

嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实如意宝定期债券	
基金主代码	000113	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 4 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	152, 226, 783. 84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
下属分级基金的交易代码:	000113	000115
报告期末下属分级基金的份额总额	104, 947, 749. 11 份	47, 279, 034. 73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金谋求本金稳妥和稳定收益，在此基础上力争较高回报。
投资策略	本基金运用“嘉实下行风险波动模型”控制组合较低波动幅度。在此基础上，本基金将深刻的基本面研究、严谨的债券分析与主动的投资风格相结合，通过“自上而下”的宏观研究与“自下而上”的微观分析，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，确定和调整基金资产在非信用类固定收益类证券（国债、央行票据、政策性金融债等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例，力争持续稳定的收益，并择机少量投资可转债，谋求增强收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率 + 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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	(010) 67595096
传真	(010) 65182266	(010) 66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
----------------------	---

基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,729,464.40	2,923,105.87
本期利润	7,115,108.10	3,097,382.89
加权平均基金份额本期利润	0.0678	0.0655
本期加权平均净值利润率	6.29%	6.10%
本期基金份额净值增长率	6.50%	6.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	11,391,617.64	4,966,605.55
期末可供分配基金份额利润	0.1085	0.1050
期末基金资产净值	116,864,131.12	52,480,597.26
期末基金份额净值	1.114	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	20.19%	19.22%

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）嘉实如意宝定期债券 A/B 收取认（申）购费，嘉实如意宝定期债券 C 不收取认（申）购费但计提销售服务费；（3）所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配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

嘉实如意宝定期债券 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.45%	0.15%	0.24%	0.01%	0.21%	0.14%

过去三个月	4.90%	0.20%	0.71%	0.01%	4.19%	0.19%
过去六个月	6.50%	0.21%	1.50%	0.01%	5.00%	0.20%
过去一年	15.12%	0.20%	3.28%	0.01%	11.84%	0.19%
自基金合同 生效起至今	20.19%	0.15%	7.24%	0.01%	12.95%	0.14%

嘉实如意宝定期债券 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 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
过去一个月	0.36%	0.14%	0.24%	0.01%	0.12%	0.13%
过去三个月	4.72%	0.20%	0.71%	0.01%	4.01%	0.19%
过去六个月	6.22%	0.21%	1.50%	0.01%	4.72%	0.20%
过去一年	14.74%	0.20%	3.28%	0.01%	11.46%	0.19%
自基金合同 生效起至今	19.22%	0.14%	7.24%	0.01%	11.98%	0.13%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.5%

上述“一年期定期存款税后收益率”是指当期封闭期的第1个工作日中国人民银行发布的一年期“金融机构人民币存款基准利率”。该业绩比较基准能反映本基金绝对回报型债券基金的产品定位，符合本基金的风险收益特征，易于被投资人广泛理解，因而较为适当。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

$$\text{Return}(t)=100\% \times (\text{一年期定期存款税后收益率}+0.5\%)/365$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实如意宝定期债券A/B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

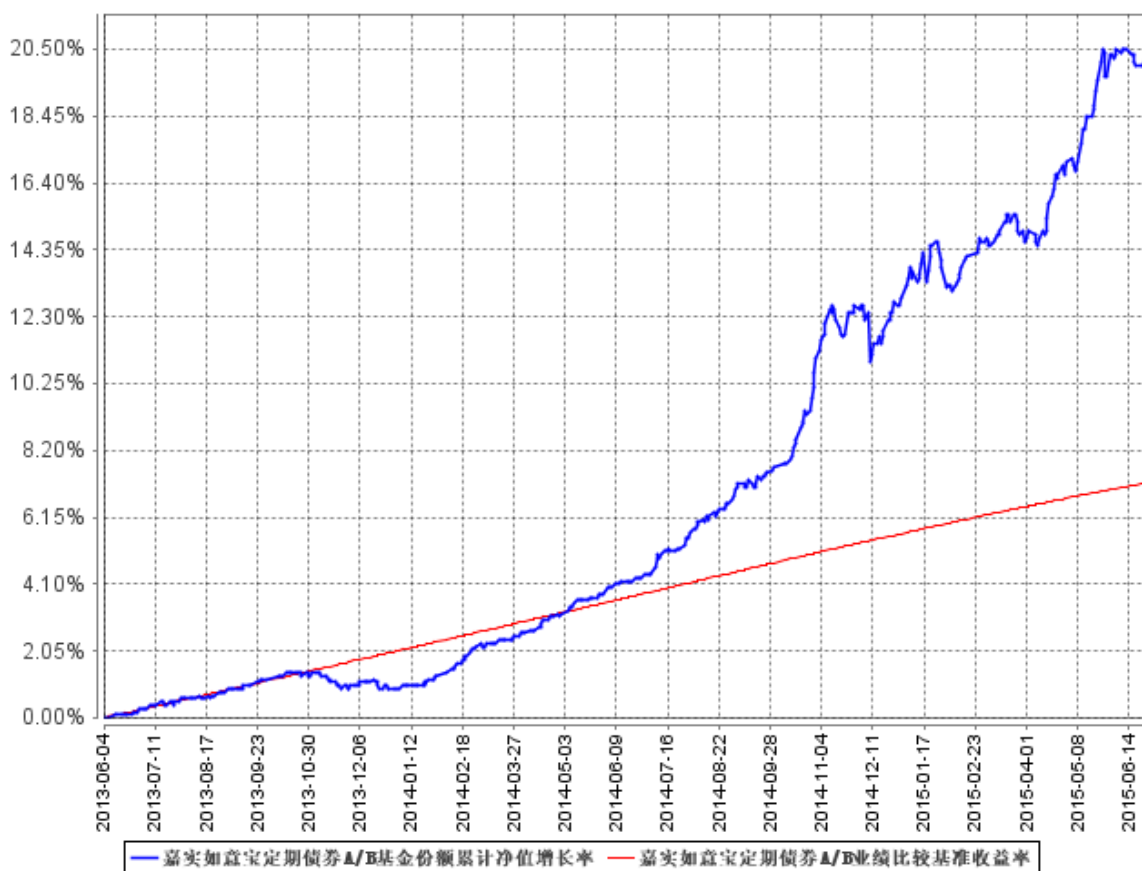


图 1：嘉实如意宝定期债券 A/B 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 4 日至 2015 年 6 月 30 日)

嘉实如意宝定期债券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历史走势对比图

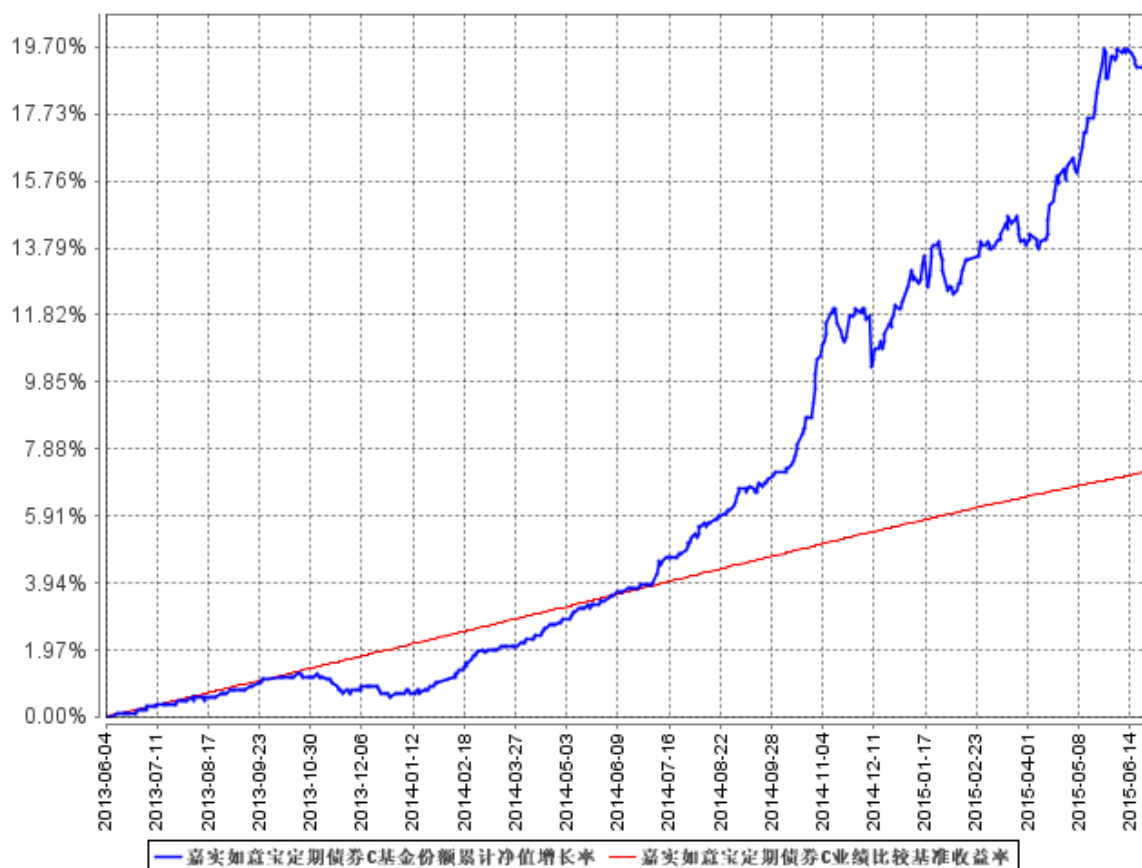


图 2: 嘉实如意宝定期债券 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 4 日至 2015 年 6 月 30 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各项投资比例符合基金合同“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

§ 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 2015 年 6 月 30 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、73 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、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 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(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、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、嘉实新兴市场双币分级债券、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 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、嘉实机构快线货币。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		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实丰益信用定期债券基金经理	2013 年 6 月 4 日	-	11 年	经济学硕士, 2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司, 在公司多个业务部门工作, 2005 年开始从事投资相关工作, 曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、

					机构投资部投资经理。
--	--	--	--	--	------------

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（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合规守信情况的说明

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、《嘉实如意宝定期开放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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 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 3 次，均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

2015 年上半年宏观经济回顾：虽然稳增长政策频出，上半年经济数据仍然处于预期偏下轨水平，整体看经济增长呈现底部企稳的走势，两个季度 GDP 增速均为 7.0%，较去年出现小幅回落。其中第三产业对经济的贡献度有所抬升，成为难得亮点，第三产业中主要增长来源为金融业利润的大幅增加。从投资端来看，整体呈现先抑后平的走势，一季度城镇固定资产增速回落至 13.5%，二季度虽然继续回落，但是进入五六月份出现企稳态势。其中，基建投资相对稳定，体现了政策效果，地产增速持续低迷。

通胀方面，受到前期经济相对弱势，国外大宗商品价格下跌的影响，整体通胀处于较低水平。

CPI 上半年进入探底的过程，最低 0.8%，之后整体维持在 1.2-1.5%之间。PPI 则持续大幅负增长，上半年累计跌幅达到 4.6%。

货币政策方面，在经济相对弱势、通胀维持较低水平的背景下，整体政策呈现持续宽松的态势，上半年共计降息三次，降准两次，多次 PSL 等定向措施。

债券市场：总体来看，债市走势分化明显，利率债收益率低位震荡，期限利差接近历史新高，信用债收益率持续走低，信用利差新低不断。上半年，尽管经济相对低迷，但是政策的放松使得市场对未来的经济反弹存在一定乐观预期，加之猪肉和油价回升所带来的通胀预期抬头，长端收益率处于窄幅震荡，而短端受益于货币政策的持续宽松下行明显，收益率曲线明显陡峭化。信用利差方面，受到宽松政策的推动特别是 ipo 暂停后理财资金配置需求的释放，各等级信用利差都出现回落。按照历史分位比较来看，利差分化更为明显，其中高等级信用债利差处于历史低位，而低等级信用利差仍然处于历史偏高水平。

权益方面：上半年出现大幅震荡走势。起初在经济预期相对稳定、货币宽松、股市加杠杆等作用下，权益市场整体出现大幅上涨，尤其是创业板为代表的中小市值股票，已经出现泡沫化的苗头，6 月中旬以来，在政策对配资监管逐渐增强的背景下，权益类市场出现大幅下跌，甚至有蔓延至系统性金融风险的危险，后经多方全力救市，市场有所企稳。

报告期内本基金面临年度开放，策略上以绝对回报策略为主，注重组合流动性，维持中性偏低杠杆，交易中进行了金融债的波段操作、可转债一级市场申购等。为应对年度开放进行了减仓操作，六月中上旬清仓权益类。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实如意宝定期债券 A/B 基金份额净值为 1.114 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.50%；截至本报告期末嘉实如意宝定期债券 C 基金份额净值为 1.110 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.22%；同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济展望：我们认为经济下半年会延续低位态势，GDP 在 7%附近窄幅波动，或可略超 7%。原因在于一方面经济内生动力依然较弱，制约了经济上行的空间，但另一方面，政策保增长力度较强，叠加其他辅助政策，效果或将在下半年逐步显现。而通胀受到前期基数效应影响，下半年 CPI、PPI 均将有所回升，受制于基本面因素预计回升力度偏弱，整体仍在低位，但通胀的回升会限制降息空间。

债市展望：基本面、通胀方面对债市整体构成中性偏负面影响，货币政策中性偏正面，权益

类市场的波动、信用事件的频发使得市场整体风险偏好下降，无风险利率有进一步下行需求，在此过程中债市长期看好，但是中短期仍然有估值波动的风险，自下而上优选品种、适当规避情绪过度宣泄后可能得深度调整将会是主要的操作策略。需要关注的风险因素包括，资金面边际变化和通胀回升程度是否超预期。

权益类：经过前期市场的大幅波动，后期将震荡收窄，缺少系统性机会。市场偏好将回归基本面以及估值的合理性，可转债仅有少量的波段操作机会。

下半年将进入本组合的第三运作期，规模变化不大绝对规模较小，操作相对灵活，将继续本着稳健投资的原则，控制组合久期，精选个券做好期限匹配部分静态，错配中以中高等级信用债为主，择优参与可转债打新，控制仓位参与二级市场可转债投资，整体操作上中性，平衡类属配置。

4.6 管理人对报告期内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、监察稽核等部门负责人组成，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验。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（十六（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	355,256.43	387,622.86
结算备付金		6,234,024.81	11,480,574.73
存出保证金		8,403.08	20,003.27
交易性金融资产	6.4.7.2	186,672,529.60	257,035,086.49
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		186,672,529.60	252,035,086.49
资产支持证券投资		-	5,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		-	1,225,251.29
应收利息	6.4.7.5	4,514,776.48	5,843,848.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		197,784,990.40	275,992,387.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		28,000,000.00	116,299,938.40
应付证券清算款		1,340.85	27,015.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		97,515.65	93,988.83
应付托管费		27,861.63	26,853.93
应付销售服务费		17,270.87	16,669.10
应付交易费用	6.4.7.7	2,876.33	5,684.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	293,396.69	390,000.00
负债合计		28,440,262.02	116,860,149.94
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	152,226,783.84	152,226,783.84
未分配利润	6.4.7.10	17,117,944.54	6,905,453.55
所有者权益合计		169,344,728.38	159,132,237.39
负债和所有者权益总计		197,784,990.40	275,992,387.33

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，嘉实如意宝定期债券 A/B 基金份额净值 1.114 元，基金份额总额 104,947,749.11 份；嘉实如意宝定期债券 C 基金份额净值 1.110 元，基金份额总额 47,279,034.73 份。嘉实如意宝定期债券基金份额总额合计为 152,226,783.84 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
一、收入		13,013,085.77	78,182,012.35

1.利息收入		6,889,342.06	61,825,558.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,226.54	23,163,769.66
债券利息收入		6,763,226.48	38,371,874.88
资产支持证券利息收入		50,889.04	-
买入返售金融资产收入		-	289,913.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益		5,563,822.99	-7,477,701.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,563,822.99	-7,477,701.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	559,920.72	23,834,156.03
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		2,800,594.78	19,698,115.37
1. 管理人报酬		568,304.11	6,108,024.52
2. 托管费		162,372.61	1,745,149.90
3. 销售服务费		100,708.37	1,055,571.26
4. 交易费用	6.4.7.18	2,791.54	17,204.73
5. 利息支出		1,746,349.02	10,537,653.60
其中：卖出回购金融资产支出		1,746,349.02	10,537,653.60
6. 其他费用	6.4.7.19	220,069.13	234,511.36
三、利润总额		10,212,490.99	58,483,896.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润		10,212,490.99	58,483,896.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	152,226,783.84	6,905,453.55	159,132,237.39
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本	-	10,212,490.99	10,212,490.99

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）	152,226,783.84	17,117,944.54	169,344,728.38
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	1,716,729,965.15	14,204,152.10	1,730,934,117.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,483,896.98	58,483,896.98
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）	1,716,729,965.15	72,688,049.08	1,789,418,014.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军
基金管理人负责人

王红
主管会计工作负责人

常旭
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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相一致的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有

限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	568,304.11	6,108,024.52
其中：支付销售机构的客户维护费	193,318.85	3,116,872.03

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	162,372.61	1,745,149.90

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

6.4.4.2.3 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		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	133.51	133.51
中国建设银行	-	94,315.98	94,315.98
合计	-	94,449.49	94,449.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	440.70	440.70
中国建设银行	-	1,010,427.55	1,010,427.55
合计	-	1,010,868.25	1,010,868.25

注：（1）支付基金销售机构的销售服务费按嘉实如意宝定期债券 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。（2）嘉实如意宝定期债券 A/B 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014

年 6 月 30 日)，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2015 年 6 月 30 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	355,256.43	10,762.43	62,379,286.02	26,335.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.5.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15 天集 EB	2015 年 6 月 11 日	2015 年 7 月 2 日	未上市	100.00	100.00	2,240	224,000.00	224,000.00	网下申购

6.4.5.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 28,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	186,672,529.60	94.38
	其中：债券	186,672,529.60	94.38
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,589,281.24	3.33
7	其他各项资产	4,523,179.56	2.29
	合计	197,784,990.40	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末，本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,740,000.00	12.25
	其中：政策性金融债	20,740,000.00	12.25
4	企业债券	102,391,022.20	60.46
5	企业短期融资券	22,235,600.00	13.13
6	中期票据	40,864,000.00	24.13
7	可转债	441,907.40	0.26
8	其他	-	-
	合计	186,672,529.60	110.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140219	14 国开 19	200,000	20,740,000.00	12.25
2	122905	10 南昌债	126,700	12,961,410.00	7.65
3	011499082	14 山钢 SCP001	120,000	12,129,600.00	7.16
4	112044	11 中泰 01	100,000	10,799,000.00	6.38
5	112002	08 中联债	105,000	10,716,300.00	6.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,403.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,514,776.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	4,523,179.56

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113501	洛钼转债	139,440.00	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉实如意宝定期债券 A/B	1,330	78,908.08	0.00	0.00%	104,947,749.11	100.00%
嘉实如意宝定期债券 C	807	58,586.16	0.00	0.00%	47,279,034.73	100.00%
合计	2,115	71,974.84	0.00	0.00%	152,226,783.84	100.00%

注：(1) 嘉实如意宝 A/B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实如意宝 A/B 份额占嘉实如意宝 A/B 总份额比例、个人投资者持有嘉实如意宝 A/B 份额占嘉实如意宝 A/B 总份额比例；

(2) 嘉实如意宝 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实如意宝 C 份额占嘉实如意宝 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实如意宝 C 份额占嘉实如意宝 C 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实如意宝定期债券 A/B	0.00	0.00%
	嘉实如意宝定期债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实如意宝定期债券 A/B	0
	嘉实如意宝定期债券 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实如意宝定期债券 A/B	0
	嘉实如意宝定期债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
基金合同生效日（2013 年 6 月 4 日）基金份额总额	1,196,345,855.03	520,384,110.12
本报告期期初基金份额总额	104,947,749.11	47,279,034.73
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	104,947,749.11	47,279,034.73

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
申万宏源证券 有限公司	121,679,121.27	57.32%	5,464,300,000.00	68.40%	-	-
中信建投证券 股份有限公司	90,600,443.92	42.68%	2,524,934,000.00	31.60%	-	-

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsgfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日