

嘉实丰益纯债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
送出日期：2017年3月29日

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。本基金报告经全部独立董事签字同意，并由基金经理签署。

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2017年3月24日核对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，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12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

2.2 基金简介

基金名称	嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实丰益纯债定期债
基金主代码	000116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月21日
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
报告期末基金总资产	2,339,763,328.84元
基金合同终止日期	不定期

2.2 基金产品说明

投资项目	本基金在申请的项目和投资限制下，力争长期回报最大化，以谋求长期的绝对收益。
投资策略	本基金通过密切关注经济运行趋势、深入分析政策及货币政策对经济运行的影响，结合各大类资产的预期收益率、波幅及流动等方面因素，做出最佳的投资配置，并不断调整资产配置比例，实现资产组合的动态优化配置，在规避风险组合的基础上进一步增强收益。
业绩比较基准	一年定期存款利率+0.5%
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，高于货币市场基金。
2.3 基金管理人和基金托管人	

2.4 信息披露方式

基金管理人公告网址	http://www.jrfund.cn
基金年度报告置备地点	北京市建国门北大街 3 号嘉实基金管理有限公司
报告期	
报告期	
报告期	

3.1 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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
姓名	胡明锐	王长民
信息披露负责人	胡明锐	(010) 65954986
电子邮箱	service@jrfund.cn	fd@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8000	95566
传真	(010) 65182266	(010) 65954942

2.4 信息披露方式

3.2 基金净值表现

3.3 利润分配情况

3.4 基金净值表现

3.5 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	份额净值增长 率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	收益利率差 额(%)
过去三个月	-1.75%	0.14%	0.51%
过去六个月	-0.75%	0.11%	0.16%
过去一年	-1.20%	0.09%	0.03%
过去三年	-2.35%	0.10%	0.83%
自基金合同生 效起至今	-22.68%	0.10%	10.80%

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、股息收入、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未实现公允价值变动收益；(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时所发生的基金交易费用。

3.6 基金份额净值

3.2.1 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

3.2.3 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

3.2.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3.2.5 基金的业绩

3.2.6 基金的分红情况

3.2.7 基金的费用

3.2.8 基金的资产

3.2.9 基金的负债

3.2.10 基金的净资产

3.2.11 基金的资产净值

3.2.12 基金的资产总额

3.2.13 基金的负债总额

3.2.14 基金的净资产总额

3.2.15 基金的资产净值总额

3.2.16 基金的资产总额与负债总额的差额

3.2.17 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.18 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.19 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.20 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.21 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.22 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.23 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.24 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.25 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.26 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.27 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.28 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.29 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.30 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.31 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.32 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.33 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.34 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.35 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.36 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.37 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.38 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.39 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.40 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.41 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.42 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.43 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.44 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.45 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.46 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.47 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.48 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.49 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.50 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.51 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.52 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.53 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.54 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.55 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.56 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.57 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.58 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.59 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.60 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.61 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.62 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.63 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.64 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.65 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.66 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.67 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.68 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.69 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.70 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.71 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.72 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.73 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.74 基金的资产净值总额与负债总额的差额

3.2.