

嘉实3个月理财债券型证券投资基金 2016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：2017年3月29日

§1 重要提示

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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。

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2016年1月1日起至2016年12月31日止（注：本基金第二期运作期起始日为2016年6月14日、期满日为2016年9月13日，本基金第三期运作期起始日为2016年12月23日、期满日为2017年3月22日）。

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 3 个月理财债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实 3 个月理财债券	
基金主代码	000487	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 27 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	2,135,462,490.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
下属分级基金的交易代码:	000487	000488
报告期末下属分级基金的份额总额	0.00 份	2,135,462,490.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。
投资策略	<p>在运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在运作期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。</p> <p>本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具，如：银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等）等。在运作期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。</p>
业绩比较基准	-
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年		2014 年 6 月 27 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	
	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
本期已实现收益	-	40,409,728.43	-	-	2,207,226.29	113,825.90
本期利润	-	40,409,728.43	-	-	2,207,226.29	113,825.90
本期净值收益率	-	0.8912%	-	-	1.0277%	1.0869%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	期末基金资产净值	-	2,135,462,490.95	-	-	-
期末基金份额净值	-	1.0000	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	累计净值收益率	1.0277%	1.9781%	-	-	1.0277%

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 3 个月理财 A 类和 E 类基金份额适用相同的托管费率；管理费以分档计提方式收取，浮动管理费率上限为 0.30%；A 类、E 类适用不同的销售服务费费率。（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。（4）本基金每日计算当日收益并分配，在每个运作期期满后的下一个工作日集中支付。（5）本基金以 2016 年 12 月 23 日至 2017 年 3 月 22 日为第三个运作期。

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3个月理财债券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
过去三个月	0.0000%	0.0000%				
过去六个月	0.0000%	0.0000%				
过去一年	0.0000%	0.0000%				
自基金合同 生效起至今	1.0277%	0.0067%				

嘉实3个月理财债券E

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
过去三个月	0.1352%	0.0001%				
过去六个月	0.7503%	0.0017%				
过去一年	0.8912%	0.0016%				
自基金合同 生效起至今	1.9781%	0.0050%				

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

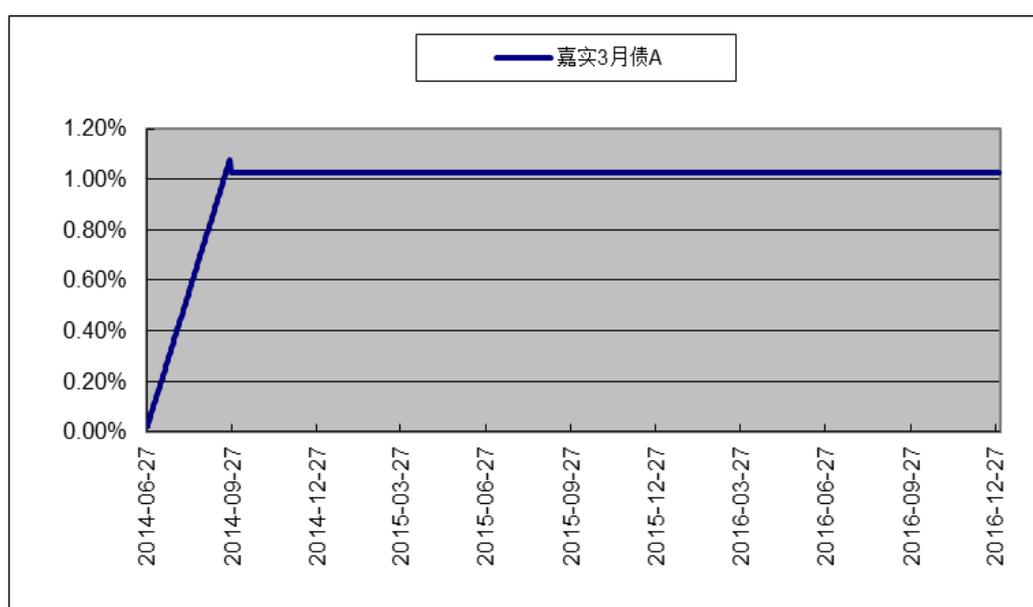


图1: 嘉实3个月理财债券A基金累计净值收益率的历史走势对比图

(2014 年 6 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日)

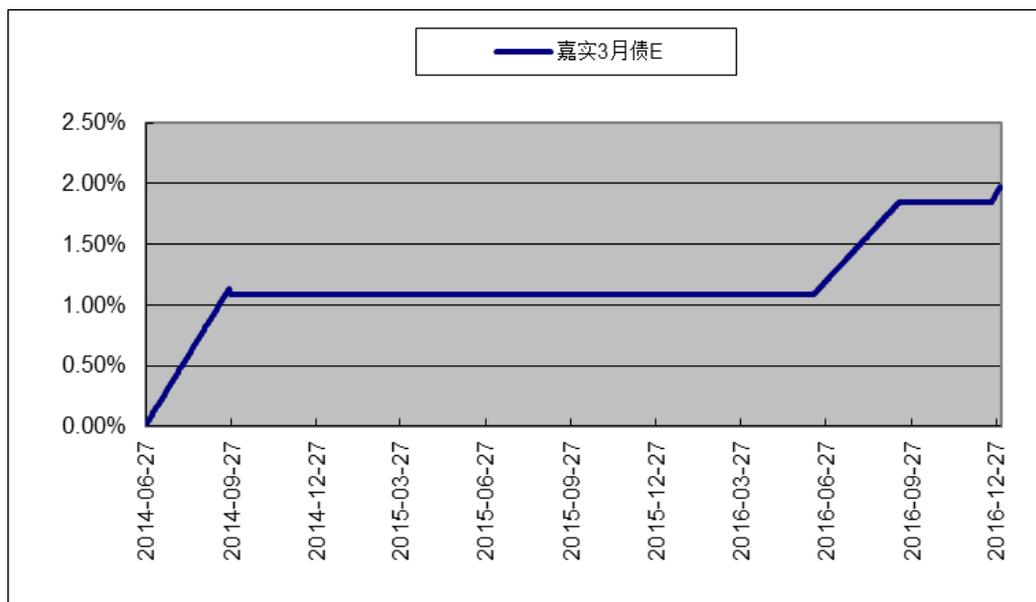


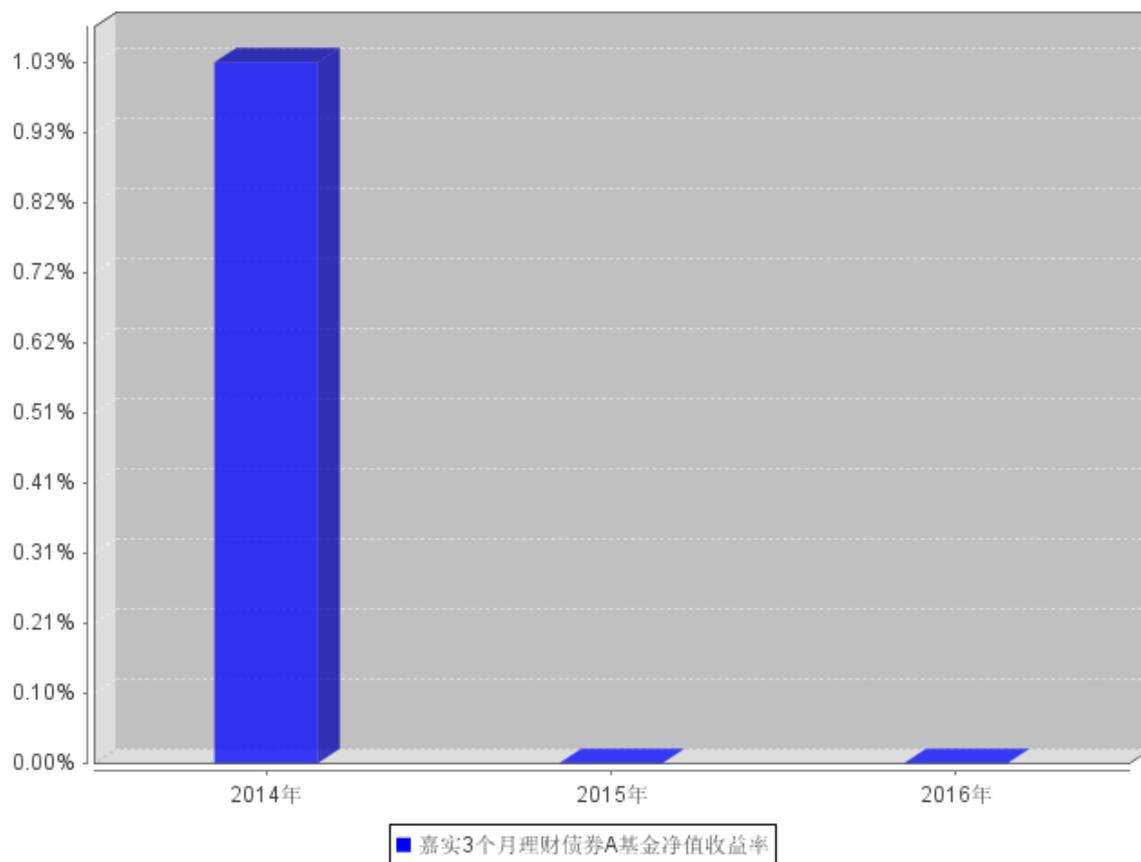
图 2：嘉实 3 个月理财债券 E 基金累计净值收益率的历史走势对比图

(2014 年 6 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日)

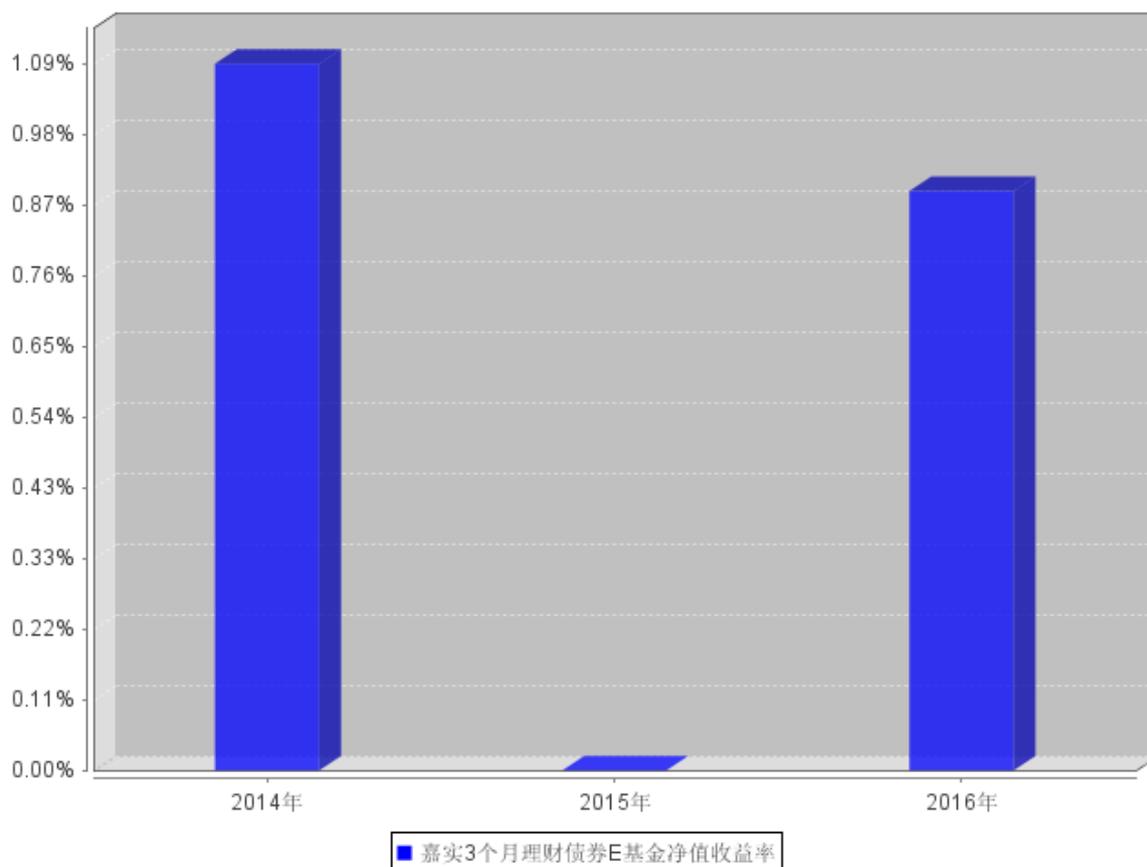
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自每个运作期开始后的 10 个工作日内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

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

嘉实3个月理财债券A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实3个月理财债券E自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为2014年6月27日，2014年度的相关数据根据当年实际存续期（2014年6月27日至2014年12月31日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

嘉实3个月理财债券A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	-	-	-	-	
2015年	-	-	-	-	
2014年	2,207,226.29	-	-	2,207,226.29	
合计	2,207,226.29	-	-	2,207,226.29	

单位：人民币元

嘉实3个月理财债券E					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	37,802,501.37	-	2,607,227.06	40,409,728.43	
2015年	-	-	-	-	
2014年	113,825.90	-	-	113,825.90	
合计	37,916,327.27	-	2,607,227.06	40,523,554.33	

§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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、111 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、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯

债债券、嘉实稳瑞纯债债券、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、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券。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		
万晓西	本基金、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实宝A/B、嘉实机构快线货币基金经理，公司固定收益业务体系短端alpha策略组组长	2014年6月27日	-	16年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理，2013年2月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系短端alpha策略组组长，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、嘉实理财宝7天债券、嘉实1个月理财债券、嘉实机构快线货币、嘉实现金宝货币基金、嘉实定期宝6个月理财债券经理	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。

注：（1）基金经理万晓西的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理张文玥的任职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合规守信情况的说明

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3个月理财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 6 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

2016 年，前三季度央行主导下市场资金面保持宽松，但是四季度在央行主导下货币政策回归中性偏紧，货币市场收益率波动性加大，导致债券市场波动增加。宏观经济数据显示，2016 年整体经济增长压力较大，到四季度整体经济增长呈现底部企稳，但是结构性矛盾突出，供给侧改革和去产能过程收到明显成效，通胀有一定上升势头，房地产市场过热引发关注并遭到政策打压。国际形势动荡，外汇占款仍流出，美国大选结果和英国脱欧超预期，12 月美联储加息，美元指数和美债收益率攀升，人民币贬值压力增加。针对上述宏观经济环境，央行更加注重货币政策执行的前瞻性、针对性和灵活性，完善宏观审慎政策框架，根据经济和市场运行情况，运用公开市场操作和各类创新工具对市场资金面进行预调微调。但是，中央经济工作会议明确下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在首要位置，未来金融去杠杆过程仍将延续。

上半年央行维持货币政策放松操作，3 月降低存款准备金率 50bps，前三季公开市场货币净投放超过 14000 亿，并配合 SLO 和 MFL 等措施，调节市场流动性缺口，促进降低社会融资成本，支持实体经济发展。四季度央行公开市场净投放 3114 亿，但是央行通过 MLF 操作持续进行“锁短放长”，调节市场流动性缺口的同时资金成本提升。四季度银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 2.29%和 2.81%，较前 3 季度均值 2.05%和 2.47%明显上行。

相较于短端资金成本的稳定，二季度中长端债券收益率曾有阶段性上行，主要原因是 4 月以铁物资和东北特钢为代表的国企债券违约事件，引发市场对信用债全面谨慎，投资者赎回增加导致基金被迫卖出债券，流动性好的利率债也受到冲击，收益率曲线全线上行 30-50bps。但是后期信用违约面未进一步扩大，市场资金充裕，通货膨胀数据也低于预期，市场可投资标的有限，以银行理财为主的配置资金对债券仍有大量需求，债券牛市又持续到了三季度。四季度债券市场剧烈波动，收益率曲线全线上行。全年看来，整体回顾，2016 年债券市场先涨后跌，1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于 3.18%和 3.68%，较上年末 2.40%和 3.13%大幅平坦化上行。2016 年信用债市场收益率基本跟随利率债市场波动，信用利差先压缩后扩宽。三季度之前在资金宽松和配置压力推动下，整体收益率下行，同时信用利差进一步压缩；四季度信用债市场在资金紧张、去杠杆和估值上行压力推动下，收益率也跟随利率债大幅上扬，信用利差跟随扩宽。

整体看 2016 年末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率收于 3.91%，同期中等评级的 AA+ 级短融收益率收于 4.17%，较上年末的 2.87% 和 3.20% 均大幅上行。并且 2016 年信用债市场进一步分化，因经济增长乏力、去过剩产能和债务重组压力增加、信贷不良率上升、信用事件爆发等原因，投资者更加谨慎地规避周期行业和民企等信用评级较差券种。

2016 年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务；灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制银行存单和债券资产配置比例，组合保持中性较短久期，在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险；谨慎筛选组合投资个券，严控信用风险；灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看，2016 年本基金成功应对了市场和规模波动，投资业绩平稳，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 3 个月理财债券 A 的基金份额净值收益率为 0.0000%，嘉实 3 个月理财债券 E 的基金份额净值收益率为 0.8912%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济、货币政策和短期资金面仍是影响货币市场的主要因素。整体看，全球主要经济体增长形势和政策将继续分化。美国经济稳步复苏，美联储加息节奏和美元走势是影响市场的关键因素；特朗普就任后的政策存在多重不确定性，不仅会导致国际金融市场持续波动，还对全球经济增长格局带来长期深远影响；欧洲政治风险增加，但经济增长仍然乏力，但发达国家货币政策宽松到头，开始趋向于收缩央行资产负债表的态势比较明显；新兴经济体仍面临汇率贬值、资金外逃和经济萧条等多重挑战，国际资本流动不确定性进一步增加，预期主要货币汇率需要一段时间达成再平衡；由此带来的影响将错综复杂。而国内经济运行也面临多重问题和挑战，增长过程中的结构性失衡依然存在，需要继续深化供给侧改革。中央经济工作会议明确稳中求进工作总基调是治国理政的重要原则，下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在更加重要位置，货币政策要保持稳健中性，调节好货币闸门，维护流动性基本稳定。

针对上述国内外经济形势和货币环境，预计 2017 年在央行的主导下，货币政策执行上由 2016 年相对宽松转为紧平衡，会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性，根据实体经济增长情况和市场变动，综合运用公开市场操作和各类创新工具进行调整和指导，以支持实体经济增长势头。2017 年整体金融市场去杠杆过程将延续，叠加外汇市场波动和人民币汇率贬值压力，市场

资金面波动概率增加。央行公开市场操作、回购利率和各种定向或创新工具运用将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。2017 年受基数、天气原因和油价等因素影响，预期通胀有上行趋势。政府地方债置换计划继续实施，存量债券到期较多有续发需求，债市供给维持高位，股票市场继续推进改革，这些方面的政策投资者均要重点关注。

针对上述复杂的市场环境，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、存单和债券投资，谨慎选择组合的信用券种持仓，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但不限于上海、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“3. 本基金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，在每个运作期期满后的下一个工作日集中支付”的内容，本期嘉实 3 个月理财债券 E 类份额已实现收益为 40,409,728.43 元，每日分配，运作期期满后集中支付，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

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 3 个月理财债券型证券投资基金（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 3 个月理财债券型证券投资基金 2016 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计、注册会计师许康玮、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2017)第 20660 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 3 个月理财债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,135,461,433.94	11,878.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,641,971.76	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,138,103,405.70	11,878.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		23,906.41	-
应付销售服务费		4,781.28	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		2,607,227.06	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	5,000.00	11,878.06
负债合计		2,640,914.75	11,878.06
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,135,462,490.95	-

未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,135,462,490.95	-
负债和所有者权益总计		2,138,103,405.70	11,878.06

注1：报告截止日2016年12月31日，无嘉实3个月理财债券A基金份额；嘉实3个月理财债券E基金份额净值1.0000元，基金份额总额2,135,462,490.95份。嘉实3个月理财债券基金份额总额合计为2,135,462,490.95份。

注2：上年度末（2015年12月31日），嘉实3个月理财债券基金份额为零。嘉实3个月理财债券基金于2015年度无开放及运作期。

7.2 利润表

会计主体：嘉实3个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		41,235,525.86	-
1.利息收入		41,223,528.36	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	41,223,528.36	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
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	7.4.7.13	11,997.50	-
减：二、费用		825,797.43	-
1.管理人报酬		37,808.22	-
2.托管费		645,491.01	-
3.销售服务费		129,098.20	-
4.交易费用	7.4.7.14	-	-
5.利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.15	13,400.00	-
三、利润总额		40,409,728.43	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润		40,409,728.43	-

注：上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日）没有开放及运作期，无利润相关数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实3个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	40,409,728.43	40,409,728.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,135,462,490.95	-	2,135,462,490.95
其中：1. 基金申购款	7,173,265,192.32	-	7,173,265,192.32
2. 基金赎回款	-5,037,802,701.37	-	-5,037,802,701.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-40,409,728.43	-40,409,728.43
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,135,462,490.95	-	2,135,462,490.95
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注：上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日）没有开放及运作期，无所有者权益变动相关数据。

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 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一致。

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、基金注册登记机构、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

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（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,808.22	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注1：本基金不收取固定管理费，以分档计提方式收取浮动管理费；

注2：本基金A类、E类基金份额年化管理费率上限为0.30%；

注3：当期运作期期满时，基金管理人以各类基金份额的“运作期年化收益率”为基础分别分三档收取管理费；对于每一类别基金份额，在分档模式下，基金管理人将“运作期年化收益率”由低到高分档并设定不同等级的管理费率；“运作期年化收益率”越大的档，管理费率越高；

注4：基金管理费以每个运作期最后一日各类基金份额的基金资产净值为基数，按相应类别基金份额“运作期年化收益率”对应档数的管理费率在运作期最后一日分别计提；其计算公式如下：
A类基金份额或E类基金份额当期运作应计提的管理费=当期运作期最后一日A类基金份额的基金资产净值或E类基金份额的基金资产净值×A类基金份额或E类基金份额根据合同约定适用的当期运作期管理费率×当期运作期合计日历日天数/365。管理费计提后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于运作期最后一个工作日后的5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

注5：本报告期计提的管理费，为本基金第二期运作期应计提的管理费。

注6：截止本期末（2016年12月31日），本基金第三期运作期未届满，尚未计提管理费。

注7：上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未产生应支付的管理费及应支付销售机构的客户维护费。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	645,491.01	-

注1：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05% / 当年天数。

注2：上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未产生应支付的托管费。

7.4.4.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实3个月理财债券 A	嘉实3个月理财债券E	合计
嘉实基金管理有限公司	-	129,098.20	129,098.20
中国银行	-	-	-
合计	-	129,098.20	129,098.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实3个月理财债券 A	嘉实3个月理财债券E	合计
嘉实基金管理有限公司	-	-	-
中国银行	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金A类基金份额的销售服务费年率为0.25%，E类基金份额的销售服务费年率为0.01%，每日计提，逐日累计至每月末，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。计算公式为：各类别基金日销售服务费=各类别基金份额前一日资产净值×各类别基金份额适用的销售服务费率/当年天数。

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

本期（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31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。

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

本报告期内（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31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。

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（2016年12月31日）及上年度末（2015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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	9,461,433.94	235,885.16	11,878.06	-

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（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015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（2016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**

本期末（2016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证券。

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购**

本期末（2016年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,135,461,433.94	99.88
4	其他各项资产	2,641,971.76	0.12

5	合计	2,138,103,405.70	100.00
---	----	------------------	--------

8.2 债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

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。

8.3.2 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	0.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	99.56	-
	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	100.00	-

8.4 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

8.6 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

报告期末，本基金未持有债券。

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-

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%。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	2,641,971.76

4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,641,971.76

§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

份额级别	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
嘉实3个月理财债券A	-	-	-	-	-	-
嘉实3个月理财债券E	361	5,915,408.56	2,127,910,000.00	99.65%	7,552,490.95	0.35%
合计	361	5,915,408.56	2,127,910,000.00	99.65%	7,552,490.95	0.35%

注：(1) 嘉实3个月理财债券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3个月理财债券A份额占嘉实3个月理财债券A总份额比例、个人投资者持有嘉实3个月理财债券A份额占嘉实3个月理财债券A总份额比例；

(2) 嘉实3个月理财债券E: 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3个月理财债券E份额占嘉实3个月理财债券E总份额比例、个人投资者持有嘉实3个月理财债券E份额占嘉实3个月理财债券E总份额比例。

9.2 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3个月理财债券A	-	-
	嘉实3个月理财债券E	5,258.00	0.00%
	合计	5,258.00	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	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 3 个月理财债券 A	0
	嘉实 3 个月理财债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实 3 个月理财债券 A	0
	嘉实 3 个月理财债券 E	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
基金合同生效日（2014 年 6 月 27 日）基金份额总额	214,778,381.84	10,472,971.40
本报告期期初基金份额总额	-	-
本报告期基金总申购份额	-	7,173,265,192.32
减:本报告期基金总赎回份额	-	5,037,802,701.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	-	2,135,462,490.95

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投份额。

§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**

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

2016年12月，郭德秋先生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

报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费5,000.00元，该审计机构第1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

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	5	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 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	-	-	-	-	-
华宝证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司							
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
新时代证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券有限公司	1	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-	新增3个

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：宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

注4：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注5：新时代证券有限责任公司更名为新时代证券股份有限公司。

注6：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注7：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

注8：中信证券（浙江）有限责任公司更名为中信证券股份有限公司。

注9：东吴证券有限责任公司更名为东吴证券股份有限公司。

注10：浙商证券有限责任公司更名为浙商证券股份有限公司。

注11：报告期内，本基金退租以下交易单元：华融证券股份有限公司退租上海交易单元1个。

11.8 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
2017年3月29日