

## 嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告书出具日期:2015年7月18日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员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。  
基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,于2015年7月15日核对了本报告中的财务指标、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。  
本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		20,646,083.32	1.58
B 矿采业		10,087,815.56	0.77
C 制造业		—	—
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		—	—
E 建筑业		—	—
F 批发和零售业		—	—
G 交通运输、仓储和邮政业		22,127,716.56	1.69
H 住宿和餐饮业		—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业		16,794,792.00	1.28
J 金融业		19,722,043.46	1.51
K 房地产业		—	—
L 租赁和商务服务业		—	—
M 科学研究和技术服务业		—	—
N 水利、环境和公共设施管理业		—	—
O 居民服务、修理和其他服务业		—	—
P 教育		—	—
Q 卫生和计划生育		—	—
R 文化、体育和娱乐业		—	—
S 综合		—	—
合计		89,378,369.00	6.82

本基金为定期开放型债券基金,其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,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:中国工商银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期已实现收益 76,027,304.67

2.本期利润 72,740,456.03

3.加权平均基金份额本期利润 0.0530

4.期末基金资产净值 1,310,062,826.43

5.期末基金份额净值 1.0366

注:(1)本期已实现收益指基金本期收入、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)上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用、认购费用和赎回费用将对实际收益产生影响。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率标准差

过去二个月 4.79% 0.24% 1.01% 0.03% 3.00% 0.32%

## § 3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

图:嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金成立以来基金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6月1日至2015年6月30日)

注:投资基金合同和招募说明书的约定,本基金合同生效日起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"第二部分(二)投资范围和(四)投资限制"的有关规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
刘宇	基金经理	2013年3月8日 -	11年	本基金,嘉实如意债券型证券投资基金,嘉实信用增利债券型证券投资基金,嘉实基金管理有限公司基金经理

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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》的规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规的说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,嘉实信用增利定期开放债券型证券投资基金符合基金合同及其相关法律规定的制度,基金管理人诚信履行受托责任和勤勉尽责地管理基金资产,基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.3.2 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.3.3 强制性止损制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.4 报告期内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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5 管理人公平交易专项报告

4.5.1 管理人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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.2 强制性止损制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.3 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.4 强制性止损制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.5 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.6 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.7 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.8 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.9 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.10 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.11 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.12 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.13 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.14 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.15 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.16 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.17 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.18 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.19 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.20 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.21 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.22 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.23 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.24 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.25 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.26 强制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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策时能公平对待各投资组合,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面均能公平对待各投资组合,不存在利益输送和利益分配不公的情况。

4.5.27 强制公平交易制度的执行情况