

嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
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2015年10月23日复核了本报告中的财务数据、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	嘉实丰益纯债定期债券
基金主代码	000116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月21日
报告期末基金份额总额	69,103,115.66份
投资目标	本基金在审慎的资产配置和风险管理下,力争当期回报最大化,以谋求长期增值。
投资策略	本基金通过密切关注经济运行趋势,深入分析货币政策对经济运行的影响,结合各大类资产的预期收益率、波动性和流动性,综合运用久期策略、利率策略、信用策略、资产配置策略、资产组合优化策略和调整、在规范基金运作的前提下,进一步优化资产配置和调整,在规范基金运作的前提下,进一步规范资产组合的收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和净值表现

3.1 主要财务指标		单位:人民币元			
主要财务指标		报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)			
1.本期实现收益		2,766,913.69			
2.本期利润		2,867,573.41			
3.期初至报告期期末的利润		0.0206			
4.期末基金资产净值		90,339,029.62			
5.期末基金份额净值		1.002			

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) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

主要财务指标	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	准收益率	准收益率	差(%)	① - ③	② - ④
1.本期	2.867,573.41	2.766,913.69	0.0206	0.0206	1.002	1.002	0.000	0.000	0.000

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



图1:嘉实丰益纯债定期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

(2013年5月21日至2015年9月30日)

注:按基金合同和招募说明的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓结束后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 基金经理(或基金经理助理)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限
曲扬	本基金、嘉实债券、嘉实回报、嘉实稳健、嘉实增长、嘉实货币、嘉实定期开放债券、嘉实信用债、嘉实纯债、嘉实债券型基金、嘉实债券型基金(LOF)、嘉实债券型基金(ETF)、嘉实债券型基金(ETP)基金经理	2013年5月21日	11年

注: (1) 任职日期是指本基金合同生效之日起;(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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益纯债定期开放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基金,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规定的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公平交易制度的执行情况

4.3.67 公平交易制度的执行情况

4.3.68 公平交易制度的执行情况

4.3.69 公平交易制度的执行情况

4.3.70 公平交易制度的执行情况

4.3.71 公平交易制度的执行情况

4.3.72 公平交易制度的执行情况

4.3.73 公平交易制度的执行情况

4.3.74 公平交易制度的执行情况

4.3.75 公平交易制度的执行情况

4.3.76 公平交易制度的执行情况

4.3.77 公平交易制度的执行情况

4.3.78 公平交易制度的执行情况

4.3.79 公平交易制度的执行情况