

# 嘉实丰益策略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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017年3月29日

## § 1重要提示

### 1.1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本基金年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2016年1月1日起至2016年2月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

## § 2基金简介

### 2.1基金基本情况

基金名称	嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实丰益策略定期债券
基金代码	000183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月30日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金总资产	1,066,698,868.86元
基金合同终止日	不定期

### 2.2基金产品说明

投资目标 在基金的投资和风险管理下，力争当期回报最大化，以谋求长期保值增值。

投资策略 本基金将从宏观经济趋势、基本面分析及货币政策对经济运行的影响、结合中长期利率走势、资金供求状况、波动性及流动性的各方面因素，自下而上地决定资产配置比例，通过定期调整资产配置比例进行优化配置和动态调整，在遵循基金组合原则的同时严格控制现金仓位。

业绩比较基准 一年定期存款收益率+0.5%

风险收益特征 本基金为债券型基金，其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。

风险收益特征

本基金为债券型基金，其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。

2.3基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 嘉实基金管理有限公司 交通银行股份有限公司

姓名 胡学农 高峰

信息披露负责人 联系电话 (010) 65215588 95599

电子邮箱 service@fund.jrfund.com

客户服务电话 400-600-8800 95599

传真 (010) 65182266 021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.jrfund.cn

基金年度报告披露地点 北京市建外大街9号银河大厦嘉实基金管理有限公司

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1本期数据和指标 2016年 2015年 2014年

本期已实现收益 7,650,995.53 5,914,759.81 39,212,995.4

本期利润 -4,051,831.51 6,700,100.41 45,898,218.31

本期加权平均基金份额利润 -0.0664 0.0823 0.0934

本期加权平均剩余利润率 -162% 741% 901%

期末基金资产净值 3.83% 7.86% 114.45%

3.1.2本期末基金指标 2016年 2015年 2014年

本期可供分配利润 -2,185,015.83 2,035,255.30 10,687,95.30

本期已分配利润 -0.0020 0.0313 0.1206

期末基金资产净值 1,064,513,853.03 67,101,198.74 99,311,499.55

3.1.3本期末指标 2016年末 2015年末 2014年末

基金份额净值 0.998 1.031 1.121

基金份额累计净值增长率 26.04% 20.05% 0.01% 15.99% 0.19%

基金份额累计净值增长率 23.9% 21.39% 125.5%

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，费用影响会导致实际收益水平低于所列数字；(3)期末可供分配利润采用期末资产资产负债表中未分配利润与本期利润中实现部分的孰低数。

3.2基金净值表现

3.2.1自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率走势图

图：嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年3月30日至2016年2月31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资产配置比例符合基金合同“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关规定。

3.2.2自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率走势图

图：嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年3月30日至2016年2月31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资产配置比例符合基金合同“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关规定。

3.2.3过去三年基金的利润分配情况

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率走势图

图：过去三年基金的利润分配情况

(2014年3月30日至2016年2月31日)

注：本基金基金合同生效日为2016年3月30日，2016年度的相关数据根据当年实际存续期(2016年3月30日至2016年2月31日)计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率走势图

图：过去三年基金的利润分配情况

(2014年3月30日至2016年2月31日)

注：本基金基金合同生效日为2016年3月30日，2016年度的相关数据根据当年实际存续期(2016年3月30日至2016年2月31日)计算。

4基金管理人及基金基本情况

4.1基金管理人

4.1.1基金管理人的基本情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、南京、宁波、福州、广州设有分公司。公司管理的全部社保基金、企业年金、养老金、保险资金、QDII、特定客户资产管理等业务。

截至2016年2月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金基

4.1.2基金管理人最近一年的诚信情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年无受罚情况。

4.1.3基金管理人最近一年的经营情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年经营情况正常。

4.1.4基金管理人最近一年的内部控制情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有发生重大变化。

4.1.5基金管理人最近一年的合规情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.6基金管理人最近一年的公平交易情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有发生不公平交易行为。

4.1.7基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有发生重大变化。

4.1.8基金管理人最近一年的合规检查情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.9基金管理人最近一年的稽查情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.10基金管理人最近一年的信息披露情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.11基金管理人最近一年的内部控制评价

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.12基金管理人最近一年的公平交易制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.13基金管理人最近一年的内部控制制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.14基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.15基金管理人最近一年的内部控制评价

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.16基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.17基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.18基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.19基金管理人最近一年的内部控制制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.20基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.21基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.22基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.23基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.24基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.25基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.26基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.27基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.28基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.29基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.30基金管理人最近一年的公平交易制度执行情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司，最近一年内没有受到监管机构的重大行政处罚。

4.1.31基金管理人最近一年的内部控制制度建设情况