

嘉实稳固收益债券型证券投资基金

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

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	嘉实稳固收益债券型证券投资基金
基金简称	嘉实稳固收益债券
基金主代码	070020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 1 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,232,376,372.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下，力争持续稳定地获得高于存款利率的收益。
投资策略	运用本基金保护机制（包括嘉实护本目标抬升机制、嘉实固定比例投资组合保险机制、嘉实债券组合风险控制措施），谋求有效控制投资风险。以“3 年运作周期滚动”的方式，实施开放式运作。优先配置债券类资产：投资于剩余期限匹配组合当期运作期剩余期限、具有较高信用等级的中短期债券，以持有到期策略为主；择机少量投资权益类资产：采用收益增强型权益类投资策略。
业绩比较基准	本基金当期运作期平均年化收益率 = 三年期定期存款利率 + 1.6%
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型基金、混合型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	洪渊
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010) 66105798

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	148,195,570.08	91,084,025.34	39,835,923.68
本期利润	165,394,950.40	139,636,589.98	-16,907,640.38
加权平均基金份额本期利润	0.1889	0.1152	-0.0114
本期加权平均净值利润率	16.08%	11.05%	-1.09%
本期基金份额净值增长率	16.19%	12.31%	0.15%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	73,240,493.62	60,033,322.47	37,137,583.96
期末可供分配基金份额利润	0.0594	0.0735	0.0261
期末基金资产净值	1,331,640,960.56	885,717,440.56	1,457,698,221.68
期末基金份额净值	1.081	1.084	1.026
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	36.44%	17.43%	4.56%

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；（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
过去三个月	5.66%	0.32%	1.44%	0.02%	4.22%	0.30%
过去六个月	3.24%	0.53%	2.91%	0.02%	0.33%	0.51%
过去一年	16.19%	0.52%	5.85%	0.02%	10.34%	0.50%
过去三年	30.69%	0.33%	17.82%	0.02%	12.87%	0.31%
过去五年	38.10%	0.27%	29.75%	0.02%	8.35%	0.25%
自基金合同生效起至今	36.44%	0.26%	31.85%	0.02%	4.59%	0.24%

注：本基金业绩比较基准为：三年期定期存款利率 + 1.6%。

上述“三年期定期存款利率”是指当期运作期的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期

“金融机构人民币存款基准利率”。

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：

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

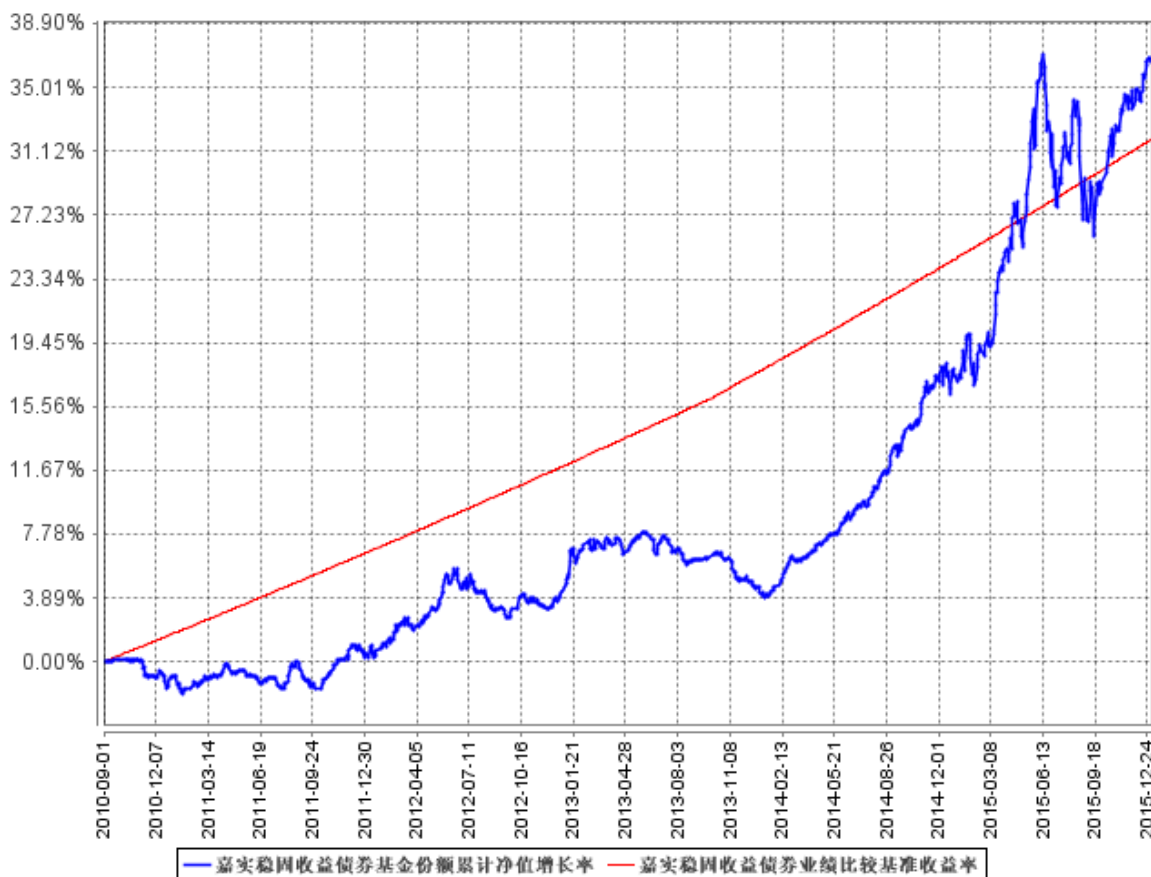
$$\text{Return}(t)=100\% \times (\text{三年期定期存款利率}+1.6\%)/365$$

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

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

嘉实稳固收益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：嘉实稳固收益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

(2010年9月1日至2015年12月31日)

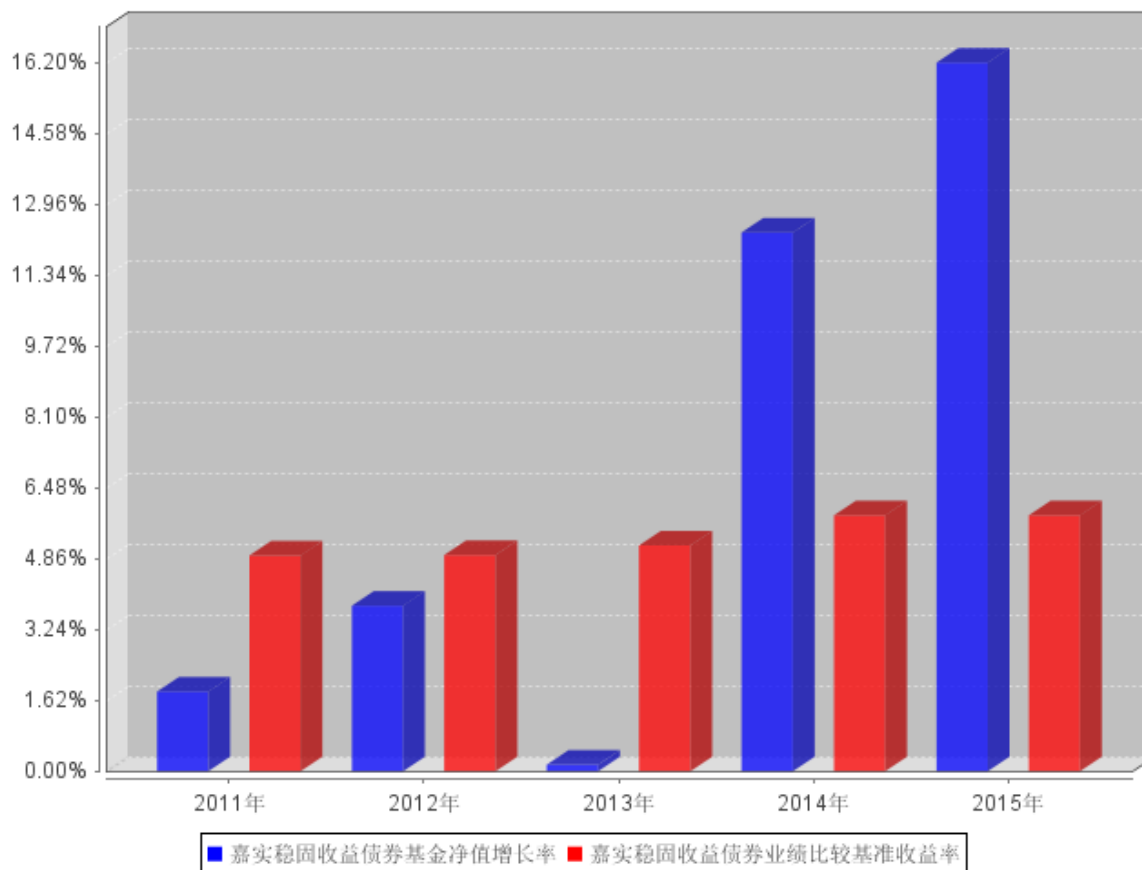
注 1：按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同“十一、基金的投资（二）投资范围和（六）2. 投资组合限制”的有关约定。

注 2：2015 年 4 月 18 日，本基金管理人发布《关于嘉实稳固收益债券基金经理变更的公告》，裴晓辉先生不再担任本基金基金经理；聘请胡永青先生担任本基金基金经理职务，与基金经理曲扬

女士共同管理本基金。

3.2.3 过去五年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

嘉实稳固收益债券过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	1.7870	175,790,065.95	15,404,882.49	191,194,948.44	
2014	0.6310	67,443,921.05	5,463,469.26	72,907,390.31	
2013	0.2000	9,295,643.90	5,064,108.77	14,359,752.67	
合计	2.6180	252,529,630.90	25,932,460.52	278,462,091.42	

§ 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 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、嘉实机构快线货币、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。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		
曲扬	本基金基金经理，嘉实纯债债券、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券基金经理	2014 年 4 月 18 日	-	11 年	曾任中信基金债券研究员和债券交易员、光大银行债券自营投资业务副主管，2010 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
胡永青	本基金基金经理、嘉实信用债券、嘉实增强收益债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实元和、嘉实中证中期企业债、嘉实新财富混合基金经理	2015 年 4 月 18 日	-	12 年	曾任天安保险股份有限公司固定收益组合经理，信诚基金管理有限公司投资经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部。硕士研究生，具有基金从业资格。
裴晓辉	本基金基金经理	2014 年 6 月 20 日	2015 年 4 月 18 日	9 年	曾任人保健康投资部处长、国泰基金固定收益总监等职务。2014 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，担任执行总监，从事投资、研究工作。硕士，具有基金从业资格。

注：（1）任职日期、离任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

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、《嘉实稳固收益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

不同投资组合间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 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

从目前已经陆续披露的 2015 年宏观数据来看，整体上经济呈现出逐渐下行的趋势，在临近年末期间经济数据有阶段性企稳的迹象。指标来看，以工业增加值为例，1 季度增速在 6.4%左右，之后逐渐回落，截至 12 月份，累计增速在 6.1%左右。从三驾马车的角度来分析，对于经济的主要拖累项还是集中在固定资产投资方面。全年来看，城镇固定资产投资增速由 1 季度的 13.5%回落至 12 月份的 10.0%。

通胀角度，受到经济低迷，以及大宗商品价格下跌的影响，全年通胀不断低于市场预期。其中，CPI 在 8 月份达到将近 2%的高点之后重新开始回落，全年水平预计在 1.5%左右。PPI 同比数据更是全年持续下滑，最终累计下跌幅度大约在 5.2%左右，创近年最大跌幅。

货币政策方面，全年央行维持较为宽松的货币环境，先后进行了五次降息降准，提供抵押补充贷款，开展中期借贷便利操作等一系列调控手段。另外值得一提的是，进入 8 月份之后，人民币汇率开始出现大幅波动，在一次性贬值之后，汇率的波动幅度较以往开始明显放大。

债券方面：全年债市整体表现继续强劲，分时间来看，上半年债市整体震荡，10 年国债波动中枢在 3.5%左右，信用债收益率稳步下行。进入下半年，受到股市动荡、经济数据持续低迷等因素的推动，债市整体收益率出现快速下行，10 年国债收益率最低到 2.8%左右的水平。信用债利差整体也呈现持续下行的走势，年末来看中高等级信用利差已经回落至历史最低位区间。全年回顾来看，10 年国债收益率下行 80BP 左右。5 年期 AAA 信用债收益率下行超过 150BP。

股市方面：15 年经历了比较少有的大幅动荡，上半年以创业板为代表的中小盘股票持续大幅上涨，我们的理解是一方面货币政策宽松，经济低迷但无系统性风险，同时政策面对于新兴产业的支持给投资者带来乐观预期。进入年中期，受到政策去杠杆，以及人民币汇率大幅波动的影响，股市开始出现剧烈动荡。进入 4 季度，在政策宽松延续，同时汇率逐渐稳定以及一系列救市措施的推动下，市场开始重新回暖。全年来看，创业板、中小板大幅上涨，而以沪深 300 为代表的大盘权重股则涨幅非常有限。

操作回顾:本基金基本把握了固定收益类资产的机会,保持较高杠杆,利用债市阶段性调整增加信用债的配置,拉长久期,取得了较好的收益;利用利率债流动性较好的特点,积极参与长端利率债的波段交易,有效地增强了组合收益。在权益类资产波动剧烈的 2016 年,积极进行仓位和品种的调整,整体上为组合提供了较大的正贡献,但上半年转债类资产的进攻性未能充分利用。

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 1.081 元;本报告期基金份额净值增长率为 16.19%,业绩比较基准收益率为 5.85%。

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 2016 预计经济仍将震荡寻底,核心关注点在于供给侧改革的发力使得煤炭、钢铁等过剩产业最终去杠杆的进度、形式备受关注,我们认为上述行业的去杠杆压力已经临近,2016 年将会对经济产生一定的下行压力。

就全球而言,需要关注美联储加息节奏,发达国家基本面相对稳健,黑天鹅可能出现在部分新兴经济体当中,尤其一些经常项目持续存在压力(逆差),已经呈现典型滞胀格局的经济体。新兴经济体的黑天鹅可能会成为触发我们内部经济调整的稻草。

2016 年,讨论的焦点在于美联储加息的大背景下,国内货币政策是否还有继续宽松的空间。我们认为,一方面美联储的加息进程在 2016 年不会一蹴而就,而是一个逐步渐进的过程,因此对国内政策的实质性制约较小。另一方面,历史经验来看在外部环境相对稳定的情况下,内部因素主导政策变动。因此,我们预计 2016 年央行仍然有 1-2 次左右的降息空间,主要将集中于下半年,而降准概率和频率也将更高,全年 5-8 次。

债市在 2016 年一季度从基本面和政策面角度而言,我们认为债市的进一步利好因素比较有限。但即使经济暂时企稳,二季度经济与通胀再下台阶的概率依然较大,投资者对长期经济相对悲观,因此债市还将继续有相对确定机会,下半年经济走势要视国内去产能、去库存进度以及外围经济而定。需要关注的是信用风险可能出现逐渐扩散的现象,尤其是进入 15 年财报数据的披露期,一些周期性行业的经营风险可能会显性化,对此我们予以高度关注。

权益市场面临较大的不确定性,国内供给侧改革,汇率波动,美联储加息进程都将对市场的运行带来影响,因此风险偏好的下降有可能是相对确定的方向,因此高估值,缺少实质利润支持的成长类股票今年压力较大,但部分具备良好盈利能力以及商业模式的企业能够穿越经济波动周期,享受持续的较高估值,此外部分基本面稳定的低估值和高分红的蓝筹也具备了长期投资价值,

可以重点关注。

全年角度，我们觉得在经济运行、利率汇率政策和外围环境不确定加大的市场背景下，类固定收益的资产会得到持续的关注，因此跳出传统资产类别约束，主动调整风险收益比可能成为 2016 年能够获取稳定超额收益的主要思路。组合将继续稳健投资，为持有人谋求长期的正回报。

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

本基金的基金管理人于 2015 年 12 月 21 日发布《嘉实稳固收益债券型证券投资基金 2015 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 7 日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.7870 元，具体参见本报告“7.4.11 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，本基金托管人在对嘉实稳固收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，嘉实稳固收益债券型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实稳固收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实稳固收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 191,194,948.44 元。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实稳固收益债券型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

嘉实稳固收益债券型证券投资基金 2015 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、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 20299 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：嘉实稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	75,971,259.99	13,520,052.64
结算备付金		7,968,920.34	14,851,057.34
存出保证金		454,226.58	610,951.39
交易性金融资产	7.4.7.2	1,774,509,481.48	1,102,667,055.29
其中：股票投资		160,089,412.63	67,313,509.45
基金投资		-	-
债券投资		1,604,286,404.85	1,015,353,545.84

资产支持证券投资		10,133,664.00	20,000,000.00
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		85,241,951.05	127,345,827.87
应收利息	7.4.7.5	33,394,679.32	25,651,657.65
应收股利		-	-
应收申购款		1,993,848.05	1,663,800.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,979,534,366.81	1,286,310,402.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		644,298,845.00	280,379,284.73
应付证券清算款		-	117,337,668.44
应付赎回款		970,541.44	671,925.71
应付管理人报酬		656,951.83	493,023.80
应付托管费		181,925.12	136,529.69
应付销售服务费		404,278.07	303,399.28
应付交易费用	7.4.7.7	658,438.73	820,931.78
应交税费		-	-
应付利息		331,717.99	60,195.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	390,708.07	390,002.95
负债合计		647,893,406.25	400,592,961.62
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,232,376,372.44	817,062,978.04
未分配利润	7.4.7.10	99,264,588.12	68,654,462.52
所有者权益合计		1,331,640,960.56	885,717,440.56
负债和所有者权益总计		1,979,534,366.81	1,286,310,402.18

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.081 元，基金份额总额 1,232,376,372.44 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入		192,232,100.30	173,785,493.97
1. 利息收入		58,905,658.97	84,873,126.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	470,360.65	4,892,173.43
债券利息收入		57,558,447.92	79,071,452.89
资产支持证券利息收入		860,440.76	909,500.00
买入返售金融资产收入		16,409.64	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		112,676,327.82	37,701,631.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	93,101,548.90	42,413,464.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	19,222,231.09	-5,544,169.56
资产支持证券投资收益		-0.50	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	352,548.33	832,336.93
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	17,199,380.32	48,552,564.64
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	3,450,733.19	2,658,171.22
减：二、费用		26,837,149.90	34,148,903.99
1. 管理人报酬		6,691,685.11	8,229,004.46
2. 托管费		1,853,082.01	2,278,801.22
3. 销售服务费		4,117,960.06	5,064,002.80
4. 交易费用	7.4.7.18	5,009,084.22	3,369,795.86
5. 利息支出		8,717,051.87	14,741,956.38
其中：卖出回购金融资产支出		8,717,051.87	14,741,956.38
6. 其他费用	7.4.7.19	448,286.63	465,343.27
三、利润总额		165,394,950.40	139,636,589.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润		165,394,950.40	139,636,589.98

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	817,062,978.04	68,654,462.52	885,717,440.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	165,394,950.40	165,394,950.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	415,313,394.40	56,410,123.64	471,723,518.04
其中：1. 基金申购款	1,355,977,618.83	237,280,011.31	1,593,257,630.14
2. 基金赎回款	-940,664,224.43	-180,869,887.67	-1,121,534,112.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-191,194,948.44	-191,194,948.44
五、期末所有者权益（基金净值）	1,232,376,372.44	99,264,588.12	1,331,640,960.56
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,420,560,637.72	37,137,583.96	1,457,698,221.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,636,589.98	139,636,589.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-603,497,659.68	-35,212,321.11	-638,709,980.79
其中：1. 基金申购款	211,440,796.71	7,595,333.34	219,036,130.05
2. 基金赎回款	-814,938,456.39	-42,807,654.45	-857,746,110.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-72,907,390.31	-72,907,390.31
五、期末所有者权益（基金净值）	817,062,978.04	68,654,462.52	885,717,440.56

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
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

7.4 报表附注

7.4.1 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

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。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	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

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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	6,691,685.11	8,229,004.46
其中：支付销售机构的客户维护费	359,199.10	410,683.16

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 0.65% 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 × 0.65% / 当年天数。

7.4.4.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,853,082.01	2,278,801.22

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.18% 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 × 0.18% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	3,347,158.69
中国工商银行	266,646.80
合计	3,613,805.49
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 12 月 31 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	4,196,410.85
中国工商银行	381,326.95
合计	4,577,737.80

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 0.4% 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 × 0.4% / 当年天数。

7.4.4.3 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 12 月 31 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
中国工商银行	-	-	-	-	105,000,000.00	80,704.35
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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
中国工商银行	31,024,023.29	-	-	-	259,140,000.00	82,002.77

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	75,971,259.99	170,841.81	13,520,052.64	188,835.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

7.4.5.1.2 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
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	未上市	100.00	100.00	6,520	652,000.00	652,000.00	网下申购
136120	15鲁能债	2015年12月24日	2016年1月20日	未上市	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	网下申购

7.4.5.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015年12月31日），本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项停牌	14.69	-	-	200,000	4,029,755.20	2,938,000.00	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 369,998,845.00 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
150211	15 国开 11	2016 年 1 月 5 日	100.29	200,000	20,058,000.00
150212	15 国开 12	2016 年 1 月 5 日	102.16	200,000	20,432,000.00
150002	15 付息国债 02	2016 年 1 月 5 日	102.76	100,000	10,276,000.00
150208	15 国开 08	2016 年 1 月 5 日	104.89	500,000	52,445,000.00
1580069	15 洞庭新城债	2016 年 1 月 5 日	107.64	300,000	32,292,000.00

1580228	15 渝能源 债	2016 年 1 月 5 日	103.54	500,000	51,770,000.00
1180114	11 焦作建 投债	2016 年 1 月 4 日	106.63	500,000	53,315,000.00
1180027	11 新奥企 债	2016 年 1 月 4 日	106.91	300,000	32,073,000.00
1080035	10 天保投 资债	2016 年 1 月 4 日	107.03	200,000	21,406,000.00
1580209	15 博投债	2016 年 1 月 4 日	103.33	200,000	20,666,000.00
1480120	14 云南铁 投债	2016 年 1 月 4 日	111.74	300,000	33,522,000.00
1182190	11 石药 MTN1	2016 年 1 月 4 日	100.90	200,000	20,180,000.00
1380128	13 河源城 投债	2016 年 1 月 4 日	105.77	200,000	21,154,000.00
合计				3,700,000	389,589,000.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 274,300,000.00 元,于 2016 年 1 月 5 日前先后到期。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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	160,089,412.63	8.09
	其中:股票	160,089,412.63	8.09
2	固定收益投资	1,614,420,068.85	81.56
	其中:债券	1,604,286,404.85	81.04
	资产支持证券	10,133,664.00	0.51
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	83,940,180.33	4.24
7	其他各项资产	121,084,705.00	6.12

	合计	1,979,534,366.81	100.00
--	----	------------------	--------

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,990,000.00	0.75
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,916,762.31	5.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,258,000.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	12,780,194.88	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,603,226.00	3.05
J	金融业	11,541,229.44	0.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,089,412.63	12.02

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002450	康得新	600,984	22,897,490.40	1.72
2	300383	光环新网	380,600	21,203,226.00	1.59
3	002405	四维图新	500,000	19,400,000.00	1.46
4	600031	三一重工	2,500,000	16,450,000.00	1.24

5	300385	雪浪环境	300,000	14,028,000.00	1.05
6	601601	中国太保	399,904	11,541,229.44	0.87
7	000703	恒逸石化	997,656	11,083,958.16	0.83
8	000592	平潭发展	500,000	9,990,000.00	0.75
9	600755	厦门国贸	1,000,000	9,320,000.00	0.70
10	002029	七匹狼	618,125	8,449,768.75	0.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600219	南山铝业	94,534,158.42	10.67
2	600150	中国船舶	85,223,677.79	9.62
3	002450	康得新	79,531,375.53	8.98
4	002664	信质电机	58,261,133.27	6.58
5	000998	隆平高科	55,714,263.66	6.29
6	002241	歌尔声学	45,862,239.16	5.18
7	601628	中国人寿	39,957,866.66	4.51
8	000089	深圳机场	37,866,153.08	4.28
9	002477	雏鹰农牧	35,520,709.79	4.01
10	002340	格林美	35,515,732.26	4.01
11	000651	格力电器	35,060,959.56	3.96
12	300224	正海磁材	34,962,864.15	3.95
13	002466	天齐锂业	34,147,745.71	3.86
14	600549	厦门钨业	33,826,343.44	3.82
15	002192	*ST 融捷	33,194,924.96	3.75
16	600765	中航重机	32,038,640.53	3.62
17	600010	包钢股份	31,625,737.00	3.57
18	300385	雪浪环境	30,546,420.78	3.45
19	600705	中航资本	30,484,886.16	3.44
20	600582	天地科技	29,980,780.22	3.38
21	601336	新华保险	29,721,118.94	3.36
22	002405	四维图新	29,221,652.77	3.30

23	002215	诺普信	28,763,066.63	3.25
24	002358	森源电气	27,861,549.38	3.15
25	600259	广晟有色	27,688,048.11	3.13
26	601933	永辉超市	27,602,834.71	3.12
27	601166	兴业银行	27,344,541.00	3.09
28	000592	平潭发展	26,387,415.41	2.98
29	000656	金科股份	24,254,795.00	2.74
30	600037	歌华有线	23,941,151.80	2.70
31	300383	光环新网	23,284,744.87	2.63
32	300183	东软载波	22,227,731.20	2.51
33	601318	中国平安	20,122,148.22	2.27
34	600009	上海机场	19,334,500.11	2.18
35	600162	香江控股	18,894,290.00	2.13

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600150	中国船舶	108,229,288.09	12.22
2	600219	南山铝业	91,772,933.44	10.36
3	002358	森源电气	80,739,427.61	9.12
4	002450	康得新	60,142,884.06	6.79
5	002664	信质电机	58,532,507.29	6.61
6	000998	隆平高科	58,500,108.94	6.60
7	002215	诺普信	50,940,155.64	5.75
8	002241	歌尔声学	44,899,038.50	5.07
9	600765	中航重机	42,780,805.65	4.83
10	601628	中国人寿	41,054,671.35	4.64
11	002340	格林美	38,998,327.64	4.40
12	600010	包钢股份	38,851,043.71	4.39
13	600549	厦门钨业	37,397,071.08	4.22
14	002466	天齐锂业	37,104,230.41	4.19
15	601336	新华保险	35,201,856.92	3.97
16	300224	正海磁材	33,490,574.04	3.78
17	600705	中航资本	33,054,055.60	3.73
18	002477	雏鹰农牧	32,683,993.91	3.69
19	002192	*ST 融捷	32,593,624.00	3.68
20	000651	格力电器	29,919,596.00	3.38

21	000089	深圳机场	29,516,143.72	3.33
22	600713	南京医药	28,847,183.57	3.26
23	600037	歌华有线	27,691,478.32	3.13
24	600259	广晟有色	27,595,664.20	3.12
25	601933	永辉超市	26,660,362.47	3.01
26	600582	天地科技	26,206,242.98	2.96
27	601166	兴业银行	25,031,078.78	2.83
28	000656	金科股份	24,071,204.41	2.72
29	300162	雷曼股份	22,863,663.96	2.58
30	000592	平潭发展	22,517,646.50	2.54
31	601318	中国平安	22,470,000.00	2.54
32	600162	香江控股	20,540,717.14	2.32
33	600282	南钢股份	18,873,191.60	2.13
34	600111	北方稀土	18,603,145.06	2.10
35	300385	雪浪环境	18,205,241.00	2.06
36	600000	浦发银行	18,047,927.65	2.04
37	002052	同洲电子	17,847,983.00	2.02

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,947,178,887.53
卖出股票收入（成交）总额	1,948,071,704.19

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	100,523,929.00	7.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	96,135,320.00	7.22
	其中：政策性金融债	96,135,320.00	7.22
4	企业债券	916,046,146.85	68.79
5	企业短期融资券	70,358,000.00	5.28
6	中期票据	418,798,000.00	31.45
7	可转债（可交换债）	2,425,009.00	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	1,604,286,404.85	120.47

8.6 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	127086	10 乌城投	600,000	61,584,000.00	4.62
2	019518	15 国债 18	600,000	59,958,000.00	4.50
3	101456034	14 皖交投 MTN001	500,000	55,200,000.00	4.15
4	1180114	11 焦作建投 债	500,000	53,315,000.00	4.00
5	150208	15 国开 08	500,000	52,445,000.00	3.94

8.7 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

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	119031	澜沧江 3	200,000	10,133,664.00	0.76

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	454,226.58
2	应收证券清算款	85,241,951.05
3	应收股利	-
4	应收利息	33,394,679.32
5	应收申购款	1,993,848.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	121,084,705.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
5,338	230,868.56	998,568,490.93	81.03%	233,807,881.51	18.97%

9.2 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	69,362.46	0.01%

9.3 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月1日）基金份额总额	4,482,963,516.71
本报告期期初基金份额总额	817,062,978.04
本报告期基金总申购份额	1,355,977,618.83
减：本报告期基金总赎回份额	940,664,224.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,232,376,372.44

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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4月18日，本基金管理人发布《关于嘉实稳固收益债券基金经理变更的公告》，裴晓辉先生不再担任本基金基金经理；聘请胡永青先生担任本基金基金经理，与曲扬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

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 6 年提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券股份有限公司	2	1,095,555,682.27	29.00%	766,890.18	29.00%	-
北京高华证券有限责任公司	2	979,093,076.69	25.92%	685,368.67	25.92%	-
国金证券股份有限公司	1	572,464,503.51	15.15%	400,728.95	15.15%	-
国信证券股份有限公司	2	311,354,003.26	8.24%	217,948.30	8.24%	新增 1 个
招商证券股份有限公司	2	259,758,142.76	6.88%	181,832.39	6.88%	-
光大证券股份有限公司	1	233,037,261.11	6.17%	163,126.08	6.17%	-
长江证券股份有限公司	1	130,768,339.82	3.46%	91,538.78	3.46%	新增
广发证券股份有限公司	1	115,814,691.02	3.07%	81,070.94	3.07%	-
中信建投证券股份有限公司	2	79,778,102.27	2.11%	55,844.66	2.11%	-

国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 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。

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。

注 4：国都证券有限责任公司更名为国都证券股份有限公司。

11.7.2 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
中信证券股份有限公司	490,769,375.05	36.85%	13,195,500,000.00	42.20%	-	-
北京高华证券有限责任公司	288,575,434.45	21.67%	6,755,364,000.00	21.61%	-	-
国金证券股份有限公司	33,849,867.22	2.54%	5,775,100,000.00	18.47%	-	-
国信证券股份有限公司	31,960,780.30	2.40%	1,692,200,000.00	5.41%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	424,600,000.00	1.36%	-	-
光大证券股份有限公司	141,811,994.30	10.65%	1,545,900,000.00	4.94%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	170,500,000.00	0.55%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	899,500,000.00	2.88%	-	-
中信建投证券股份有限公司	14,450,700.00	1.09%	808,300,000.00	2.59%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	52,751,503.94	3.96%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	277,596,603.38	20.84%	-	-	-	-

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

2016 年 3 月 29 日