

嘉实超短债证券投资基金 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。本半年度报告已经由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 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	嘉实超短债证券投资基金
基金简称	嘉实超短债债券
基金主代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 26 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	600,856,316.17 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳妥，保持资产较高的流动性，降低基金净值波动风险，取得超过比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面，将基金的大部分资产投资于货币市场工具，保持基金资产的高流动性，同时提供稳定的收益；另一方面，通过价值挖掘，将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具，为基金资产提供超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率
风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金，低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

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	胡勇钦	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

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)
本期已实现收益	21,988,337.69
本期利润	25,738,284.13
加权平均基金份额本期利润	0.0350
本期加权平均净值利润率	3.38%
本期基金份额净值增长率	3.54%
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	2,684,790.11
期末可供分配基金份额利润	0.0045
期末基金资产净值	622,519,137.66
期末基金份额净值	1.0361
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	37.95%

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) 本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；(3) 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

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	0.22%	0.02%	0.19%	0.01%	0.03%	0.01%
过去三个月	2.01%	0.04%	0.58%	0.01%	1.43%	0.03%
过去六个月	3.54%	0.04%	1.24%	0.01%	2.30%	0.03%
过去一年	6.05%	0.04%	2.73%	0.01%	3.32%	0.03%

过去三年	14.58%	0.05%	8.99%	0.01%	5.59%	0.04%
自基金合同生效起至今	37.95%	0.04%	29.41%	0.01%	8.54%	0.03%

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

嘉实超短债债券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

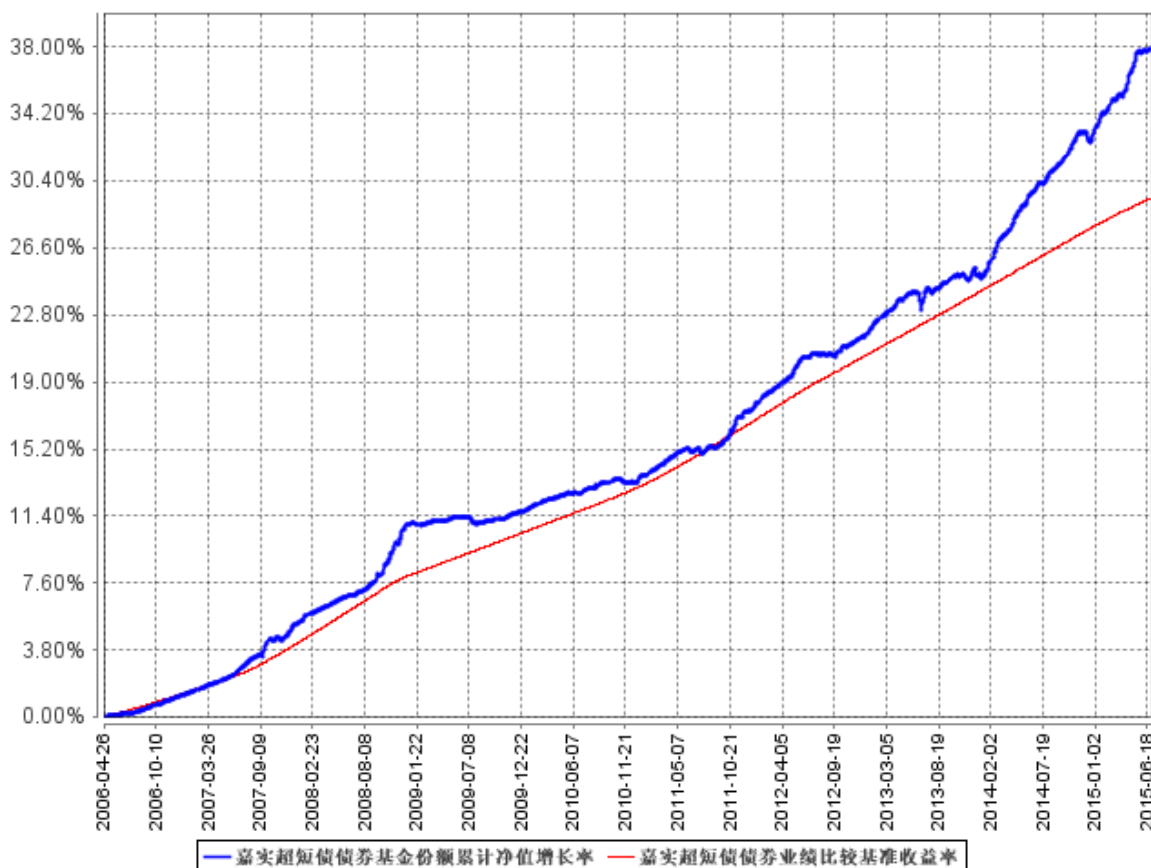


图: 嘉实超短债债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2015年6月30日)

注 1: 按基金合同约定, 本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定: (1) 基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和, 不超过该证券的 10%; (2) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不展期; (3) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%; (4) 投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年; (5) 持有的剩余期限在 397 天以内的债券、现金、剩余期限在 14 天以内的回购余额不低于基金资产净值的 20%; (6) 投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的 5%,

投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的 10%；(7) 中国证监会规定的其他比例限制。

注 2: 2015 年 6 月 9 日, 本基金管理人发布《关于新增嘉实超短债基金经理的公告》, 增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务, 与基金经理魏莉女士共同管理本基金。

§ 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		
魏莉	本基金基金经理、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实 1 个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2009 年 1 月 16 日	-	12 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，中国国籍。
李金灿	本基金基金经理，嘉实宝基金经理	2015 年 6 月 9 日	-	6 年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司担任债券交易员。2012 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于现金管理部。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）任职日期、离职日期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合规守信情况的说明

在报告期内，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、《嘉实超短债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，宏观经济数据显示整体经济仍处低位。从经济数据来看，1 季度我国国内生产总值同比增长 7.0%，2 季度我国国内生产总值同比增长 7.0%，工业增加值同比增速由 1 季度低点 3 月份的 5.6% 小幅回升至 6 月份的 6.8%，政府稳增长压力较大。2015 上半年年初市场资金面延续了 2014 年底的紧张情况，人民币贬值压力倍增，新股效应和春节效应叠加，导致春节之前资金面紧张。而春节后为了降低实际利率，促进信贷发放，央行加大了货币政策放松力度并向市场投放资金。央行持续引导银行间回购利率逐步下行；继续下调公开市场逆回购利率；并通过 SLO、SLF、MLF 等定向方式向银行体系投放资金；在 2 月初和 4 月中旬下调法定存款准备金率，其中 4 月 19 日超预期降低金融机构法定存款准备金率 1 个百分点；5 月 10 日年内第二次降息；6 月继续对银行开展中期借贷便利(MLF)，对政策性银行提供抵押补充贷款(PSL)支持提供长期稳定资金来源；6 月 28 日更同时采取了定向降准和降息的双重措施。央行的量价配合操作取得了明显效果，市场流动性持续改善。1 季度银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 3.09% 和 4.36%，2 季度已经分别大幅下行至 1.54% 和 2.50%，创 09 年以来的最低点。上半年债券市场也在资金面影响下波动，1 季度受流动性紧张、资金成本维持高位影响走势偏弱，2 季度收益率曲线随着央行对于短期利率的向下引导呈现陡峭化下行。市场流动性宽松、资金成本维持低位导致短期债券市场在 2 季度走势较好。但是，受地方债务置换计划影响，2 季度债券市场供给压力增加，中长端利率下行中呈震荡趋势。1 季末 1 年期国开金融债收益率 3.97%，与年初的 3.95% 基本持平，但 2 季末已大幅下

行至 2.78%, 但 10 年国开金融债则于 2 季初的 4.27% 下行至季末的 4.09%, 下行幅度有限。信用产品方面, 收益率也有下降, 因为资金成本下行, 票息收入和资本利得都比较可观, 但是由于市场信用违约风险逐渐暴露, 不同信用等级之间的利差有所拉大。2 季末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率由季初的 4.81% 下行至季末的 3.43%, 中等评级的 AA 级短融收益率则由年初的 5.39% 降至季末的 4.28%。中票和企业债收益率下行, 中低等级信用利差扩大。

上半年, 本基金秉持稳健投资原则, 谨慎把握政策方向, 深入分析宏观经济走势和资金面变化, 灵活调整投资策略, 在确保组合安全性和流动性的前提下, 谨慎操作, 努力创造相对稳定的投资收益。组合基础配置整体保持中性久期, 在控制信用风险的前提下, 选择交易所债券、银行间短融、中票和企业债进行平衡配置, 并搭配不同期限的同业存款进行现金流管理, 在获取稳定票息收入的同时为组合提供流动性储备。受债券市场上涨带来的估值增值影响, 组合净值呈现平稳上行。整体看, 2 季度本基金成功应对了市场冲击和规模波动, 实现了较好回报。并且整体组合的持仓结构相对安全, 流动性和弹性良好, 静态收益仍比较高, 且整体久期合理, 利率风险低, 组合未来估值上涨的空间尚有。平衡的资产配置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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0361 元; 本报告期基金份额净值增长率为 3.54%, 业绩比较基准收益率为 1.24%。

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 2015 年下半年, 宏观经济、货币政策和短期资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看, 美国经济温和复苏, 市场加息预期较强; 欧洲和日本经济差强人意; 国际资本流动不确定性增加, 由此带来的影响将错综复杂。国内经济向新常态转型, 改革攻坚难度增加, 需要警惕经济增速下行太快带来的负面影响, 经济结构仍需改善, 股票市场波动加剧, 通胀缓慢回升但压力不大。综合当前国内外整体经济和货币环境, 预计下半年央行将持续稳健偏宽松的货币政策, 以支持稳定的经济增长, 存在继续降息和降准的概率, 但会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性, 运用各类创新工具进行预调微调, 根据经济情况调整。央行公开市场操作、回购利率和各种定向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。3 季度通常是债券发行密集期, 政府地方债置换计划继续实施, 债市供给增长股票市场波动加剧、存款保险制度正式施行、存贷比考核的取消、利率市场化的全面推进, 将对商业银行的信贷投放和吸收同业存款行为产生新的影响, 这对货币基金也会带来新的机遇和挑战, 投资者要重点关注这方面的政策。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，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，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

(1) 根据本基金基金合同（十八（二）收益分配原则）的约定：“6. 在符合有关基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过 0.001 元的前提下，本基金每个月应将至少 90%的可分配收益进行分红。每年分红次数不超过 20 次”。本基金报告期内共实施了 5 次分配利润，符合基金合同的约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2015 年 7 月 14 日发布《嘉实超短债证券投资基金 2015 年第六次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 6 月 30 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.0410 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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”）在对嘉实超短债证券投资基金（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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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	55,627,442.22	112,606,701.52
结算备付金		8,183,266.85	7,338,395.57
存出保证金		4,912.99	45,860.42
交易性金融资产	6.4.7.2	818,549,277.70	1,236,113,053.49
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		807,549,277.70	1,225,113,053.49
资产支持证券投资		11,000,000.00	11,000,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	18,452,286.66	30,009,832.94
应收股利		-	-
应收申购款		19,032,693.54	13,834,144.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		919,849,879.96	1,399,947,988.92
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		295,399,447.30	433,948,951.99
应付证券清算款		2,491.50	-
应付赎回款		960,424.23	1,072,278.26
应付管理人报酬		219,963.49	545,244.25
应付托管费		75,109.49	186,180.96
应付销售服务费		134,124.08	332,465.99
应付交易费用	6.4.7.7	21,958.61	31,109.82
应交税费		-	-
应付利息		14,794.97	195,788.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	502,428.63	539,263.67
负债合计		297,330,742.30	436,851,283.65
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	600,856,316.17	938,263,615.86
未分配利润	6.4.7.10	21,662,821.49	24,833,089.41
所有者权益合计		622,519,137.66	963,096,705.27
负债和所有者权益总计		919,849,879.96	1,399,947,988.92

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0361 元，基金份额总额 600,856,316.17 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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	上年度可比期间 2014年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2015 年 6 月 30 日	2014 年 6 月 30 日
一、收入		33,781,032.56	25,540,638.25
1.利息收入		27,501,020.65	17,861,583.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,376,388.38	1,192,923.50
债券利息收入		25,822,429.70	16,002,182.99
资产支持证券利息收入		261,830.14	651,042.20
买入返售金融资产收入		40,372.43	15,434.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益		2,480,065.47	685,771.29
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	2,480,065.47	685,771.29
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	3,749,946.44	6,905,783.32
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	50,000.00	87,500.00
减：二、费用		8,042,748.43	6,484,474.61
1. 管理人报酬		1,552,136.87	1,028,029.32
2. 托管费		529,997.94	351,034.43
3. 销售服务费		946,424.92	626,847.17
4. 交易费用	6.4.7.18	9,856.77	9,243.64
5. 利息支出		4,813,223.65	4,283,484.44
其中：卖出回购金融资产支出		4,813,223.65	4,283,484.44
6. 其他费用	6.4.7.19	191,108.28	185,835.61
三、利润总额		25,738,284.13	19,056,163.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润		25,738,284.13	19,056,163.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

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	938,263,615.86	24,833,089.41	963,096,705.27

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
中国银行股份有限公司(中国银行)	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,552,136.87	1,028,029.32
其中：支付销售机构的客户维护费	347,090.25	255,122.87

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 0.41% 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

×0.41% / 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	529,997.94	351,034.43

注：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 0.14%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×0.14% / 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
嘉实基金管理有限公司	60,592.45
中国银行	103,023.46
合计	163,615.91
获得销售服务费各关联方名称	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
嘉实基金管理有限公司	36,661.95
中国银行	81,332.19
合计	117,994.14

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%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：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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

单位：人民币元

本期						
2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	382,200,000.00	33,720.41
上年度可比期间						
2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

易的 各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国银行	-	20,040,028.77	-	-	448,530,000.00	164,038.34

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），基金管理人未运用固有资金申购、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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,627,442.22	20,644.75	62,948,947.70	24,026.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

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证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 225,399,447.30 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
100234	10 国开 34	2015 年 7 月 1	100.52	400,000	40,208,000.00

		日			
011566001	15 中航机 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.48	300,000	30,144,000.00
011599062	15 首旅 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.49	300,000	30,147,000.00
071526002	15 兴业证 券 CP002	2015 年 7 月 1 日	100.07	300,000	30,021,000.00
011499076	14 包钢集 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.82	500,000	50,410,000.00
1182005	11 豫煤化 MTN1	2015 年 7 月 1 日	100.58	500,000	50,290,000.00
合计				2,300,000	231,220,000.00

6.4.5.2.2 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 70,000,000.00 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	818,549,277.70	88.99
	其中：债券	807,549,277.70	87.79
	资产支持证券	11,000,000.00	1.20
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	63,810,709.07	6.94
7	其他各项资产	37,489,893.19	4.08
	合计	919,849,879.96	100.00

7.2 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	50,260,000.00	8.07
	其中：政策性金融债	50,260,000.00	8.07
4	企业债券	172,577,277.70	27.72
5	企业短期融资券	332,316,000.00	53.38
6	中期票据	252,396,000.00	40.54
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	807,549,277.70	129.72

7.3 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	101355002	13 陕有色 MTN001	500,000	51,030,000.00	8.20
2	041454043	14 河钢 CP001	500,000	50,560,000.00	8.12
3	011499076	14 包钢集 SCP001	500,000	50,410,000.00	8.10
4	1182005	11 豫煤化 MTN1	500,000	50,290,000.00	8.08
5	100234	10 国开 34	500,000	50,260,000.00	8.07

7.4 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119025	侨城 03	110,000	11,000,000.00	1.77

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

(1) 本基金的基金份额净值的计算, 精确到 0.0001 元, 小数点第五位四舍五入。

(2) 基金估值: 在证券交易所市场, 实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值, 未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 未上市债券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下按成本估值; 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值; 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值; 其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

7.9.2

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。

7.9.3 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	4,912.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,452,286.66
5	应收申购款	19,032,693.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	37,489,893.19

§ 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

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
12,532	47,945.76	122,824,877.83	20.44%	478,031,438.34	79.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	51,424.11	0.01%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年4月26日）基金份额总额	6,146,255,272.70
本报告期期初基金份额总额	938,263,615.86
本报告期基金总申购份额	2,091,527,297.26
减：本报告期基金总赎回份额	2,428,934,596.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	600,856,316.17

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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 6 月 9 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实超短债基金经理的公告》，增聘李金灿先生担任本基金基金经理，与魏莉女士共同管理本基金。

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

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增

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。

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
华泰证券股份 有限公司	109,669,847.83	52.36%	3,542,276,000.00	30.97%	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	99,785,954.80	47.64%	-	-	-	-
中国中投证券	-	-	7,896,200,000.00	69.03%	-	-

有限责任公司						
--------	--	--	--	--	--	--

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@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日