

## 信息披露

## Disclosure

## 嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金

## 2017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：中国邮政储蓄银行股份有限公司  
送出日期：2018年03月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会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。本年度报告已全部披露，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别法律责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月23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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书及其更新。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要由年度报告正文，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	嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实丰安定期债券
基金主代码	004030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金募集规模/份额	1,500,096,740.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，通过类属资产配置、久期调整、期限结构安排、券种选择、杠杆运用、个券选择、信用品种选择、回购操作等手段，力求在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业比较基准	中证国债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，风险收益特征低于股票型基金，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

基金份额净值日常公告网址：<http://www.jrfund.cn>

基金份额净值公告点播点：北京财富中心北京市东城区建国门内大街8号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 预期指标和指标	2017年	2016年
本期已实现收益	48,555,023.33	91,294.92
本期利润	26,671,174.63	91,294.92
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0001
本期平均净值利润率	195%	0.01%
本期基金份额净值增长率	197%	0.01%
3.1.2 累计报酬率和折价率	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	4,261,320.98	91,294.92
期末可供分配基金份额利润	0.0028	0.0001
期末基金份额总额	1,504,328,099.98	1,501,154,044.37
期末基金份额净值	1.0028	1.0001
3.1.3 累计报酬率	2017年末	2016年末
基金份额净值增长率	198%	0.01%
长	198%	0.01%

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份额时所发生的费用，计算费用后实际收益水平将低于此；(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中分项列示的未分配利润与未利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

金额单位：人民币元

阶段	净值增长率为0%的债券型基金	净值增长率为1%的债券型基金	净值增长率为2%的债券型基金	净值增长率为3%的债券型基金	①-④	②-④
过去一个月	-0.26%	0.04%	-1.42%	0.09%	1.16%	-0.05%
过去二个月	0.41%	0.04%	-1.85%	0.07%	2.24%	-0.03%
过去一年	1.97%	0.04%	-4.28%	0.09%	6.23%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	1.98%	0.04%	-3.82%	0.09%	5.80%	-0.05%

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

金额单位：人民币元

资产	附注号	本期末	2017年12月31日	2016年12月31日
资产：				
银行存款	7471	4,479,457.21	1,500,067,740.47	
结算备付金		8,580,339.14		
拆出资金		45,370.4		
交易保证金	7472	1,580,684,440.0		
买入返售金融资产				
买入返售金融资产	7473	1,580,684,440.00		
应收利息	7474	1,400,000,000.00		
应收股利	7475	31,170,203.8	124,084.06	
应收款项				
应付赎回款				
应付交易费用				
应付税费				
应付利息				
应付利润				
负债：				
短期借款				
应付卖出回购金融资产款	7476	1,400,000,000.00		
应付代理买卖证券款				
应付申购款				
应付赎回款				
应付交易费用				
应付税费				
应付利润				
负债合计		1,625,344,783.96	2,900,191,833.53	
负债和所有者权益				
负债：				
短期借款				
应付卖出回购金融资产款	7477	1,400,000,000.00		
应付代理买卖证券款				
应付申购款				
应付赎回款				
应付交易费用				
应付税费				
应付利润				
负债合计		1,400,000,000.00		
负债和所有者权益				
负债：				
短期借款				
应付卖出回购金融资产款	7478	360,000.00		
应付代理买卖证券款				
应付申购款				
应付赎回款				
应付交易费用				
应付税费				
应付利润				
负债合计		360,000.00		
负债和所有者权益				
资产总计		1,625,344,783.96	2,900,191,833.53	

单位：人民币元

4.1 管理人报告

4.1.1 基金管理人及基金经理的简介

本基金基金管理人为公司，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。公司注册资本为人民币1亿元，公司住所：北京市朝阳区南湖东里1号院1号楼15层1501室，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州设有分公司，公司股东各持有公司50%的股权。

4.1.2 基金经理的简介

截至2017年12月31日，本基金基金经理为孙志远先生，孙志远先生具有14年证券从业经验，其中10年基金管理经验，现任公司基金经理。

4.1.3 管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，结合宏观和微观经济环境的变化，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。

4.2 基金托管人报告

本基金的基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司，公司住所：北京市东城区建国门内大街8号，办公地址：北京市东城区建国门内大街8号嘉实基金管理有限公司，法定代表人：李国华，公司注册资本：人民币10亿元，公司类型：股份有限公司（上市），公司成立日期：2009年9月11日，公司经营范围：吸收公众存款，发放个人贷款，办理国内外结算，办理票据承兑与贴现，从事汇兑业务，代理发行金融债券，代理发行金融债券，代理保险兼营业务，经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

4.3 报告期内本基金利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.4 报告期内本基金发生的其他重要事项

本基金本报告期内无其他重要事项。

4.5 报告期内基金组合投资情况

本基金本报告期内未进行基金组合投资。

4.6 报告期内基金的估值政策和程序

本基金的估值政策和程序参见“基金的估值”部分。

4.7 报告期内基金的会计政策和会计估计

本基金的会计政策和会计估计参见“基金的会计政策”部分。

4.8 报告期内基金的审计

本基金本报告期内未委托会计师事务所对财务报表进行审计。

4.9 报告期内基金的内部控制制度

本基金本报告期内未建立内部控制制度。

4.10 报告期内基金的外部的监察稽核情况

本基金本报告期内未有外部的监察稽核情况。

4.11 报告期内基金的内部的监察稽核情况

本基金本报告期内未有内部的监察稽核情况。

4.12 报告期内基金的投诉情况

本基金本报告期内未收到客户投诉。

4.13 报告期内基金的其他情况

本基金本报告期内未有其他情况。

4.14 报告期内基金的停牌、延期复牌情况

本基金本报告期内未有停牌、延期复牌情况。

4.15 报告期内基金的融资融券交易情况

本基金本报告期内未有融资融券交易。