嘉实1个月理财债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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 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12月31日止(注:本基金第二期运作期起始日为2016年12月22日、期满日为2017年1月22日)

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,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实1个月理财债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实1个月理财债券	
基金主代码	000485	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月24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	
报告期末基金份额总额	9,766,110,977.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实1个月理财债券A	嘉实1个月理财债券E
下属分级基金的交易代码:	000485	000486
报告期末下属分级基金的份额总额	8,750,062,001.71份	1,016,048,975.44份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全的基础上,追求稳定收益。
投资策略	在运作期内,本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下,采用持有到期策略建投资组合,基本保持大类品种配置的比例稳定。如果需要,在运作期之间的短暂开放期内,本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。 本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具。如:银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券(包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等)等。在运作期,根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,主要采取持有到期的投资策略。
业绩比较基准	-
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与期限收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡鹏敦	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

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.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	嘉实1个月理财债券A	嘉实1个月理财债券E	嘉实1个月理财债券A	嘉实1个月理财债券E	嘉实1个月理财债券A	嘉实1个月理财债券E
本期已实现收益	10,932,502.42	1,331,252.66	-	-	-	14,010,098.53
本期利润	10,932,502.42	1,331,252.66	-	-	-	14,010,098.53
本期净值收益率	0.1251%	0.1313%	-	-	-	0.4669%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	8,750,062,001.71	1,016,048,975.44	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
累计净值收益率	0.1251%	0.7773%	-	-	-	0.6459%

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)嘉实1个月理财A类和E类基金份额适用相同的托管费率;管理费以分档计提方式收取,浮动管理费率上限为0.30%;A类、E类适用不同的销售服务费费率。(3)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(4)本基金每日计算当日收益并分配,在每个运作期期满后的下一个工作日集中支付。(5)本基金以2016年12月22日至2017年1月22日为第二个运作期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

嘉实1个月理财债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1251%	0.0041%				
自基金合同生效起至今	0.1251%	0.0041%				

嘉实1个月理财债券E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1313%	0.0044%				
过去六个月	0.1313%	0.0044%				
过去一年	0.1313%	0.0044%				
过去三年	0.5982%	0.0086%				
自基金合同生效起至今	0.7773%	0.0062%				

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

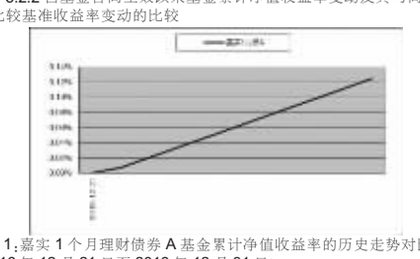


图1:嘉实1个月理财债券A基金累计净值收益率的历史走势对比图(2016年12月21日至2016年12月31日)

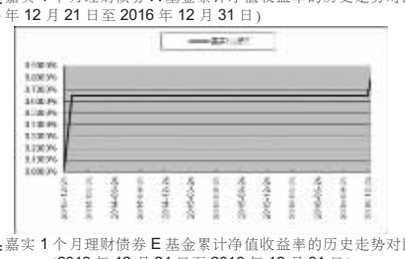
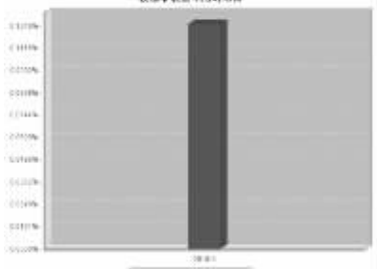
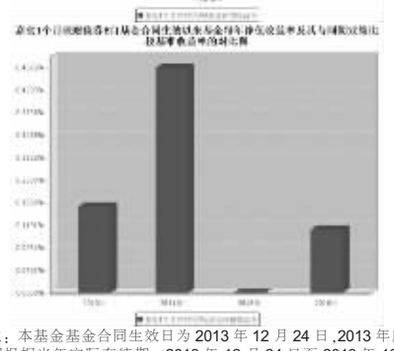


图2:嘉实1个月理财债券E基金累计净值收益率的历史走势对比图(2013年12月24日至2016年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自每个运作期开始后的10个工作日内为建仓期,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。

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





注:本基金基金合同生效日为2013年12月24日,2013年度的相关数据根据当年实际存续期(2013年12月24日至2013年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

嘉实1个月理财债券A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	-	0.14	10,932,502.28	10,932,502.42	
2015年	-	-	-	-	
2014年	-	-	-	-	
合计	-	0.14	10,932,502.28	10,932,502.42	-

单位:人民币元

嘉实1个月理财债券E					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	-	-	1,331,252.66	1,331,252.66	
2015年	-	-	-	-	
2014年	-	-	-	-	
合计	-	-	1,331,252.66	1,331,252.66	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为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、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII,特定资产管理业务资格。

截止2016年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、111只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快钱货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏莉	本基金、嘉实货币、嘉实短期债券、嘉实新金宝货币基金经理	2013年12月14日	-	13年	曾任职于国家开发银行国际金融局、中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作,金融硕士,CFA、CPA,具有基金从业资格,中国籍。
张文羽	本基金、嘉实安心货币、嘉实货币、嘉实宝A/B、嘉实理财宝7天债券、嘉实3个月理财债券、嘉实机构快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券基金经理	2014年8月13日	-	8年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014年4月加入嘉实基金管理有限公司。现任职于固定收益业务板块量化alpha策略组,硕士,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理魏莉的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张文羽的任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1个月理财债券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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、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个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、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。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,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素,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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《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;对投资交易行为进行监察稽核,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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超过该证券当日成交量的5%的,合计6次,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年资金面和债券市场跌宕起伏。前三季央行主导下市场资金面保持宽松。宏观经济数据显示,2016年整体经济增长压力较大,结构性矛盾突出,供给侧改革和去产能过程仍面临较多困难。央行维持货币政策放松操作,3月降低存款准备金率50bps,前三季公开市场货币净投放超过14000亿,并配合SLO和MFL等措施,调节市场流动性缺口,促进降低社会融资成本,支持实体经济发展。央行的量价配合操作取得了较好效果,市场流动性充裕,虽曾有短暂波动,但春节前后、季末、年度缴税期、半年末等关键时点市场都相对平稳度过,前三季银行间隔夜和7天回购利率均值为2.05%和2.47%,每季波动不大。相较短端资金成本的稳定,2季度中长端债券收益率曾有阶段性上行, 主要原因是4月以铁物资和东北特钢为代表的国企债券违约事件,引发市场对信用债全面谨慎,投资者赎回增加导致基金被迫卖出债券,流动性好的利率债也受到冲击,收益率曲线全线上行30-50bps。但是后期信用违约面未进一步扩大,市场资金充裕,通货膨胀数据也低于预期,市场可投资标的有限,以银行理财为主的配置资金对债券仍有大量需求,债券牛市又持续到了3季度。但是2016年4季度整体市场逆转。宏观经济数据显示,4季度国内整体经济增长底部趋稳,经济运行保持在合理区间。但国际形势动荡,美国大选结果超预期,美元指数和美债收益率攀升,人民币贬值压力增加。同时前期宽松货币和低利率环境催生的债券市场繁荣达到高点。针对上述宏观经济环境,央行主导下货币政策回归中性偏紧,叠加人民币加速贬值、外汇占款持续流出,以及金融机构年末MPA考核,资金面整体紧张。在此过程中机构集中赎回货币基金带来的流动性冲击、国海代持引发的事件冲击、美元如期加息后市场预期未来加息节奏加快等一系列利空因素共同影响,债券市场信心遭受严重打击,债市暴跌,国债期货一度跌停。后来,央行通过增加MLF和公开市场逆回购为金融体系注入流动性,国海事件也得以解决,债券市场才有所恢复。但是,中央经济工作会议明确下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在重要位置,春节前资金面也存在多重不确定因素,年末货币市场整体处于紧平衡状态,央行前期的利率走廊已经在一定程度上突破。4季度央行公开市场继续净投放3114亿, 但其中很大一部分是债市暴跌后央行的阶段性维稳操作。并且央行通过MLF操作持续进行“锁短放长”,调节市场流动性缺口的同时提升资金成本。4季度银行间隔夜和7天回购利率均值分别为2.29%和2.81%,较前3季度均值2.05%和2.47%明显上行。整体回顾,2016年债券市场先涨后跌,1年期和10年期国开债收益率分别收于3.18%和3.68%,较上年末2.40%和3.13%大幅平坦化上行,期间在市场最崩溃的12月20日还曾分别触及4.0%和3.93%的高点。2016年信用债市场收益率基本跟随利率债市场波动,信用利差先压缩后扩宽。3季度之前在资金宽松和配置压力推动下,整体收益率下行,同时信用利差进一步压缩;4季度信用债市场在资金紧张、去杠杆和估值上行压力推动下, 收益率也跟随利率债大幅上扬, 信用利差跟随扩宽。整体看2016年末1年期高评级的AAA级短融收益率收于3.91%,同期中等评级的AA+级短融收益率收于4.17%, 较上年末的2.87%和3.20%均大幅上行。并且2016年信用债市场进一步分化,因经济增长乏力、去过剩产能和债务重组压力增加、信贷不良率上升、信用事件爆发等原因,投资者更加谨慎地规避周期行业和民企等信用评级较差券种。

2016年,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务;灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款,管理现金流分布,保障组合充足流动性;控制银行存单和债券资产配置比例,组合保持中性较短久期,在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险;谨慎筛选组合投资个券,严控信用风险;灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看,2016年本基金成功应对了市场和规模波动,投资业绩平稳,实现了安全性、流动性和收益性的目标,并且整体组合的持仓结构相对安全,流动性和弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实1个月理财债券A的基金份额净值收益率为0.1251%,嘉实1个月理财债券E的基金份额净值收益率为0.1313%。

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2017年,宏观经济、货币政策和短期资金面仍是影响货币市场的主要因素。整体看,全球主要经济体增长形势和政策将继续分化。美国经济稳步复苏, 美联储加息节奏和美元走势是影响市场的关键因素;川普就任后的政策存在多重不确定性, 不仅会导致国际金融市场持续波动,还对全球经济增长格局带来长期深远影响;欧洲政治风险增加,但经济增长仍然乏力,但发达国家货币政策宽松到头,开始趋向于收缩央行资产负债表的态势比较明显;新兴经济体仍面临汇率贬值、资金外逃和经济萧条等多重挑战,国际资本流动不确定性进一步增加,预期主要货币汇率需要一段时间达成再平衡;由此带来的影响将错综复杂。而国内经济运行也面临多重问题和挑战, 增长过程中的结构性失衡依然存在,需要继续深化供给侧改革。中央经济工作会议明确稳中求进工作总基调是治国理政的重要原则,下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在更加重要位置,货币政策要保持稳健中性,调节好货币闸门,维护流动性基本稳定。

针对上述国内外经济形势和货币环境, 预计2017年在央行的主导下,货币政策执行上由2016年相对宽松转为紧平衡,会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性,根据实体经济增长情况和市场变动,综合运用公开市场操作和各类创新工具进行调整和指导, 以支持实体经济增长势头。2017年整体金融市场去杠杆过程将延续,叠加外汇市场波动和人民币汇率贬值压力,市场资金面波动概率增加。央行公开市场操作、回购利率和各种定向或创新工具运用将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。2017年受基数、天气原因和油价等因素影响,预期通胀有上行趋势。政府地方债置换计划继续实施,存量债券到期较多有续发需求,债市供给维持高位,股票市场继续推进改革,这些方面的政策投资者均要重点关注。

针对上述复杂的市场环境, 本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性和流动性为首要任务,兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,平衡配置同业存款、存单和债券投资,谨慎选择组合的信用券种持仓,保持合理流动性资产配置,细致管理现金流,以控制利率风险和应对组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内本基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同第十六部分(二)收益分配原则“3.本基金以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,在每个运作期期满后的下一个工作日集中支付”的内容,本期嘉实1个月理财债券A类份额已实现收益为10,932,502.42元;本期嘉实1个月理财债券E类份额已实现收益为1,331,252.66元,每日分配,运作期期满后集中支付,符合本基金基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在嘉实1个月理财债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实1个月理财债券型证券投资基金2016年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师许康玮、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2017)第20659号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:嘉实1个月理财债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	9,766,113,749.87	5,875.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	12,962,906.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	148.00
资产总计		9,779,076,656.85	6,023.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		125,436.51	-
应付销售服务费		566,488.25	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		12,263,754.94	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	10,000.00	6,023.49
负债合计		12,965,679.70	6,023.49
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	9,766,110,977.15	-
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		9,766,110,977.15	-
负债和所有者权益总计		9,779,076,656.85	6,023.49

注1:报告截止日2016年12月31日,嘉实1个月理财债券A基金份额净值1.0000元,基金份额总额8,750,062,001.71份;嘉实1个月理财债券E基金份额净值1.0000元, 基金份额总额1,016,048,975.44份。嘉实1个月理财债券基金份额总额合计为9,766,110,977.15份。

注2:上年度末(2015年12月31日),嘉实1个月理财债券基金份额为零。嘉实1个月理财债券基金于2015年度无开放及运作期。

7.2 利润表

会计主体:嘉实1个月理财债券型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		12,963,455.08	-
1.利息收入		12,962,955.87	-
其中:存款利息收入	7.4.7.11	12,962,955.87	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益		-	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.13	499.21	-
减:二、费用		699,700.00	-
1. 管理人报酬		-	-
2. 托管费		125,436.51	-
3. 销售服务费		566,488.25	-
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.15	7,775.24	-
三、利润总额		12,263,755.08	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润		12,263,755.08	-

注:上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日)没有开放及运作期,无利润相关数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实1个月理财债券型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,263,755.08	12,263,755.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	9,766,110,977.15	-	9,766,110,977.15
其中:1.基金申购款	9,766,150,977.15	-	9,766,150,977.15
2.基金赎回款	-40,000.00	-	-40,000.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-12,263,755.08	-12,263,755.08
五、期末所有者权益(基金净值)	9,766,110,977.15	-	9,766,110,977.15
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注:上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日)没有开放及运作期,无所有者权益变动相关数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____赵学军 _____ _____王红 _____ _____常旭

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2016年1月1日至2016年12月31日)及上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

本期(2016年1月1日至2016年12月31日)及上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日),本基金无基金管理费。

本基金不收取固定管理费,以分档计提方式收取浮动管理费:

本基金A类、E类基金份额年化管理费率上限为0.30%;

当期运作期期满时,基金管理人以各类基金份额的“运作期年化收益率”为基础分别分三档收取管理费;对于每一类别基金份额,在分档模式下,基金管理人将“运作期年化收益率”由低到高分档并设定不同等级的管理费率;“运作期年化收益率”越大的档,管理费率越高;

基金管理费以每个运作期最后一日各类基金份额的基金资产净值为基数,按相应类别基金份额“运作期年化收益率”对应档数的管理费率在运作期最后一日分别计提;其计算公式如下:A类基金份额或E类基金份额当期运作应计提的管理费=当期运作期最后一日A类基金份额的基金资产净值或E类基金份额的基金资产净值×A类基金份额或E类基金份额根据合同约定适用的当期运作期管理费率×当期运作期合计日历日天数/365。管理费计提后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于运作期最后一个工作日后的5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

截止本期末(2016年12月31日),本基金第二期运作期未届满,尚未计提管理费。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	125,436.51	-

注1:上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日),本基金无基金托管费。

注2:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日的基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实1个月理财债券A	嘉实1个月理财债券E	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,528.94	2,528.94
中国银行	543,296.58	-