

嘉实增强收益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:招商银行股份有限公司

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对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理人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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时，应向投资人说明基金的性质、风险收益特征的原则和运用基金资产，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。投资人有风险，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。

本报告期的财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实增强收益定期开放债券
基金代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月24日
报告期末基金份额总额	236,366,470.21份

投资目标 在具备良好的流动性前提下，本基金将通过积极的资产配置策略，在考虑申购赎回、流动性管理、信用风险控制等情况下，通过适当的资产配置，实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金在综合分析宏观经济、政策环境、资金面、利率水平、信用利差、信用等级、行业分布等因素的基础上，运用信用类定量模型，采取适度分散的行

业配置策略以及个券选择策略，精选具有较好投资价值的债券品种进行投资。

业绩比较基准 中证综合债指数收益率

风险收益特征 本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金，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 招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

嘉实增强收益定期开放A

嘉实增强收益定期开放C

报告期末下属分级基金的份额总额

236,366,471.71份 1,908,50份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年1月1日至2015年9月30日) 期间费用率 2015年9月30日

嘉实增强收益定期开放A 0.054

1.本期实现收益 101,953,563

2.本期利润 5,487,793,000

3.加权平均基金份额本期利润 0.0224

4.期末基金资产净值 243,392,340.96

5.期末基金份额净值 1.000

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份额的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于市场的平均水平；(3) 自2015年9月23日起本基金加入货币基金分类别，自2015年9月24日起本基金增加增强收益定期开放A类和嘉实增强收益定期开放C类基金，报告期自2015年9月25日至2015年9月30日；(4) 嘉实增强收益定期开放A类收益确认(“申赎”)，嘉实增强收益定期开放C类计提销售服务费，不收取认(售)申购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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

嘉实增强收益定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 2.23% 0.11% -0.06%

嘉实增强收益定期开放C

阶段 净值增长(%) 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 0.10% 0.05% -0.10%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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:嘉实增强收益定期债券A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 (2012年9月24日至2015年9月30日)

图2:嘉实增强收益定期债券C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 (2015年9月25日至2015年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效之日起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“第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制”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 任期日期 任本基金的基金经理期限 说明

胡永青 总经理助理 2014年10月28日 - 120天

注: (1) 基金管理人因担任副经理而辞职后公司未作出决定后公告之日；(2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格履行法律法规及基金合同的规定，认真履行诚实信用、公平公正、勤勉尽责的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对本基金投资运作的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照法律法规及基金合同的规定，认真履行诚实信用、公平公正、勤勉尽责的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度市场回顾：

债券市场在3季度出现一波较为明显的上涨行情，其中长端利率收益率下行在20-30BP左右，

信用债收益率下行在30-50BP左右。我们认为3季度的债券牛市由多个原因共同推动，一方面3季度

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

4.7 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.3 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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。

4.3.4 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《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度的规定，通过系统定期报告、严格的流程控制、持续的技术改进、确保公平交易的原则，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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公司公平交易制度指引及公司内部公平交易制度，各基金均按照公平交易制度