

嘉实超短债证券投资基金 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。本半年度报告已经由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 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	嘉实超短债证券投资基金
基金简称	嘉实超短债债券
基金主代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 26 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	488,262,392.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳妥，保持资产较高的流动性，降低基金净值波动风险，取得超过比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面，将基金的大部分资产投资于货币市场工具，保持基金资产的高流动性，同时提供稳定的收益；另一方面，通过价值挖掘，将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具，为基金资产提供超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率
风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金，低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	http://www.jsfund.cn
--------------------	---

网址	
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

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)
本期已实现收益	-8,570,726.79
本期利润	6,170,656.22
加权平均基金份额本期利润	0.0109
本期加权平均净值利润率	1.06%
本期基金份额净值增长率	1.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,471,383.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0071
期末基金资产净值	505,425,877.97
期末基金份额净值	1.0352
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.09%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.02%	0.12%	0.00%	0.14%	0.02%
过去三个月	0.41%	0.02%	0.37%	0.00%	0.04%	0.02%
过去六个月	1.07%	0.03%	0.75%	0.00%	0.32%	0.03%
过去一年	2.28%	0.07%	1.62%	0.00%	0.66%	0.07%
过去三年	14.17%	0.06%	7.52%	0.01%	6.65%	0.05%
自基金合同	41.09%	0.04%	31.51%	0.01%	9.58%	0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实超短债债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

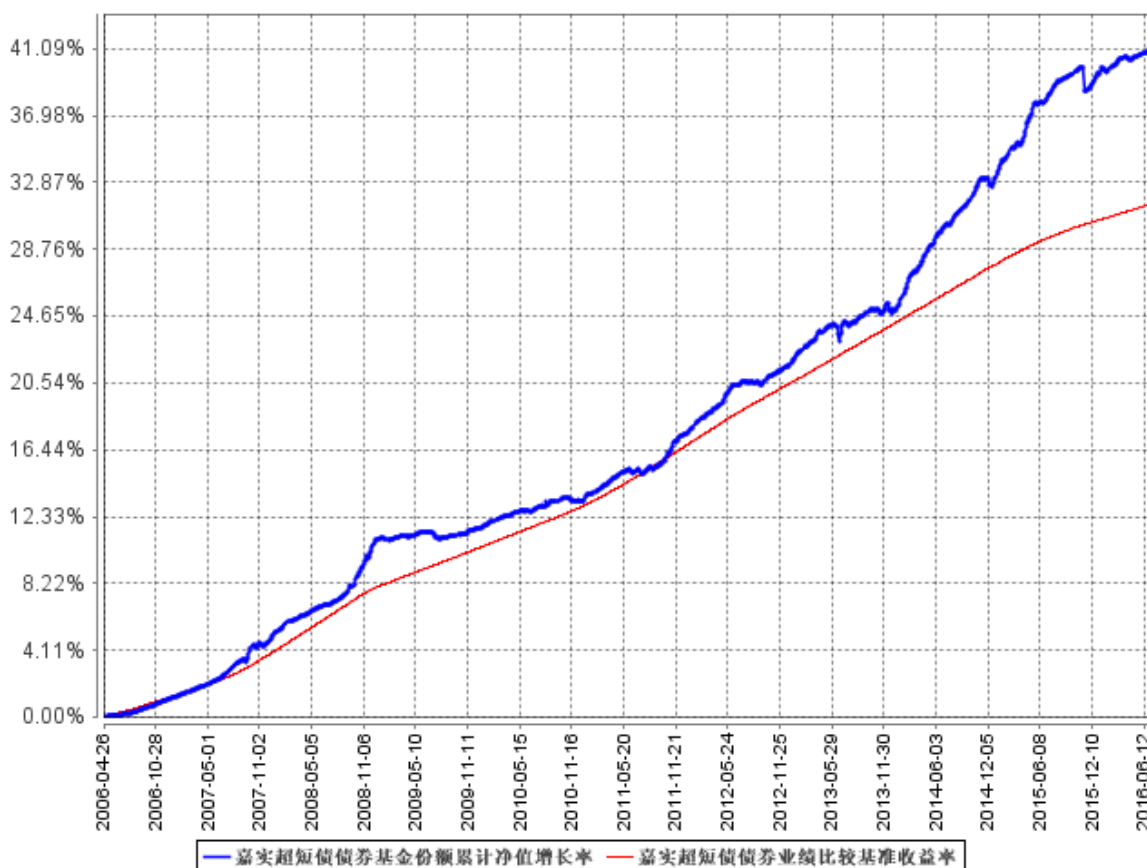


图:嘉实超短债债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2016年6月30日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定:(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年;(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%,投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

§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 1 个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2009 年 1 月 16 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。
李金灿	本基金基金经理、嘉实宝、嘉实机构快线货币、嘉实薪金宝货币、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实安心货币基金经理	2015 年 6 月 9 日	-	6 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担任债券交易员。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。

注：（1）任职日期、离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遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实超短债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

2016 年上半年，央行政策指导下的宽松资金面使得货币市场收益率保持低位运行。上半年宏观经济数据显示整体经济仍处低位、政府稳增长压力较大，供给侧改革和去产能过程仍面临较多困难，通胀有一定的隐忧。国际形势动荡，外汇占款仍流出但幅度放缓，5 月英国公投退出欧盟更引发国际市场剧烈动荡，市场对未来汇率波动的担忧未消除。上半年央行维持货币政策放松操作，再次降低存款准备金率 50bps，公开市场货币净投放 9500 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。同时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。央行的量价配合操作取得了明显效果，上半年市场流动性充裕，虽曾有短暂波动，但春节前后、季末、年度缴税期、半年末等关键时点市场都相对平稳度过。上半年银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 2.03%和 2.46%，较 15 年 4 季度均值 1.85%和 2.41%略有上行。

债券市场方面，中长端利率在投资者态度多空分歧下呈现较大波动。1 季度银行信贷和固定资产投资新开工项目均大幅增长，市场憧憬刺激政策效果，对债市更为谨慎；但以银行理财为主的配置资金对债券仍有大量需求；投资者多空态度分歧下收益率曲线长端略微上行。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；但是当季

信贷和固定资产投资数据增长放缓，民间投资大幅下滑，市场对刺激政策效果再次存疑，对债市再次偏向乐观，以银行理财为主的配置资金对债券仍有大量需求，收益转为下行。上半年债券市场利率整体小幅上行，同时短端利率跟随季末资金利率上行幅度较大，期限利差缩小。半年末 1 年期和 10 年期国开金融债收益率分别收于 2.60% 和 3.19%，较年初 2.40% 和 3.13% 平坦化小幅上行。信用产品方面，在资金宽松和配置压力推动下，1 季度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。但 2 季度因多起信用债违约事件发生，信用债抛压加大，多支新发短融因认购不足被迫取消发行，虽然后期在资金宽松和配置压力推动下，市场有所恢复，但信用利差仍然较 1 季度扩宽。上半年 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率先由年初的 2.87% 降至 1 季末的 2.75% 后又上行至半年末的 2.96%，而同期中等级别的 AA+ 级短融收益率则先由年初的 3.20% 降至 1 季末的 2.95% 后又上行至半年末的 3.29%。中票和企业债收益率上半年跟随中长期基准利率下行，不同信用等级券种之间的息差接近历史低位。但不同行业的债券仍表现分化。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低券种，这类券种收益率下行幅度有限，甚至有所上行。

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；合理配置债券仓位，前期适当降低组合久期，通过短期投资过渡，后期则相对乐观通增加久期。在实现组合较高静态收益的同时，市场收益率下行也为组合带来部分资本利得收益。整体看，2016 年上半年本基金成功应对了市场和规模波动，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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0352 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.07%，业绩比较基准收益率为 0.75%。

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 2016 年下半年，宏观经济、货币政策和短期资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看，全球主要经济体的经济形势和政策将继续分化。英国公投脱欧不仅对国际金融市场带来短期剧烈波动，还对全球经济增长格局带来长期深远影响，预期主要货币汇率需要一段时间达成再平衡；美国经济持续复苏，年内加息预期减弱；欧洲和日本在量化宽松政策的支持下经济缓步

企稳，但新兴经济体将面临汇率贬值、资金外逃和经济萧条等多重挑战，国际资本流动不确定性增加，由此带来的影响将错综复杂。国内经济增长的结构性矛盾更加凸显，改革攻坚难度增加，需要警惕经济增速下台阶对就业和消费等带来的负面影响；供给侧改革推进过程中，去过剩产能的压力巨大；但受基数和天气原因等影响，预期通胀有上行隐忧。综合当前国内外整体经济和货币环境，预计下半年央行将持续稳健偏宽松的货币政策，以支持稳定的经济增长，存在继续降息和降准的概率，但会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性，运用各类创新工具进行预调微调，根据经济情况调整。央行公开市场操作、回购利率和各种定向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。下半年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。

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

(1) 本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实超短债证券投资基金 2015 年第十一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.0650 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

(2) 报告期内本基金未实施利润分配。

(3) 报告期内，每个月末本基金每份基金份额可分配收益均未超过 0.001 元，根据基金合同（十八（二）收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实超短债证券投资基金（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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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	330,376,227.62	77,184,469.14
结算备付金		-	8,303,096.81
存出保证金		26,526.44	279.26
交易性金融资产	6.4.7.2	284,178,000.00	904,944,900.00
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		275,178,000.00	895,944,900.00
资产支持证券投资		9,000,000.00	9,000,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,443,173.86	17,891,453.65
应收股利		-	-
应收申购款		12,914,379.82	10,973,272.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	20,920,800.00	-
资产总计		653,859,107.74	1,019,297,471.17
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		147,399,317.70	287,918,966.12
应付证券清算款		-	13,265.36
应付赎回款		268,024.41	5,059,112.84
应付管理人报酬		164,419.12	267,470.28
应付托管费		56,143.12	91,331.32
应付销售服务费		100,255.55	163,091.65
应付交易费用	6.4.7.7	23,544.71	39,026.25
应交税费		-	-
应付利息		22,838.05	48,752.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	398,687.11	539,378.63
负债合计		148,433,229.77	294,140,395.07
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	488,262,392.62	703,570,070.09
未分配利润	6.4.7.10	17,163,485.35	21,587,006.01
所有者权益合计		505,425,877.97	725,157,076.10

负债和所有者权益总计		653,859,107.74	1,019,297,471.17
------------	--	----------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0352 元，基金份额总额 488,262,392.62 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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		10,972,059.16	33,781,032.56
1.利息收入		15,179,743.79	27,501,020.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,367,316.33	1,376,388.38
债券利息收入		11,583,304.75	25,822,429.70
资产支持证券利息收入		229,122.71	261,830.14
买入返售金融资产收入		-	40,372.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-19,220,355.64	2,480,065.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-19,220,355.64	2,480,065.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	14,741,383.01	3,749,946.44
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	271,288.00	50,000.00
减：二、费用		4,801,402.94	8,042,748.43
1. 管理人报酬		1,195,054.36	1,552,136.87
2. 托管费		408,067.36	529,997.94
3. 销售服务费		728,691.70	946,424.92
4. 交易费用	6.4.7.18	11,555.45	9,856.77
5. 利息支出		2,266,782.26	4,813,223.65
其中：卖出回购金融资产支出		2,266,782.26	4,813,223.65
6. 其他费用	6.4.7.19	191,251.81	191,108.28
三、利润总额		6,170,656.22	25,738,284.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润		6,170,656.22	25,738,284.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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)	703,570,070.09	21,587,006.01	725,157,076.10
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	6,170,656.22	6,170,656.22
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-215,307,677.47	-6,023,132.58	-221,330,810.05
其中：1.基金申购款	741,313,179.78	22,846,517.22	764,159,697.00
2.基金赎回款	-956,620,857.25	-28,869,649.80	-985,490,507.05
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动	-	-4,571,044.30	-4,571,044.30
五、期末所有者权益 (基金净值)	488,262,392.62	17,163,485.35	505,425,877.97
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)	938,263,615.86	24,833,089.41	963,096,705.27
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	25,738,284.13	25,738,284.13
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-337,407,299.69	-10,715,262.86	-348,122,562.55
其中：1.基金申购款	2,091,527,297.26	74,532,778.77	2,166,060,076.03
2.基金赎回款	-2,428,934,596.95	-85,248,041.63	-2,514,182,638.58
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动	-	-18,193,289.19	-18,193,289.19
五、期末所有者权益 (基金净值)	600,856,316.17	21,662,821.49	622,519,137.66

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：

<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

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,195,054.36	1,552,136.87
其中：支付销售机构的	219,918.85	347,090.25

客户维护费		
-------	--	--

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 0.41% 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 × 0.41% / 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	408,067.36	529,997.94

注：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 0.14% 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 × 0.14% / 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
嘉实基金管理有限公司	59,788.32
中国银行	63,092.33
合计	122,880.65
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	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
嘉实基金管理有限公司	60,592.45
中国银行	103,023.46
合计	163,615.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 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。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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
中国银行	-	-	-	-	823,290,000.00	68,126.41

上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	382,200,000.00	33,720.41

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
	中国银行	10,376,227.62	24,067.29	5,627,442.22

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。

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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 147,399,317.70 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
011699787	16 大唐集 SCP005	2016 年 7 月 5 日	100.03	100,000	10,003,000.00
011699649	16 华能 SCP005	2016 年 7 月 5 日	99.95	200,000	19,990,000.00
011699955	16 宁沪高 SCP005	2016 年 7 月 5 日	100.01	200,000	20,002,000.00
101651005	16 中石油 MTN001	2016 年 7 月 5 日	100.22	200,000	20,044,000.00
110412	11 农发 12	2016 年 7 月 1 日	100.05	100,000	10,005,000.00
160211	16 国开 11	2016 年 7 月 1 日	99.98	500,000	49,990,000.00
011517018	15 华电 SCP018	2016 年 7 月 7 日	100.41	200,000	20,082,000.00
合计				1,500,000	150,116,000.00

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	284,178,000.00	43.46
	其中：债券	275,178,000.00	42.09
	资产支持证券	9,000,000.00	1.38
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	330,376,227.62	50.53
7	其他各项资产	39,304,880.12	6.01
	合计	653,859,107.74	100.00

7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,881,000.00	29.65
	其中：政策性金融债	149,881,000.00	29.65
4	企业债券	5,173,000.00	1.02
5	企业短期融资券	100,080,000.00	19.80
6	中期票据	20,044,000.00	3.97
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	0.00	0.00
	合计	275,178,000.00	54.44

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	160211	16 国开 11	500,000	49,990,000.00	9.89
2	160206	16 国开 06	500,000	49,940,000.00	9.88
3	110412	11 农发 12	300,000	30,015,000.00	5.94
4	011517018	15 华电 SCP018	200,000	20,082,000.00	3.97
5	101651005	16 中石油 MTN001	200,000	20,044,000.00	3.97

7.4 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	119238	南方 A2	60,000	6,000,000.00	1.19
2	119237	南方 A1	30,000	3,000,000.00	0.59

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只资产支持证券。

7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

(1) 本基金的基金份额净值的计算,精确到 0.0001 元,小数点第五位四舍五入。

(2) 基金估值：在证券交易所市场，实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下按成本估值；在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

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	26,526.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,443,173.86
5	应收申购款	12,914,379.82
6	其他应收款	20,920,800.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	39,304,880.12

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
16,743	29,162.18	154,559,157.08	31.65%	333,703,235.54	68.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	72,355.77	0.01%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年4月26日）基金份额总额	6,146,255,272.70
本报告期期初基金份额总额	703,570,070.09
本报告期基金总申购份额	741,313,179.78
减：本报告期基金总赎回份额	956,620,857.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	488,262,392.62

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

§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

本报告期内，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	
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增

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

注 2：交易单元的选择标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中国中投证券有限责任公司	42,464,268.49	80.54%	3,453,000,000.00	77.39%
华泰证券股份有限公司	10,261,575.35	19.46%	1,008,587,000.00	22.61%

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-

600-8800, 或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日