份额总额合计为 57,741,371.19 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金
本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		1,064,380.57	47,511,560.03
1.利息收入		1,054,777.88	44,706,490.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,593.34	29,776,606.45
债券利息收入		957,870.36	13,595,517.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		72,314.18	1,334,366.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益		9,602.69	2,805,069.63
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	9,602.69	2,805,069.63
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益		-	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		406,221.05	5,243,426.13
1. 管理人报酬		114,863.58	2,081,246.36
2. 托管费		34,033.66	616,665.62
3. 销售服务费		111,614.03	168,879.02
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		31,637.07	2,149,003.29
其中：卖出回购金融资产支出		31,637.07	2,149,003.29
6. 其他费用	6.4.7.15	114,072.71	227,631.84
三、利润总额		658,159.52	42,268,133.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润		658,159.52	42,268,133.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实理财宝7天债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	150,974,550.87	-	150,974,550.87
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	658,159.52	658,159.52
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-93,233,179.68	-	-93,233,179.68
其中：1. 基金申购款	81,835,295.46	-	81,835,295.46
2. 基金赎回款	-175,068,475.14	-	-175,068,475.14
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动	-	-658,159.52	-658,159.52
五、期末所有者权益 (基金净值)	57,741,371.19	-	57,741,371.19
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	2,408,630,686.56	-	2,408,630,686.56
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	42,268,133.90	42,268,133.90
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-2,302,433,669.18	-	-2,302,433,669.18
其中:1.基金申购款	599,309,077.52	-	599,309,077.52
2.基金赎回款	-2,901,742,746.70	-	-2,901,742,746.70
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动	-	-42,268,133.90	-42,268,133.90
五、期末所有者权益 (基金净值)	106,197,017.38	-	106,197,017.38

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 王红 常旭
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	114,863.58	2,081,246.36
其中：支付销售机构的客户维护费	31,695.69	29,067.61

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 0.27% 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 × 0.27% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,033.66	616,665.62

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 × 0.08% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	5,727.86	-	5,727.86
中国农业银行	19,081.96	-	19,081.96
合计	24,809.82	-	24,809.82
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝 7 天 债券 A	嘉实理财宝 7 天债 券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	7,500.55	73,487.44	80,987.99
中国农业银行	27,251.32	51.58	27,302.90
合计	34,751.87	73,539.02	108,290.89

注：（1）嘉实理财宝 7 天债券 A 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日 A 类基金份额销售服务费 = 前一日 A 类基金份额资产净值 × 0.30% / 当年天数。

（2）嘉实理财宝 7 天债券 B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类条件的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日 B 类基金份额销售服务费 = 前一日 B 类基金份额资产净值 × 0.01% / 当年天数。

6.4.4.3 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

银行间市场交易 的 各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
	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
中国农业银行	-	-	-	-	11,270,000.00	758.61

注：上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），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。

6.4.4.4.2 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（2016 年 6 月 30 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	5,724,261.41	23,924.24	12,834,614.78	89,572.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 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。

6.4.5 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本期末（2016 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证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购**

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	固定收益投资	50,096,663.46	86.51
	其中：债券	50,096,663.46	86.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,724,261.41	9.88
4	其他各项资产	2,087,780.90	3.61
	合计	57,908,705.77	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.84	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

(2)报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	31
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	9.91	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	86.76	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	96.67	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,096,663.46	86.76
	其中：政策性金融债	50,096,663.46	86.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
	合计	50,096,663.46	86.76
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	110314	11 进出 14	500,000	50,096,663.46	86.76

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0604%
报告期内偏离度的最低值	-0.0175%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0231%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2

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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,087,480.90
4	应收申购款	300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	2,087,780.90

§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

份额 级别	持有人 户数	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
嘉实理财宝 7 天债券 A	3,859	12,073.22	556,110.16	1.19%	46,034,442.76	98.81%
嘉实理财宝 7 天债券 B	1	11,150,818.27	-	-	11,150,818.27	100.00%
合计	3,860	14,958.90	556,110.16	0.96%	57,185,261.03	99.04%

注：(1) 嘉实理财宝 7 天债券 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实理财宝 7 天债券 B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实理财宝 7 天债券 A	803.90	0.00%
	嘉实理财宝 7 天债券 B	-	0.00%
	合计	803.90	0.00%

8.3 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	份额级别	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	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
基金合同生效日（2012 年 8 月 29 日） 基金份额总额	5,847,460,658.26	3,681,065,212.36
本报告期期初基金份额总额	139,925,052.09	11,049,498.78
本报告期基金总申购份额	81,733,975.97	101,319.49
减：本报告期基金总赎回份额	175,068,475.14	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	46,590,552.92	11,150,818.27

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投份额及基金份额自动升降级调增份额；基金总赎回份额含基金份额自动升降级调减份额。

§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

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士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

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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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	
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	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。

注 3：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：德邦证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

10.7.2 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	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
中国银河证券股份有限公司	-	-	23,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

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
2016 年 8 月 27 日