

嘉实增强收益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：招商银行股份有限公司
送出日期：2017年3月29日

\$ 1 提示
基金管理人的董事、监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。
本年度报告经全部独立董事签字同意，并由董事会签发。

基金管理人招行银行股份有限公司根据基金合同规定，于2017年3月24日复核了本基金的财务指标、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，保证报告不存在虚假记载、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。

基金管理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。

本年度报告摘要拟自年度报告正文，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	嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强收益定期债券
基金主代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月24日
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
报告期天数	2,058,343,175.00份
基金合同存续期	不长期
下一开放日的基金份额总额：	嘉实增强收益定期债券 A 嘉实增强收益定期债券 C
下阶段基金份额总额：	070033 001873
报告期天数下阶段基金份额总额：	2,058,174,375.75份 168,793.91份

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在审慎的投资管理与风险管理下，力争总回报最大化，以谋求长期增值。

投资策略 在具备多样风险预期的市场中，优先考虑流动性及非AAA级别的其他信用债券。同时，还可通过其他途径，衍生工具等辅助研究，运用定性与定量模型，采取适度分散的行业配置策略以及自下而上的精选个股。

业绩比较基准 中证企业债指数收益率

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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
姓名	胡学军	张燕
信息披露负责人	(010) 65215568	(0755) 83199084
联系电话	service@sfund.com	yan_zhang@mcbnchina.com
电子邮箱		
客户服务电话	400-600-8800	95555
传真	(010) 65182266	(0755) 83195201

2.4 信息披露方式

报告期内基金管理人的管理人互联网网址 http://www.jrfund.cn

基金管理年度报告备置地点 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

\$ 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

3.1.1 期间数据	2016年	2015年	2014年
嘉实增强收益定期债券 A	嘉实增强收益定期债券 C	嘉实增强收益定期债券 A	嘉实增强收益定期债券 C
本期已实现收益	24,113,040.29	1,799.27	18,044,-179.66
本期利润	-5,008,-777.21	-529.06	24,74,-560.95
加权平均基金份额净值	-0.0072	-0.0094	0.1021
本期加权平均净资产收益率	-0.70%	-0.93%	9.88%
本期基金份额净值增长率	3.60%	3.20%	10.29%
3.1.2 期末数据	2016年末	2015年末	2014年末
本期可供分配利润	31,264,741.52	-818.96	5,261,441.53
本期可供分配利润	0.0152	-0.0049	0.0224
本期可供分配利润	2,096,729	167,	247,181,
本期可供分配利润	1,019	0.995	1.051
3.1.3 期末数据	2016年末	2015年末	2014年末
本期可供分配利润	31,264,741.52	-818.96	5,261,441.53
本期可供分配利润	0.0152	-0.0049	0.0224
本期可供分配利润	2,096,729	167,	247,181,
本期可供分配利润	1,019	0.995	1.051
3.1.4 期末数据	2016年末	2015年末	2014年末
本期可供分配利润	32.24%	5.27%	27.65%
基金份额净值增长	2.00%	2.00%	15.74%

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申购基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字；(3)期末可供分配利润除以期末资产净值即为单位分红比例；(4)自2015年9月24日起开放嘉实增强收益定期债券A的申赎业务；(5)嘉实增强收益定期债券C计提销售服务费，不收取认(申)购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长值率与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实增强收益定期债券 A

嘉实增强收益定期债券 C

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走势图

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走势图

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走势图

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走势图

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金基金合同生效日起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“第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制”的有关约定。

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

嘉实增强收益定期债券 A

嘉实增强收益定期债券 C

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走势图

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走势图

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走势图

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走势图

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金基金合同生效日起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“第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制”的有关约定。

3.2.3 公司公平交易制度及控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理办法》公平交易制度的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控稽核和信息披露等方面确保在投资管理活动中对公平不损害投资组合利益，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求在境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息，投资决策，在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时充分考虑公平的机制。所有投资组合投资于同一证券的定价原则，遵循公平交易的原则，通过公平交易系统进行公平交易，共同分享投资资源，对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易，交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合公平的交易机会，对于每只债券一级市场申购、二级市场申购和大宗交易等公开的交易，严格遵循各投资组合交投前独立确立交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

3.2.4 公司公平交易的执行情况

3.2.5 本报告期内公司基金运作遵循信守情况的说明

报告期内，本公司严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《关于增强债券定期开放型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本报告期内基金运作遵循信守情况的说明。

3.2.6 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.7 本报告期内基金的会计核算方法

3.2.8 本报告期内基金的估值政策

3.2.9 本报告期内基金的收益分配情况

3.2.10 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.11 本报告期内基金的收入构成

3.2.12 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.13 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.14 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.15 本报告期内基金的收入构成

3.2.16 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.17 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.18 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.19 本报告期内基金的收入构成

3.2.20 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.21 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.22 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.23 本报告期内基金的收入构成

3.2.24 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.25 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.26 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.27 本报告期内基金的收入构成

3.2.28 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.29 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.30 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.31 本报告期内基金的收入构成

3.2.32 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.33 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.34 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.35 本报告期内基金的收入构成

3.2.36 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.37 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.38 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.39 本报告期内基金的收入构成

3.2.40 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.41 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.42 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.43 本报告期内基金的收入构成

3.2.44 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.45 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.46 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.47 本报告期内基金的收入构成

3.2.48 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.49 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.50 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.51 本报告期内基金的收入构成

3.2.52 本报告期内基金的费用支出构成

3.2.53 本报告期内基金的利润分配情况

3.2.54 本报告期内基金的费用计提、开支及摊销情况

3.2.55 本报告期内基金的收入构成