

# 嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金

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  
报告送出日期：2016年1月21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2016年1月18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。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。

本报告自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	嘉实丰益信用定期债券
基金代码	000127
基金运作方式	定期开放运作
基金合同生效日	2013年08月21日
报告期末基金份额总额	180,480,474.08份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下，力争当期回报最大化，力求实现长期稳定的业绩表现。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，深入分析宏观经济政策对经济运行的影响，综合考虑利率、信用、流动性等因素，在严格控制风险的前提下，通过精选个券，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合指数收益率+1.75%
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、货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基本资料	嘉实丰益信用定期债券A 嘉实丰益信用定期债券C
下属分级基金的交易代码	000127 001072
报告期末下属分级基金的资产总额	67,297,416,364.69 120,542,861,361.69

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期末 2015年10月1日至2015年12月31日	单位：人民币元
1. 本期已实现收益	1,112,307.28	1,344,182.96
2. 本期利润	1,044,477.07	2,060,267.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0103	0.0104
4. 期末基金份额净值	1.08,403,486.93	1.09,402,726.06
5. 期末基金资产净值	1,019	1,019

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率水平要低于所列数字；(3)自2015年9月22日起对本基金增加C类基金份额类别；自2015年9月28日起开放嘉实丰益信用定期债券A和嘉实丰益信用定期债券C的申购业务；(4)嘉实丰益信用定期债券A收取A(申)购费，嘉实丰益信用定期债券C计收销售服务费，不收取A(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

嘉实丰益信用定期债券A					
阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③
过去三个月	1.80%	0.20%	0.07%	0.01%	0.79%
过去六个月	1.80%	0.20%	0.07%	0.01%	0.79%

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

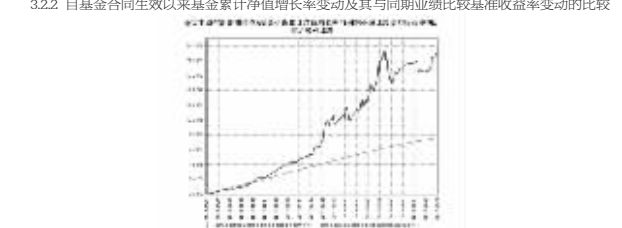


图1：嘉实丰益信用定期债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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“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 基金管理人(或基金经小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	兼任其他基金基金经理时间	证券从业年限	说明
刘宁	本基金-嘉实丰益信用定期债券A和嘉实丰益信用定期债券C的基金经理	2013年08月21日	-	11年	经济金融学硕士，2003年加入嘉实基金管理有限公司，2009年加入本基金管理团队，负责本基金的投资管理工作。先后担任嘉实丰益信用定期债券A和嘉实丰益信用定期债券C的基金经理。

注：(1)任职日期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(或基金经小组)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守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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 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  
四季度宏观经济出现企稳企弱的迹象。从工业增加值角度看，同比增速在10月份下降至5.8%的低点，在11月份回升至6.2%。同期规模以上工业增加值同比增速也出现了连续下降之月的反弹。但不可否认的是经济仍有很多不确定性，由于库存较高等原因，房地产销售的改善并未带来地产投资的转暖，开商的投资意愿依然比较低迷，同时，受制于整体经济偏弱的环境下，整体通胀水平仍然维持了低位运行的走势。从CPI来看，本月有一定幅度的贬值，外储储备有所减少。

四季度债市市场继续走强，国债收益率曲线呈现下行，其中长期国债利率下降幅度超过40BP，信用债收益率下降幅度更为明显，信用利差逐步收窄，同时，产能过剩等问题的债券息差扩大，资产端风险敞口下降的双重驱动使得高等信用债利率进入历史最低水平。回顾来看，我们认为4季度的债市走强有以下几方面原因：首先，在经过股市大幅震荡之后，投资者信心依然不减，避险资金对债券资产的追捧持续不减。同时，经济环境依然低迷，虽然11月份看到了短期企稳的迹象，但是投资者对于中长期经济依然较为悲观，也加剧了大家对债市资产的配置。

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：2016年1月21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2016年1月18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。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。

本报告自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	嘉实海外中国股票(人民币计价)
基金代码	000012
基金运作方式	契约式开放式
基金合同生效日	2007年10月12日
报告期末基金份额总额	81,747,000,130.46份
投资目标	分散投资风险，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，深入分析宏观经济政策对经济运行的影响，综合考虑利率、信用、流动性等因素，在严格控制风险的前提下，通过精选个券，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率
风险收益特征	较高风险、较高收益
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
境外资产托管人	嘉实国际(香港)有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期末 2015年10月1日至2015年12月31日	单位：人民币元
1. 本期已实现收益	-554,260,460.63	-554,260,460.63
2. 本期利润	-448,064,460.63	-448,064,460.63
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0054	-0.0054
4. 期末基金份额净值	0.91,531,273,633.63	0.91,531,273,633.63

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)所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率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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	8.00%	1.20%	3.07%	1.43%	4.93%	-0.23%
过去六个月	8.00%	1.20%	3.07%	1.43%	4.93%	-0.23%

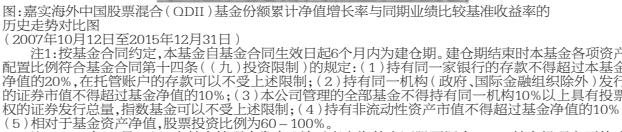


图1：嘉实海外中国股票(人民币计价)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：按基金合同规定，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各项资产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 基金经小组(或基金经小组)简介

报告期内本基金本着稳健投资策略，在风险和收益之间进行平衡。在获取绝对回报为主的前提下，增强策略灵活性，大类资产配置上四季度维持接近90%的权益类配置，年末积极参与可转债和可交换债的一级市场申购，并期后加大可转债和中期票据信用债投资力度。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
截至报告期末嘉实丰益信用定期债券A基金份额净值为1.019元。本报告期基金份额净值增长率为1.46%，截至报告期末嘉实丰益信用定期债券C基金份额净值为1.014元，本报告期基金份额净值增长率为1.65%；同期业绩比较基准收益率为0.67%。

4.3 管理人(或基金经小组)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守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其配套法规、《嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金合同》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约定的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易专项说明  
4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量5%的，合计2次，均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。

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：2016年1月21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2016年1月18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。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。

本报告自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况