

# 嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 月 29 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 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 债券回购融资情况.....	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
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.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	48
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
8.9 投资组合报告附注.....	48

<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>50</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4 基金投资策略的改变.....	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	53
11.9 其他重大事件.....	53
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	55

## § 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	4,043,333,260.16 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	29,393,761.13 份	4,013,939,499.03 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	根据各种宏观经济指标决定组合的平均剩余期限和比例分布；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。
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
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100005	100031
法定代表人	邓红国	周慕冰

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	
	嘉实理财宝 7 天 债券 A	嘉实理财宝 7 天 债券 B	嘉实理财宝 7 天 债券 A	嘉实理财宝 7 天 债券 B	嘉实理财宝 7 天 债券 A	嘉实理财宝 7 天 债券 B
本期已实现收益	754,422.54	3,720,760.33	3,147,815.59	40,033,596.07	5,222,030.20	117,478,903.45
本期利润	754,422.54	3,720,760.33	3,147,815.59	40,033,596.07	5,222,030.20	117,478,903.45
本期净值收益率	1.2582%	1.5536%	5.8663%	6.1694%	5.7071%	6.0147%
3.1.2 期末数 据和指	2016 年末		2015 年末		2014 年末	

标						
期末基金资产净值	29,393,761.13	4,013,939,499.03	139,925,052.09	11,049,498.78	56,391,657.44	2,352,239,029.12
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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	18.2918%	19.7905%	16.8220%	17.9580%	10.3486%	11.1037%

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
过去三个月	0.2727%	0.0061%	0.3403%	0.0000%	-0.0676%	0.0061%
过去六个月	0.5208%	0.0043%	0.6805%	0.0000%	-0.1597%	0.0043%
过去一年	1.2582%	0.0032%	1.3537%	0.0000%	-0.0955%	0.0032%
过去三年	13.3161%	0.0869%	4.0537%	0.0000%	9.2624%	0.0869%
自基金合同生效起至今	18.2918%	0.0723%	5.8660%	0.0000%	12.4258%	0.0723%

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
过去三个月	0.3461%	0.0061%	0.3403%	0.0000%	0.0058%	0.0061%
过去六个月	0.6679%	0.0043%	0.6805%	0.0000%	-0.0126%	0.0043%
过去一年	1.5536%	0.0032%	1.3537%	0.0000%	0.1999%	0.0032%

过去三年	14.3036%	0.0868%	4.0537%	0.0000%	10.2499%	0.0868%
自基金合同生效起至今	19.7905%	0.0722%	5.8660%	0.0000%	13.9245%	0.0722%

### 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

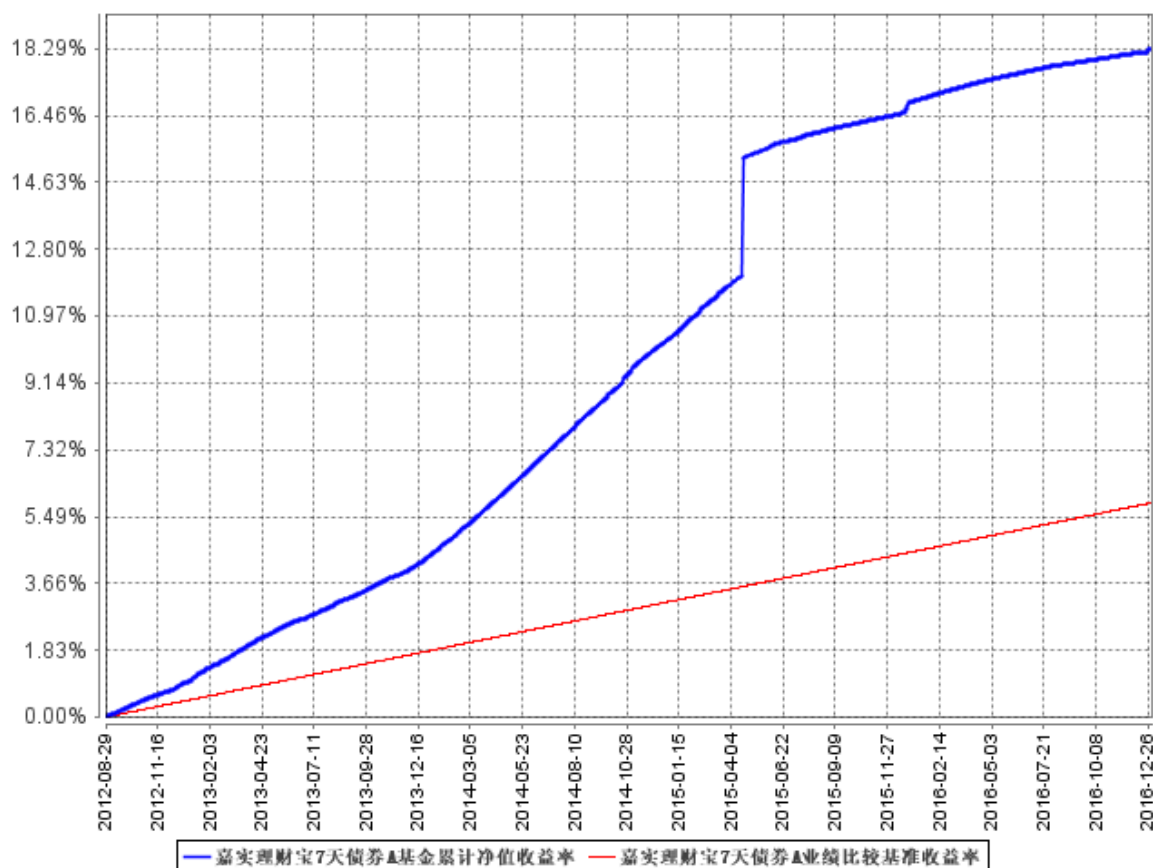


图1：嘉实理财宝7天债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年8月29日至2016年12月31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

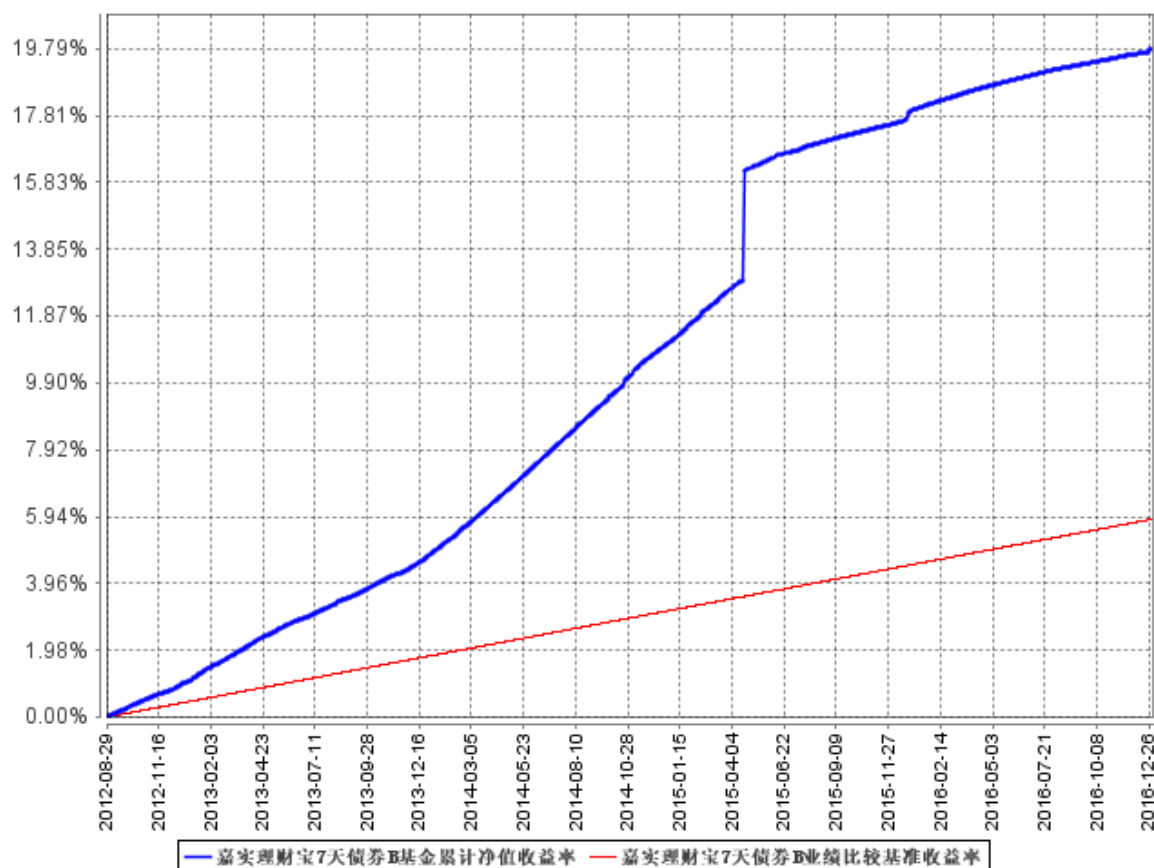


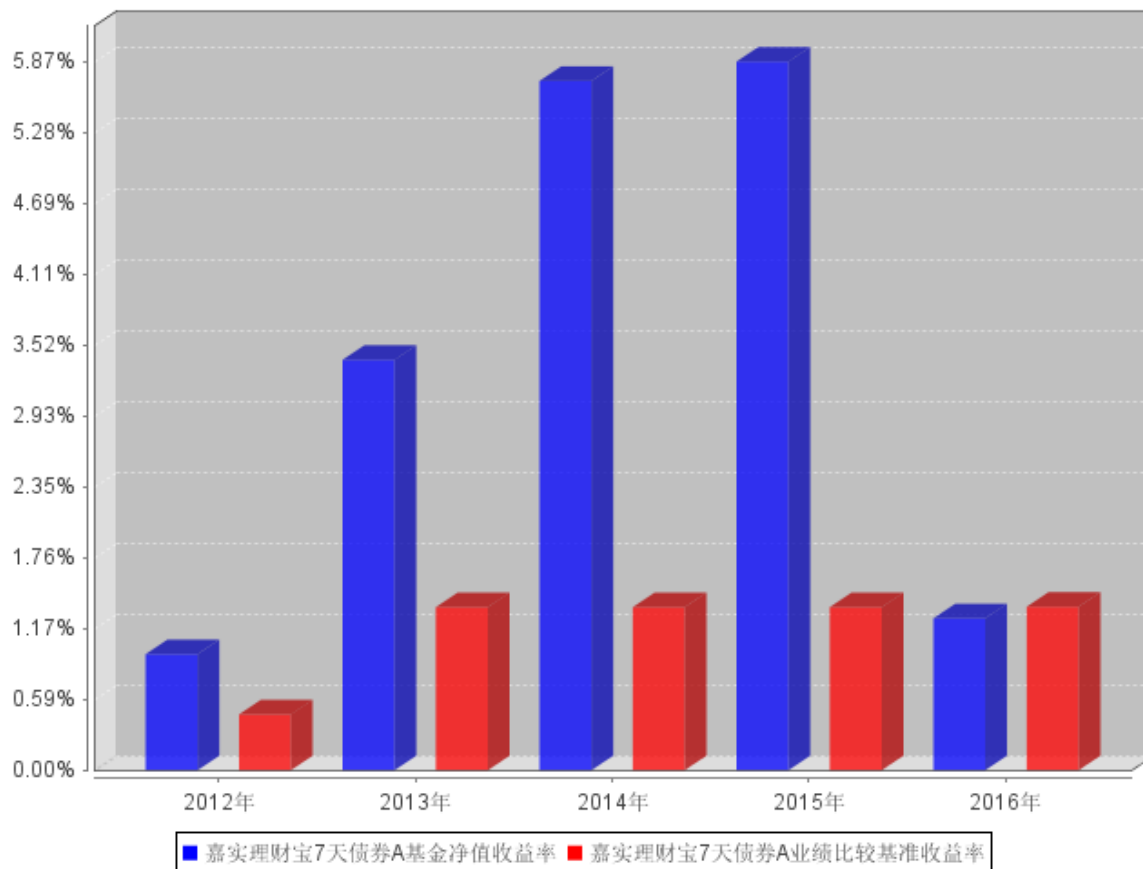
图2：嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2012年8月29日至2016年12月31日)

注1：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。

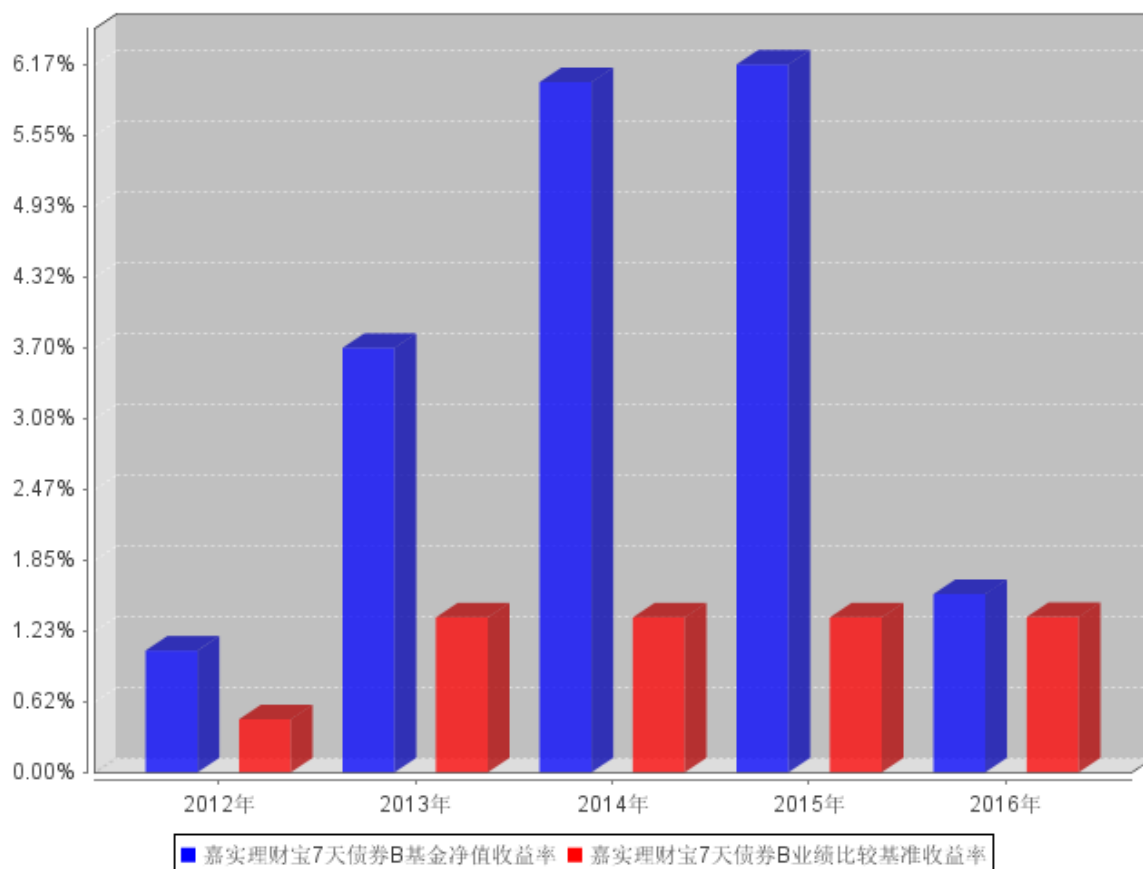
注2：2016年7月23日，本基金管理人发布《关于嘉实理财宝7天债券基金经理变更的公告》，魏莉女士不再担任本基金基金经理职务，增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务，与基金经理张文玥女士、李瞳先生共同管理本基金。

### 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

嘉实理财宝7天债券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



嘉实理财宝7天债券B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2012年8月29日，2012年度的相关数据根据当年实际存续期（2012年8月29日至2012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

嘉实理财宝7天债券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	764,734.27	65,905.94	-76,217.67	754,422.54	
2015	2,980,682.14	110,219.05	56,914.40	3,147,815.59	
2014	5,013,403.69	289,059.11	-80,432.60	5,222,030.20	
合计	8,758,820.10	465,184.10	-99,735.87	9,124,268.33	

单位：人民币元

嘉实理财宝7天债券B					
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	2,890,000.25	-	830,760.08	3,720,760.33	
2015	38,427,263.38	1,948,047.89	-341,715.20	40,033,596.07	
2014	117,010,905.36	219,299.47	248,698.62	117,478,903.45	
合计	158,328,168.99	2,167,347.36	737,743.50	161,233,259.85	

## § 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		
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、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券基金经理	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、嘉实现金宝货币基金经理	2015 年 5 月 14 日	-	7 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。
李金灿	本基金、嘉实宝 A/B、嘉实超短债债券、嘉实薪金宝货币、嘉实机构快线货币、嘉实安心货币、嘉实增益宝货币基金经理	2016 年 7 月 23 日	-	7 年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012 年 8 月加入嘉实基金管理有限公

					司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。
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	2016 年 7 月 23 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。

注：（1）任职日期、离任日期是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同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

联合国经济和社会事务部近期发布的《2017 年世界经济形势与展望》报告称，在刚刚过去的 2016 年，世界经济发展趋势可以用“五低二高”来概括，即：低经济增长、低国际贸易流量、低通货膨胀、低投资增长、低利率；高债务水平和高度依赖货币政策。报告指出，2016 年 2.2% 的世界经济增速是 2009 年以来最低的增速，全球贸易量在 2016 年只增长了 1.2%，处于历史较低水平，投资增长在许多主要发达国家和发展中国家都明显放缓。2016 年世界经济整体保持低速增长，而 2016 年全球局势风云变幻，黑天鹅事件层出不穷，如特朗普当选美国总统，英国脱欧，意大利公投失败等等，经济全球化进程面临挑战，地区局部持续动荡，国家间的竞争逐步升级，地缘政治格局也面临各种考验，世界经济在此多重复杂背景下艰难前行。

2016 年政府积极实施稳增长措施、继续推进深化改革和执行稳健的货币政策，国内经济整体趋稳，虽然个别指标出现好转，但是经济下行压力依然较大。初步核算，2016 年国内生产总值 744127 亿元，突破 70 万亿大关，同比增长 6.7%，低于去年的 6.9%。分季度看，一季度同比增长 6.7%，二季度增长 6.7%，三季度增长 6.7%，四季度增长 6.8%。具体来看，工业增加值稳中略降，

全年同比增速均值为 6.04%，低于去年同比增速均值 6.09%；“克强指数”全年均值为 6.63%，明显高于去年均值 1.06%；中国制造业采购经理指数(PMI)均值站到荣枯线以上，全年均值为 50.32%，高于去年均值 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，固定资产投资整体呈现稳中回落态势，全年累计同比增速均值为 8.26%，低于去年均值 10.42%，其中房地产开发投资整体向好，全年累计同比增速均值为 5.50%，高于去年均值 4.11%，基础设施投资维持平稳、略有回落，全年累计同比增速均值为 16.68%，低于去年均值 17.50%，民间固定资产投资则呈现大幅回落，全年累计同比增速为 3.36%，大幅低于去年均值 10.66%；社会消费品零售总额较为平稳，全年同比增速均值为 9.55%，接近于去年均值 9.77%；受贸易保护主义和国际市场需求疲软影响，出口形势整体低迷，出口金额全年同比增速均值分别为-7.58%，明显低于去年均值-1.19%。另外，全年价格水平整体出现上行，全国居民消费价格总水平同比增速均值为 2.01%，高于去年均值 1.44%；全年 PPI 同比增速为-1.31%，高于去年均值-5.22%。从金融数据来看，货币供应量整体依然处于高位，M2 全年同比增速均值为 12.04%，略低于去年均值 12.32%；社会融资规模继续上升，全年新增规模均值为 1.48 万亿元，高于去年均值 1.28 万亿元；新增人民币贷款继续上升，上半年新增均值为 1.05 万亿元，高于去年均值 0.98 万亿元。全年人民币汇率整体呈现走贬走势，CNY 全年累计贬值 7.02%，CNH 全年累计贬值 6.10%，全年央行外汇资产新增为-2.91 万亿元，较去年同期大幅减少近 7000 亿元，跨境资金流出规模继续增大。

为兼顾维稳人民币汇率、降低杠杆水平和应对经济下行风险，央行货币政策整体维持稳健，政策节奏呈现前松后紧，2016 年全年央行仅降准 1 次，央行主要通过公开市场操作、国库现金定存、MLF 和 PSL 等政策工具补充和调节市场流动性，全年公开市场操作累计净投放资金 17272 亿元，国库现金定存累计净回笼资金 300 亿元，MLF 累计净投放资金 27912 亿元，PSL 累计净投放资金 9714 亿元。银行间市场资金利率呈现前低后高，2016 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+3BP、+39BP、0BP 和+170BPBP；银行间市场国债收益率曲线也维持平稳，2016 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+35BP、+24BP、+15BP、+16BP 和+19BP，10 年期与 1 年期国债期限利差为 36BP，较去年末缩小 16BP。

在经济下行周期，2016 年信用风险继续暴露，违约范围和金额继续扩大。2016 年全年违约债券共 79 只，同比增长 243%，涉及违约主体 34 个；违约总金额高达 403 亿元，同比增长 220%。2016 年 2 至 5 月和 11 至 12 月是违约爆发高峰期，无论是数量还是规模均处于高位。从主体所属行业看，违约债券主要集中在建材、钢铁、机械设备等强周期产能过剩的行业，另外，商业贸易行业、航运物流行业由于毛利较低，盈利能力较弱，违约规模也较大。从企业类型看，2016 年涉及违约主体 34 家，其中地方国有企业 6 家，违约总额占比将近 40%，民营企业多达 22 家，违约总额占



比 37%。

2016 年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券和同业存单投资和同业存款，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 1.2582%，嘉实理财宝 7 天债券 B 的基金份额净值收益率为 1.5536%，同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

IMF 发布最新全球经济预期，预测 2017 年全球经济增速为 3.4%，2018 年为 3.6%。因预期特朗普实施扩张性财政政策，将 2017 年美国 GDP 增速预期从 2.2%上调至 2.3%，2018 年从 2.1%上调至 2.5%。上调 2017 年欧元区、日本和英国经济增速预估，因 2016 年下半年表现强于预期。2017 年韩国、意大利经济增速预估下调。下调拉丁美洲 2017 年经济增速预估至 1.2%，2018 年预估下调至 2.1%，因巴西经济持续疲软及墨西哥比索下跌；大幅下调印度 2016-2017 财年经济增速预估至 6.6%，因大额纸币作废计划冲击消费；2017-2018 财年预估下调至 7.2%。上调 2017 年中国经济增速预估至 6.5%，因政府持续出台刺激计划，2018 年预估维持在 6.0%不变。联合国经济和社会事务部发布的《2017 年世界经济形势与展望》报告预测，全球经济预计在 2017 年增长 2.7%，高于 2016 年的 2.2%。

2017 年全球经济增长形势依然不容乐观，继续面临许多重大挑战，如全球潜在增长率在下降，金融市场稳定性减弱，美国成为全球经济不稳定的重要原因，贸易投资增长疲软，反全球化趋势日益明显，同时，地缘政治风险、难民危机、大国政治周期、恐怖主义等问题也将进一步影响全球经济增长和稳定发展。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，但制造业投资、房地产投资和民间投资难改下行态势，受特朗普贸易政策影响，出口形势难言好转。

2017 年年初中国人民银行工作会议在北京召开，关于 2017 年的货币政策，会议提出“要保持货币政策稳健中性”。具体来看，“要综合运用多种货币政策工具，调节好流动性闸门，保持流动性基本稳定。”这一表述与之前召开的中央经济工作会议的精神是一致的。中央经济工作会

议提出：“货币政策要保持稳健中性，适应货币供应方式新变化，调节好货币闸门，努力畅通货币政策传导渠道和机制，维护流动性基本稳定。”预计 2017 年货币政策整体维持紧平衡，鉴于国内外经济状况复杂，人民币贬值压力依然较大，外汇占款仍然处于下行通道，市场资金缺口日益增大，央行货币政策倾向于降低杠杆水平、维护市场稳定和维稳汇率等，国内流动性将由略为宽松转为紧平衡，央行通过降准或其他政策工具对流动性的补充更多为对冲性投放，可能形成“降准+加息”的新政策组合工具。预计 2017 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：完成大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、

年度监察稽核报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 754,422.54 元，每日分配，到期支付，合计分配 754,422.54 元，B 类份额已实现收益为 3,720,760.33 元，每日分配，到期支付，合计分配 3,720,760.33 元，符合本基金基金合同的约定。

#### 4.9 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 12 月 31 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合规守信、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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20645 号

嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金(以下简称“嘉实理财宝 7 天债券基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实理财宝 7 天债券基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师

审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 审计意见

我们认为，上述嘉实理财宝 7 天债券基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实理财宝 7 天债券基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)

中国 · 上海市

注册会计师

许 康 玮

张 勇

2017 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 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
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,901,898,173.27	1,450,340.64
结算备付金		-	66,666.67
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,668,625,488.77	70,143,610.38
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		1,668,625,488.77	70,143,610.38
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	-	75,000,187.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	46,941,370.10	1,738,286.00
应收股利		-	-
应收申购款		129,990.00	32,900,032.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,617,595,022.14	181,299,123.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015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		572,498,741.25	-
应付证券清算款		-	30,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		466,716.05	18,934.66
应付托管费		142,750.51	5,610.27
应付销售服务费		25,236.68	18,681.10
应付交易费用	7.4.7.7	29,363.65	2,557.88
应交税费		-	-
应付利息		95,622.80	-
应付利润		844,431.04	89,888.63
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	158,900.00	188,900.00
负债合计		574,261,761.98	30,324,572.54
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	4,043,333,260.16	150,974,550.87
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,043,333,260.16	150,974,550.87
负债和所有者权益总计		4,617,595,022.14	181,299,123.41

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 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 29,393,761.13 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 4,013,939,499.03 份。嘉实理财宝 7 天债券基金份额总额合计为 4,043,333,260.16 份。

## 7.2 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
<b>一、收入</b>		7,168,445.80	48,760,820.54
1.利息收入		7,089,400.09	45,913,845.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,981,699.27	29,841,774.50
债券利息收入		2,415,916.68	14,556,802.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		691,784.14	1,515,268.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益		79,045.71	2,846,975.21
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	79,045.71	2,846,975.21
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		2,693,262.93	5,579,408.88
1. 管理人报酬		690,208.78	2,215,646.99
2. 托管费		208,970.62	656,487.97
3. 销售服务费		188,531.56	291,051.00
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		1,405,281.69	2,169,185.82
其中：卖出回购金融资产支出		1,405,281.69	2,169,185.82
6. 其他费用	7.4.7.15	200,270.28	247,037.10
<b>三、利润总额</b>		4,475,182.87	43,181,411.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		4,475,182.87	43,181,411.66

### 7.3 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）	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）	-	4,475,182.87	4,475,182.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,892,358,709.29	-	3,892,358,709.29
其中：1. 基金申购款	4,092,076,498.74	-	4,092,076,498.74
2. 基金赎回款	-199,717,789.45	-	-199,717,789.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-4,475,182.87	-4,475,182.87
五、期末所有者权益（基金净值）	4,043,333,260.16	-	4,043,333,260.16
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）	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）	-	43,181,411.66	43,181,411.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,257,656,135.69	-	-2,257,656,135.69
其中：1. 基金申购款	868,512,997.73	-	868,512,997.73
2. 基金赎回款	-3,126,169,133.42	-	-3,126,169,133.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-43,181,411.66	-43,181,411.66
五、期末所有者权益（基金净值）	150,974,550.87	-	150,974,550.87

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：

\_\_\_\_\_  
赵学军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王红

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
常旭

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实理财宝 7 天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]1047 号《关于核准嘉实理财宝 7 天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《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 9,527,600,820.82 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(2012)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,528,525,870.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 925,049.80 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》和《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据销售服务费费率的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,按 0.3%的费率收取销售服务费的基金份额为 A 类基金份额,按 0.01%的费率收取销售服务费的基金份额为 B 类基金份额。不同基金份额分别设置代码,并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。基金管理人在开放日办理基金份额的申购,在基金份额“7 天持有周期到期日”办理相应基金份额的赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资于法律法规允许的金融工具组合比例范围包括:现金,银行协议存款,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券、超短期融资券,及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。

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。

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。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。

#### 7.4.4.4 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。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。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(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。

#### 7.4.4.6 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 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。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及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；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。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；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,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;若投资人在基金份额“7 天持有周期到期日”累计收益支付时,其累计收益为正值,则为投资人增加相应的基金份额,其累计收益为负值,则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时,其对应收益将立即结清;若收益为负值,则从投资人赎回基金款中扣除;当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据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,基金计算影子价格过程中确定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) 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。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。

(2) 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),按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	1,898,173.27	1,450,340.64
定期存款	2,900,000,000.00	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
存款期限1个月以内	1,600,000,000.00	-
存款期限3个月及以上	1,300,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	2,901,898,173.27	1,450,340.64

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,668,625,488.77	1,670,204,000.00	1,578,511.23	0.0390%
	合计	1,668,625,488.77	1,670,204,000.00	1,578,511.23	0.0390%
项目		上年度末 2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	70,143,610.38	70,215,000.00	71,389.62	0.0473%
	合计	70,143,610.38	70,215,000.00	71,389.62	0.0473%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本，偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产款	45,000,187.50	-
交易所市场买入返售金融资产款	30,000,000.00	-
合计	75,000,187.50	-

注：本期末（2016年12月31日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金无买断式逆回购交易中

取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	341.56	1,916.77
应收定期存款利息	3,451,666.86	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	30.00
应收债券利息	43,489,361.68	1,733,407.11
应收买入返售证券利息	-	2,932.12
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	46,941,370.10	1,738,286.00

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	29,363.65	2,557.88
合计	29,363.65	2,557.88

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	158,900.00	188,900.00
应付指数使用费	-	-
其他	-	-
合计	158,900.00	188,900.00



## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	139,925,052.09	139,925,052.09
本期申购	89,186,498.49	89,186,498.49
本期赎回	-199,717,789.45	-199,717,789.45
本期末	29,393,761.13	29,393,761.13

金额单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	11,049,498.78	11,049,498.78
本期申购	4,002,890,000.25	4,002,890,000.25
本期赎回	-	-
本期末	4,013,939,499.03	4,013,939,499.03

注：申购份额含红利再投。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	754,422.54	-	754,422.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-754,422.54	-	-754,422.54
本期末	-	-	-

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,720,760.33	-	3,720,760.33
本期基金份额交易	-	-	-

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,720,760.33	-	-3,720,760.33
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	49,363.31	107,719.18
定期存款利息收入	3,931,666.86	29,728,500.05
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	669.10	5,555.27
其他	-	-
合计	3,981,699.27	29,841,774.50

#### 7.4.7.12 债券投资收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	803,284,564.31	1,966,108,031.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	781,366,261.72	1,920,364,993.04
减：应收利息总额	21,839,256.88	42,896,062.97
买卖债券差价收入	79,045.71	2,846,975.21

#### 7.4.7.13 其他收入

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），本基金无其他收入。

#### 7.4.7.14 交易费用

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），本基金无交易费用。

### 7.4.7.15 其他费用

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
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	99,900.00	99,900.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行划款手续费	12,330.28	28,567.10
指数使用费	-	-
上市年费	-	-
红利手续费	-	-
其他	2,040.00	2,570.00
合计	200,270.28	247,037.10

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

### 7.4.9 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
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

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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 12 月 31 日	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	690,208.78	2,215,646.99
其中：支付销售机构的客户维护费	48,290.76	68,974.42

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。

###### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	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	208,970.62	656,487.97

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。

###### 7.4.10.2.3 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	8,334.48	19,406.50	27,740.98
中国农业银行	33,003.45	-	33,003.45
合计	41,337.93	19,406.50	60,744.43
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	17,736.46	73,559.24	91,295.70
中国农业银行	47,912.31	126.64	48,038.95
合计	65,648.77	73,685.88	139,334.65

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。

#### 7.4.10.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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
中国农业银行	-	-	-	-	11,270,000.00	758.61
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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
中国农业银行	-	-	22,000,000.00	24,655.77	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

##### 7.4.10.4.2 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(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。

#### 7.4.10.5 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		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
中国农业银行	1,898,173.27	49,363.31	1,450,340.64	107,719.18

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(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。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位:人民币元

##### 嘉实理财宝7天债券A

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	本期利润分配合计	备注
764,734.27	65,905.94	-76,217.67	754,422.54	-

##### 嘉实理财宝7天债券B

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	本期利润分配合计	备注
2,890,000.25	-	830,760.08	3,720,760.33	-

#### 7.4.12 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

## 7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 572, 498, 741.25 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
1282044	12 中南方 MTN1	2017 年 1 月 3 日	100.69	68,000	6,846,845.86
1211001	12 招行 01	2017 年 1 月 3 日	100.54	500,000	50,270,739.58
1208001	12 民生 01	2017 年 1 月 3 日	100.48	500,000	50,239,604.08
1218001	12 光大 01	2017 年 1 月 3 日	100.54	900,000	90,490,172.58
1209001	12 浦发 01	2017 年 1 月 3 日	100.51	1,000,000	100,514,581.96
1082015	10 中油股 MTN1	2017 年 1 月 3 日	100.52	1,900,000	190,984,178.37
150408	15 农发 08	2017 年 1 月 3 日	100.37	300,000	30,112,466.45
160201	16 国开 01	2017 年 1 月 3 日	99.99	800,000	79,992,950.21
合计				5,968,000	599,451,539.09

### 7.4.12.2.2 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。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。本基金投资于各类货币市场工具, 属于高流动性、低风险的品种, 其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。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。

#### **7.4.13.2 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年度末：无)。

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。



**7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	99,948,661.67	-
合计	99,948,661.67	-

注：（1）上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有短期信用评级的债券投资。

（2）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。

**7.4.13.2.2 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	1,358,527,163.81	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,358,527,163.81	-

注：（1）上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有长期信用评级的债券投资。

（2）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。

**7.4.13.3 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日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日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主要通过限制、跟踪和控制基金投资

交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天,且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还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。

于本报告期末,除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(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,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控,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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	2,901,898,173.27	-	-	-	2,901,898,173.27
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,668,625,488.77	-	-	-	1,668,625,488.77
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	-	-	-	46,941,370.10	46,941,370.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	129,990.00	129,990.00

递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	4,570,523,662.04			47,071,360.10	4,617,595,022.14
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	572,498,741.25				572,498,741.25
应付证券清算款					
应付赎回款					
应付管理人报酬				466,716.05	466,716.05
应付托管费				142,750.51	142,750.51
应付销售服务费				25,236.68	25,236.68
应付交易费用				29,363.65	29,363.65
应交税费					
应付利息				95,622.80	95,622.80
应付利润				844,431.04	844,431.04
递延所得税负债					
其他负债				158,900.00	158,900.00
负债总计	572,498,741.25			1,763,020.73	574,261,761.98
利率敏感度缺口	3,998,024,920.79			-45,308,339.37	4,043,333,260.16
上年度末 2015年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,450,340.64				1,450,340.64
结算备付金	66,666.67				66,666.67
存出保证金					
交易性金融资产	70,143,610.38				70,143,610.38
衍生金融资产					
买入返售金融资产	75,000,187.50				75,000,187.50
应收证券清算款					
应收利息				1,738,286.00	1,738,286.00
应收股利					
应收申购款				32,900,032.22	32,900,032.22
递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	146,660,805.19			34,638,318.22	181,299,123.41
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					
应付证券清算款				30,000,000.00	30,000,000.00

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	18,934.66	18,934.66
应付托管费	-	-	-	5,610.27	5,610.27
应付销售服务费	-	-	-	18,681.10	18,681.10
应付交易费用	-	-	-	2,557.88	2,557.88
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	89,888.63	89,888.63
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	188,900.00	188,900.00
负债总计	-	-	-	30,324,572.54	30,324,572.54
利率敏感度缺口	146,660,805.19	-	-	4,313,745.68	150,974,550.87

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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二层次的余额为 1,668,625,488.77 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：第二层次 70,143,610.38 元，无属于第一、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 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。

(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。

## § 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	1,668,625,488.77	36.14
	其中：债券	1,668,625,488.77	36.14
	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	2,901,898,173.27	62.84
4	其他各项资产	47,071,360.10	1.02

5	合计	4,617,595,022.14	100.00
---	----	------------------	--------

## 8.2 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	4.31	
	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	572,498,741.25	14.16
	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) 本基金基金合同第十二部分约定：本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。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 40%。

## 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
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。

### 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	44.07	14.16
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	9.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	24.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	17.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天(含)—397 天(含)	17.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		113.04	14.16

#### 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

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	843,643,107.50	20.87
	其中：政策性金融债	210,149,663.29	5.20
4	企业债券	100,683,583.31	2.49
5	企业短期融资券	99,948,661.67	2.47
6	中期票据	624,350,136.29	15.44
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,668,625,488.77	41.27
10	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。

#### 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

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	1282135	12 神华 MTN1	1,900,000	191,649,997.68	4.74
2	1220006	12 杭州银行债	1,900,000	191,194,105.74	4.73
3	1218001	12 光大 01	1,900,000	191,034,808.78	4.72
4	1082015	10 中油股 MTN1	1,900,000	190,984,178.37	4.72
5	1282105	12 穗地铁 MTN1	1,100,000	110,859,738.58	2.74
6	1282044	12 中南方	1,000,000	100,688,909.69	2.49

		MTN1			
7	078007	07 中建材 债	1,000,000	100,683,583.31	2.49
8	1209001	12 浦发 01	1,000,000	100,514,581.96	2.49
9	1208001	12 民生 01	1,000,000	100,479,208.15	2.49
10	100201	10 国开 01	1,000,000	100,044,246.63	2.47

## 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	0.0604%
报告期内偏离度的最低值	-0.1239%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0209%

### 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。

## 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	46,941,370.10
4	应收申购款	129,990.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	47,071,360.10

## § 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
嘉实理财宝 7 天债券 A	3,548	8,284.60	558,835.89	1.90%	28,834,925.24	98.10%
嘉实理财宝 7 天债券 B	2	2,006,969,749.52	4,002,716,110.19	99.72%	11,223,388.84	0.28%
合计	3,550	1,138,967.12	4,003,274,946.08	99.01%	40,058,314.08	0.99%

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。

## 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	嘉实理财宝 7 天债券 A	703.95	0.00%
	嘉实理财宝 7 天债券 B	-	-
	合计	703.95	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

## § 10 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	89,186,498.49	4,002,890,000.25
减：本报告期基金总赎回份额	199,717,789.45	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,393,761.13	4,013,939,499.03

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，总赎回份额含基金份额自动升降级调减份额。

## § 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 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, 增聘李金灿先生担任本基金基金经理, 与现任基金经理张文玥女士、李瞳先生共同管理本基金。

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。

### 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 50,000.00 元, 该审计机构已连续 5 年为本基金提供审计服务。

### 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

#### 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	

中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份 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	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份 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。

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。国

都证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

### 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	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	23,000,000.00	100.00%

### 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%。

### 11.9 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	嘉实基金管理有限公司关于嘉实理财宝 7 天债券 2016 年春节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 2 月 1 日
2	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司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	2016 年 3 月 18 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司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	2016 年 4 月 8 日
4	关于增加上海陆金所资产管理有限公司为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 28 日
5	关于嘉实理财宝 7 天债券基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 7 月 23 日
6	关于增加“万得投顾”为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 8 月 5 日

7	嘉实基金管理有限公司关于对中国银行借记卡持卡人调整基金直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 1 日
8	关于增加盈米财富为嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 5 日
9	嘉实基金管理有限公司关于嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 1 日
10	关于增加北京汇成基金销售有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 9 日
11	关于增加东海期货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	2016 年 12 月 28 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财宝 7 天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) 报告期内嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 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

### 12.3 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E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2017年3月29日