嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

【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 基金产品概况

基金简称	嘉实回报混合
基金主代码	070018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月18日
报告期末基金份额总额	448,775,254.80份
投资目标	力争每年获得较高的绝对回报
投资策略	自上而下、从大类资产到个券选择的配置策略。大类资产配置:依据自主开发的战术资产配置模型,在遵守有关投资限制规定的前提下,合理分配各类资产投资比例。股票投资策略:优先进行行业配置,在行业内精选个股。债券投资策略:以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅。
业绩比较基准	同期人民币一年期定期存款利率(税前)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金及货币市场基金。
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 主要财务指标和基金净值表现

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.本期已实现收益	-30,691,961.48
2.本期利润	-143,678,987.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3094
4.期末基金资产净值	437,388,059.20
5.期末基金份额净值	0.975

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要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-22.92%	2.55%	0.48%	0.00%	-23.40%	2.55%

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

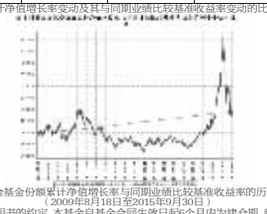

图:嘉实回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年8月18日至2015年9月30日)

注:根据本基金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(十四(二)投资范围和(七)2、基金投资组合比例限制)的有关约定。

§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
		任职日期	离任日期		
常蓁	本基金基金经理	2015年3月12日	-	9年	曾任建信基金管理公司行业研究员。2010年加入嘉实基金管理有限公司,先后担任行业研究员及基金经理助理。硕士研究生。具有基金从业资格,中国籍。

注:(1)任职日期、离职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遵规守信情况的说明

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、《嘉实回报灵活配置混合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 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未超过该证券当日成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度,受中国的资产泡沫破灭以及经济下行的担忧和美联储政策退出预期的影响,全球市场指数无一例外下跌,中国是跌幅最大的市场,三大指数跌幅均在30%左右。板块方面,所有行业全部下跌,表现较好的行业一是低估值及业绩相对稳定的银行、食品饮料、医药生物;二是阶段性景气度较好的传媒娱乐、农业、新能源汽车

三季度本基金维持中低仓位,主要配置了低估值、盈利确定性强、前期相对涨幅较少的行业,取得了中游的业绩表现。

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0.975元;本报告期基金份额净值增长率为-22.92%,业绩比较基准收益率为0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们并不乐观,基本面中长期下行,实体经济复苏会非常缓慢,企业盈利预期面临进一步下调风险,但估值仍然处于较高的状态。在推动牛市的改革和创新两方面因素中,改革低于此前更加市场化的预期,创新进入了需要落地验证的阶段,所以风险偏好继续提升有难度。另外之前市场并没有真正出清,3500和2850的政策底后,仍需寻找市场底。

本基金四季度会保持股票中低仓位,关注几类机会:1)新兴产业精选符合长期发展方向的结构性机会;2)阶段性景气度确定性强的券商等行业;3)十三五规划政策推动行业:光伏、环保、新能源汽车、智能制造等。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	212,731,039.03	48.45
	其中:股票	212,731,039.03	48.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	104,564,500.00	23.81
	其中:债券	104,564,500.00	23.81
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	118,472,985.97	26.98
8	其他资产	3,313,532.78	0.75
	合计	439,082,057.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	38,294,496.70	8.76
B	采矿业	3,667,980.00	0.84
C	制造业	139,689,148.07	31.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,098,238.56	0.71
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,393,012.40	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,533,318.90	1.04
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	12,054,844.40	2.76
S	综合	-	-
	合计	212,731,039.03	48.64

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000998	隆平高科	1,521,979	27,852,215.70	6.37
2	600276	恒瑞医药	474,357	21,910,549.83	5.01
3	000651	格力电器	859,618	13,908,619.24	3.18
4	002020	京新药业	523,179	13,864,243.50	3.17
5	002516	旷达科技	1,226,500	12,816,925.00	2.93
6	000661	长春高新	125,147	12,151,773.70	2.78
7	300133	华策影视	494,051	12,054,844.40	2.76
8	601021	春秋航空	101,542	11,393,012.40	2.60
9	300186	大华农	322,900	11,172,340.00	2.55
10	002714	牧原股份	234,658	10,442,281.00	2.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,036,000.00	2.29
	其中:政策性金融债	10,036,000.00	2.29
4	企业债券	52,798,500.00	12.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,730,000.00	9.54
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	104,564,500.00	23.91

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112196	13苏宁债	330,000	35,448,600.00	8.10
2	101453008	14鲁能源MTN001	200,000	21,398,000.00	4.89
3	1282156	12中石油MTN1	200,000	20,332,000.00	4.65
4	112028	11冀能债	100,000	10,173,000.00	2.33
5	150301	15进出01	100,000	10,036,000.00	2.29

5.6 报告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
报告期末,本基金未持有资产支持证券。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。
5.9 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。
5.10 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	551,113.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,733,935.02
5	应收申购款	28,484.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,313,532.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	526,668,922.76
报告期期间基金总申购份额	20,335,865.69
减:报告期期间基金总赎回份额	98,229,533.65
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	448,775,254.80

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
报告期内,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。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期内,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。

§8 备查文件目录
8.1 备查文件目录
(1)中国证监会核准嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
(2)《嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
(3)《嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
(4)《嘉实回报灵活配置混合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)报告期内嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。
8.2 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
8.3 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,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015年10月27日

嘉实活期宝货币市场基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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 基金产品概况

基金简称	嘉实活期宝货币
基金主代码	000464
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月18日
报告期末基金份额总额	20,300,176,513.49份
投资目标	在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。 根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量等),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	人民币活期存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期已实现收益	187,861,002.60
2.本期利润	187,861,002.60
3.期末基金资产净值	20,300,176,513.49

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)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	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	0.9580%	0.0044%	0.0881%	0.0000%	0.8699%	0.0044%

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

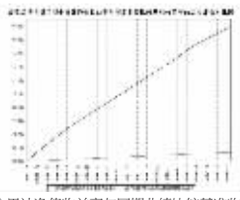

图:嘉实活期宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月18日至2015年9月30日)

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(十二(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
		任职日期	离任日期		
万晓西	本基金、嘉实宝A/B、嘉实活钱包货币、嘉实3个月理财债券、嘉实机构快线货币基金经理,公司现金管理部总监	2013年12月18日	-	15年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部,南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理,2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任现金管理部总监。经济学硕士,中国国籍。

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

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、《嘉实活期宝货币市场基金基金合同》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 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,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度经济下行压力依然较大,投资、消费和出口整体表现依然低迷。具体来看,投资表现疲软,但是后期随着稳增长政策的落地和见效,未来投资表现可能趋于好转;消费表现相对稳定;受海外市场需求疲软影响,出口表现依然较弱。在投资、消费和出口这三架马车中,投资对拉动经济需继续发挥关键作用,房地产投资累计增速趋于回落,作为稳增长主要抓手的基建投资还需进一步增效加力。

2015年8月11日,10年后央行以贬值3%重启汇改,人民币汇率贬值预期显著升温。8月份金融机构外汇占款的大幅减少和央行持续入市干预汇率,货币市场受此影响波动也有所加剧。汇改前,央行放缓了政策放松节奏,政策处于空窗期,市场流动性总量平稳但边际收紧,资金利率小幅上升。汇改后,央行兼顾利率和汇率,通过行政措施和入市干预来稳定汇率,同时重启降准、降息和SLO和实施超额准备金新规以及继续通过公开市场操作等工具来稳定利率。

在此期间,我们紧跟央行政策风向和操作节奏,保证流动性安全的同时,把握时点性收益相对高点,积极调整组合,保持了基金的流动性安全和收益平稳增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金的基金份额净值收益率为0.9580%,同期业绩比较基准收益率为0.0881%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济表现不佳,美联储年内加息概率降低;欧洲经济相对较好;811人民币汇改震动全球并将深入影响全球资本流动;叙利亚内战国际化;大宗商品出现明显反弹;美国主导的TPP短期影响深远,但是短期影响不大。

2015年1—8月,辽宁省一般公共预算收入同比下降22.9%,降幅比前7个月扩大1.2个百分点;山西省一般公共预算收入同比下降11.1%,降幅比前7个月扩大3.2个百分点;个别省份财政收入的大幅下降预示债券信用风险进一步积聚。

在稳增长压力仍然较大、积极财政政策后续需加大发力和地方政府债务置换以及人民币汇率改革的背景下,2015年4季度货币政策将延续稳健基调,兼顾汇率和利率,但是市场超预期波动的可能性较大。

因此本基金将本着有效控制风险的原则,采取中性操作策略,平衡风险与收益关系,以获取稳定回报为主。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,275,489,117.57	43.19
	其中:债券	9,273,413,180.03	43.18
	资产支持证券	2,075,937.54	0.01
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	11,957,584,773.73	55.68
4	其他资产	243,893,345.72	1.14
	合计	21,476,967,237.02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	6.62
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,166,639,096.68	5.75
	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:债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。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20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

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。

5.3.2 报告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	67.20	5.75
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.93	-
2	30天(含)-60天	2.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.77	-
3	60天(含)-90天	14.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	15.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.29	-
5	180天(含)-397天(含)	5.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.60	5.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,859,220,898.71	9.16
	其中:政策性金融债	1,859,220,898.71	9.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,563,765,979.29	22.48
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,850,426,302.03	14.04
8	其他	-	-
9	合计	9,273,413,180.03	45.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	808,808,291.14	3.98

注:上表中,附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。

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111520026	15广发银行CD026	5,000,000	496,507,480.03	2.45
2	111507079	15招行CD079	5,000,000	496,468,650.86	2.45
3	111519054	15恒丰银行CD054	5,000,000	496,430,863.58	2.45
4	111510331	15兴业CD331	5,000,000	491,373,743.10	2.42
5	011509004	15国电集SCP004	4,700,000	470,929,417.20	2.32
6	111591804	15北京农商银行CD028	4,500,000	446,787,777.22	2.20
7	011599432	15清控SCP002	4,000,000	399,995,007.00	1.97
8	130235	13国开35	4,100,000	391,727,396.23	1.93
9	011522003	15神华SCP003	3,000,000	301,423,053.63	1.48
10	011575001	15中信股SCP001	3,000,000	299,972,857.69	1.48

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

序号	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		
报告期内偏离度的最高值		
报告期内偏离度的最低值		
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值		

5.7 报告期末按摊余成本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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1489197	14开元8A1	100,000	2,075,937.54	0.01

注:报告期末,本基金仅持有上述1只资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

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。

5.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	243,684,945.72
4	应收申购款	-
5	其他应收款	208,400.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	243,893,345.72

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	20,639,500,547.74
报告期期间基金总申购份额	18,160,961,007.06
减:报告期期间基金总赎回份额	18,500,285,041.31
报告期期末基金份额总额	20,300,176,513.49

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2015年9月30日	2,084.86	-	-
2	红利再投资	2015年9月29日	2,726.92	-	-
3	红利再投资	2015年9月28日	2,028.23	-	-
4	红利再投资	2015年9月27日	2,028.24	-	-
5	红利再投资	2015年9月26日	2,029.66	-	-
6	红利再投资	2015年9月25日	2,076.72	-	-
7	红利再投资	2015年9月24日	2,117.13	-	-
8	红利再投资	2015年9月23日	4,269.31	-	-
9	赎回	2015年9月23日	-3,000,000.00	-3,000,000.00	-
10	红利再投资	2015年9月22日	6,806.17	-	-
11	红利再投资	2015年9月21日	2,251.33	-	-
12	红利再投资	2015年9月20日	2,353.73	-	-
13	红利再投资	2015年9月19日	4,881.74	-	-
14	红利再投资	2015年9月18日	6,673.40	-	-
15	红利再投资	2015年9月17日	2,411.57	-	-
16	红利再投资	2015年9月16日	2,417.12	-	-
17	红利再投资	2015年9月15日	3,875.52	-	-
18	红利再投资	2015年9月14日	2,452.80	-	-
19	红利再投资	2015年9月13日	2,452.83	-	-
20	红利再投资	2015年9月12日	2,485.72	-	-
21	红利再投资	2015年9月11日	2,475.17	-	-
22	红利再投资	2015年9月10日	2,489.50	-	-
23	红利再投资	2015年9月9日	2,489.89	-	-
24	红利再投资	2015年9月8日	9,697.16	-	-
25	红利再投资	2015年9月7日	2,425.81	-	-
26	红利再投资	2015年9月6日	2,425.85	-	-
27	红利再投资	2015年9月5日	2,426.14	-	-
28	红利再投资	2015年9月4日	2,426.18	-	-
29	红利再投资	2015年9月3日	2,427.57	-	-
30	红利再投资	2015年9月2日	2,426.42	-	-
31	红利再投资	2015年9月1日	2,422.09	-	-
32	红利再投资	2015年8月31日	2,419.40	-	-
33	红利再投资	2015年8月30日	2,419.43	-	-
34	红利再投资	2015年8月29日	2,878.88	-	-
35	红利再投资	2015年8月28日	2,408.53	-	-
36	红利再投资	2015年8月27日	2,401.83	-	-
37	红利再投资	2015年8月26日	3,961.31	-	-
38	红利再投资	2015年8月25日	2,368.59	-	-
39	红利再投资	2015年8月24日	2,619.18	-	-
40	赎回	2015年8月24日	-3,000,000.00	-3,000,000.00	-
41	红利再投资	2015年8月23日	2,619.22	-	-
42	红利再投资	2015年8月22日	2,622.57	-	-
43	红利再投资	2015年8月21日	2,636.06	-	-
44	红利再投资	2015年8月20日	3,542.60	-	-
45	红利再投资	2015年8月19日	6,032.03	-	-
46	红利再投资	2015年8月18日	2,714.70	-	-
47	红利再投资	2015年8月17日	2,584.81	-	-
48	红利再投资	2015年8月16日	2,584.86	-	-
49	红利再投资	2015年8月15日	2,680.86	-	-
50	红利再投资	2015年8月14日	3,430.61	-	-
51	红利再投资	2015年8月13日	8,243.81	-	-
52	红利再投资	2015年8月12日	2,812.61	-	-
53	红利再投资	2015年8月11日	2,887.72	-	-
54	红利再投资	2015年8月10日	2,807.43	-	-
55	红利再投资	2015年8月9日	2,807.47	-	-
56	红利再投资	2015年8月8日	2,807.52	-	-
57	红利再投资	2015年8月7日	2,785.62	-	-
58	红利再投资	2015年8月6日	3,271.78	-	-
59	红利再投资	2015年8月5日	2,762.79	-	-
60	红利再投资	2015年8月4日	2,738.47	-	-
61	红利再投资	2015年8月3日	2,762.20	-	-
62	红利再投资	2015年8月2日	2,762.24	-	-
63	红利再投资	2015年8月1日	2,767.16	-	-
64	红利再投资	2015年7月31日	2,741.65	-	-