

嘉实稳固收益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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 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。

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 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。

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	1,554,363,536.53 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	郭明
	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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	45,446,427.94	148,195,570.08	91,084,025.34
本期利润	-1,591,187.08	165,394,950.40	139,636,589.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0008	0.1889	0.1152
本期加权平均净值利润率	-0.07%	16.08%	11.05%
本期基金份额净值增长率	-1.39%	16.19%	12.31%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	103,147,954.98	73,240,493.62	60,033,322.47
期末可供分配基金份额利润	0.0664	0.0594	0.0735
期末基金资产净值	1,657,511,491.51	1,331,640,960.56	885,717,440.56
期末基金份额净值	1.066	1.081	1.084
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	34.55%	36.44%	17.43%

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	-2.11%	0.14%	1.23%	0.02%	-3.34%	0.12%
过去六个月	-1.93%	0.16%	2.69%	0.02%	-4.62%	0.14%
过去一年	-1.39%	0.29%	5.64%	0.02%	-7.03%	0.27%

过去三年	28.68%	0.36%	18.36%	0.02%	10.32%	0.34%
过去五年	33.74%	0.30%	30.63%	0.02%	3.11%	0.28%
自基金合同生效起至今	34.55%	0.27%	39.29%	0.02%	-4.74%	0.25%

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：

Benchmark(0)=1000

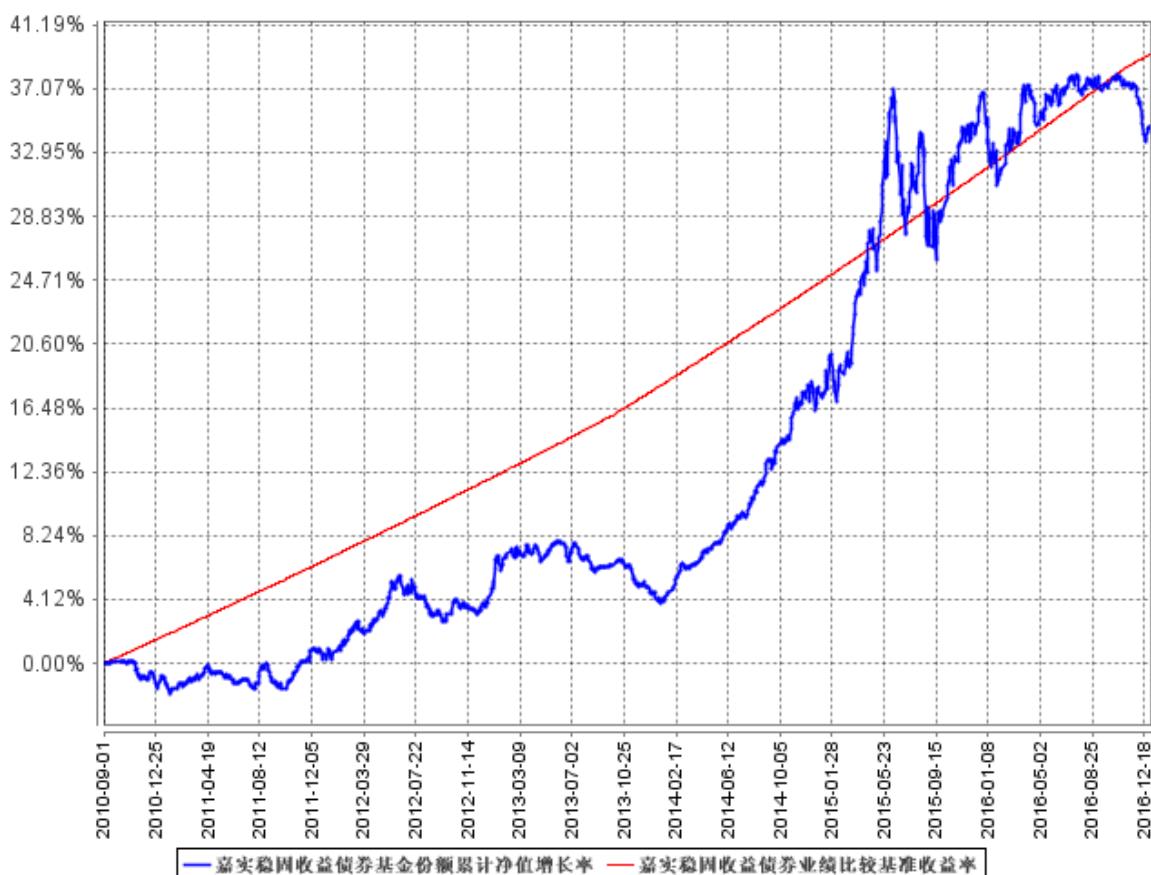
Return(t)=100% × (三年期定期存款利率+1.6%)/365

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中 t=1, 2, 3, …。

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



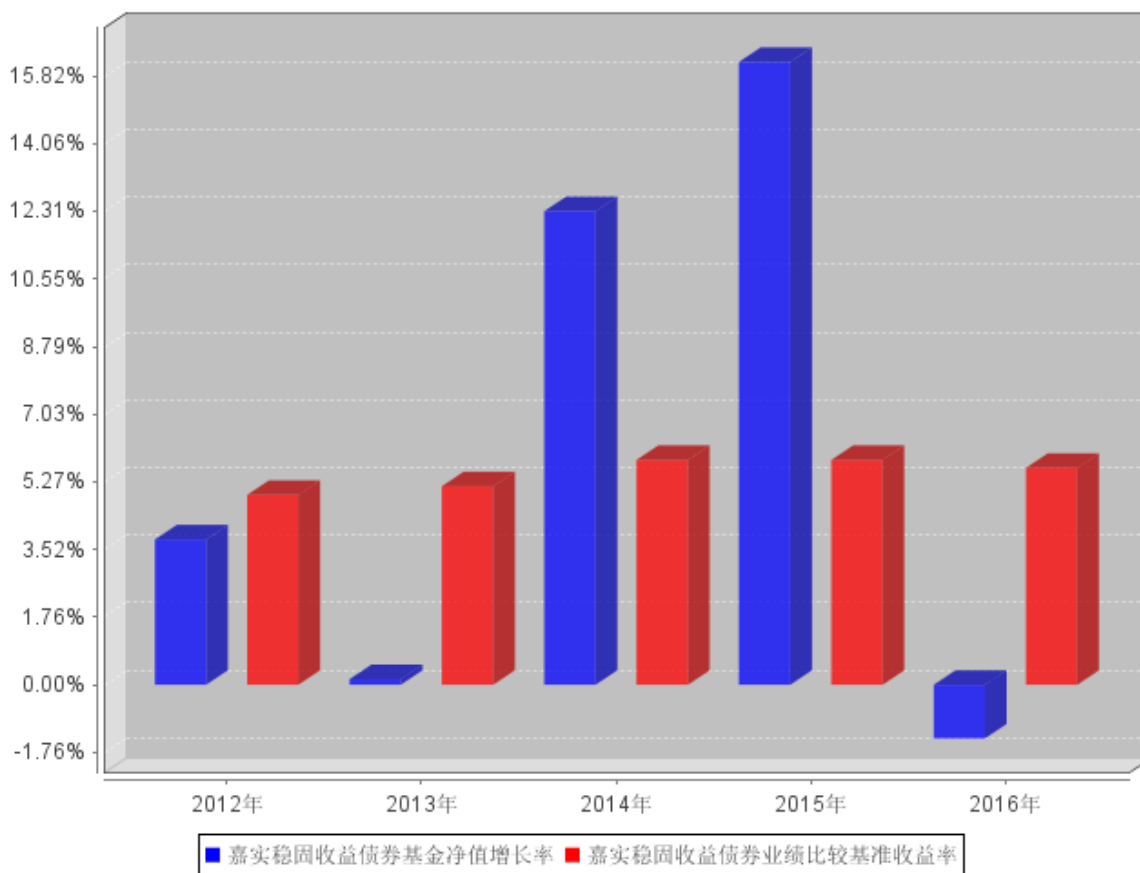
图：嘉实稳固收益债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年9月1日至2016年12月31日)

注：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。

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
2016	-	-	-	-	
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	
合计	2.4180	243,233,987.00	20,868,351.75	264,102,338.75	

§ 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、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		
曲扬	本基金、嘉实纯债债券、嘉实债券、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证中期国债 ETF 及其联接、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、嘉实稳丰纯债债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券基金经理	2014 年 4 月 18 日	-	12 年	曾任中信基金任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，现任职于固定收益业务体系全回报策略组。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
胡永青	本基金、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指数(LOF)、嘉实新财富混合、嘉实新起	2015 年 4 月 18 日	-	13 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

	航混合、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、嘉实稳盛债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合基金经理，公司固定收益业务体系全回报策略组组长			实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系全回报策略组组长。硕士研究生，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，每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

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 年经济走势表现平稳，但暗流涌动，宏观政策在稳增长和控风险之间艰难平衡。整体经济呈现弱稳定格局，前三季度 GDP 增速在 6.7%，四季度略有翘头达到 6.8%，投资、消费增速大体平稳。分项来看，4 季度基建整体增速有小幅回落，地产投资增速在快速回升之后也出现回调的压力，而制造业投资增速在连续数年下滑之后出现反弹。通胀水平持续回升，CPI 相对稳定，供给侧改革带动煤炭、钢铁等其他商品价格普遍大幅上涨。全年焦煤、焦炭价格涨幅超 1 倍，动力煤、螺纹钢、铁矿石涨幅均超 60%，PPI 回升力度明显超出预期，PPI 对 CPI 的传导不可忽视。

货币政策在年度之内发生重大转向，年初延续 2014 年初以来的宽松势头，继续降准，但从 8 月开始央行公开市场进行收短放长操作，警示杠杆和流动性风险，四季度以来加强对表外资产的监管，加之海外特朗普新政、美联储时隔 1 年再度加息和人民币兑美元持续走低等因素，整体流动性急剧趋紧，特别是银行间市场非银机构融资成本飙升，跨年底资金成交达到 10% 的高位。随后央行通过 mlf 对冲、窗口指导、财政存款投放等缓解资金紧张局面。

报告期内基金整体上运作平稳，中短久期获取稳定的息差收益为主，但在四季度特别是 11 月末至 12 月“钱荒”+“债灾”式的调整过程中，组合净值出现一定幅度回撤，不过相对幅度可控。在 12 月中调整冲击最大的阶段，少量增持绝对收益较高的短融和中期票据。

权益方面，低配可转债，股票持仓相对灵活，但结构配置上上半年还是以成长类股票为主，而在下半年市场开始调整的阶段，逐步增加低估值的大盘蓝筹类股票，因此不但没有躲过成长类个股的调整，也没有获益于大盘蓝筹类个股的上行，因此在风格轮动和结构调整方面并没有把握住市场节奏，全年业绩欠佳。

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 1.066 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.39%，业绩比较基准收益率为 5.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

12 月份的中央经济工作会议明确确定调 2017 年调控政策的主基调是“防风险控泡沫”，实际上 2016 年 5 月份权威人士讲话以来，“杠杆是原罪”，“防范金融风险”、“集中力量处置一批风险点”等监管思路贯穿管理层的工作重心。经济层面，尽管短周期有企稳迹象，但企稳的原动力房地产和基建已有后劲不足迹象，海外美国特朗普的上台，其颇多自相矛盾的政策主张使得全球经济发展加剧了不确定性，日本欧洲相对稳定，但欧洲大选年集中选举，在英国脱欧的示范效应下，右翼势力的上台可能会增加新的动荡因素。通胀角度，PPI 继续上升已成一致预期，油价波动给中国带来了外部输入性通胀的压力。CPI 尽管预期相对平静，但农产品和 PPI 的传导效应仍有潜在风险。

内外部在 2017 年均存在着巨大的不确定，因此在“流动性、收益性、安全性”的三角体系中，市场不确定性的抬升会推升对安全性和流动性的诉求，所以，2017 年全球大类资产相对确定的占优策略选择是做多波动，做多流动性，做多避险资产。对于债券市场而言，防范风险的重要性高于获取收益的重要性，组合管理上，票息为王，回避波动，控制杠杆，信用与久期风险可控的高收益债券相对受益；低流动性资产估值溢价上升，信用利差和等级利差大概率拉大。横向比较各类资产的角度，债券类资产由于其固定收益的特征，我们并不十分悲观，等待合理调整后出现的良好投资机会。权益方面，相对谨慎，从确定性角度出发，大盘股中兼具估值优势和稳定成长类品种仍有绝对收益机会，而传统大盘股和成长类股票表现更为均衡，也很难有持续上涨的风格类股票，2017 年对于选股的要求和标准可能会更加严格挑剔。

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、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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 16 日发布《嘉实稳固收益债券型证券投资基金 2016 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2016 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.3320 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遵规守信、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未进行利润分配。

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

2016 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 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 20648 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：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	25,250,876.97	75,971,259.99
结算备付金		17,268,154.95	7,968,920.34
存出保证金		314,467.30	454,226.58
交易性金融资产	7.4.7.2	1,877,992,560.03	1,774,509,481.48
其中：股票投资		135,412,827.53	160,089,412.63
基金投资		-	-
债券投资		1,742,579,732.50	1,604,286,404.85
资产支持证券投资		-	10,133,664.00
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
应收利息	7.4.7.5	37,388,488.81	33,394,679.32
应收股利		-	-
应收申购款		1,250.00	1,993,848.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		1,958,215,798.06	1,979,534,366.81
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		273,039,721.94	644,298,845.00
应付证券清算款		23,599,742.41	-
应付赎回款		773,412.66	970,541.44
应付管理人报酬		1,084,731.92	656,951.83
应付托管费		300,387.31	181,925.12
应付销售服务费		667,527.32	404,278.07
应付交易费用	7.4.7.7	659,919.07	658,438.73
应交税费		-	-
应付利息		168,863.92	331,717.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,000.00	390,708.07
负债合计		300,704,306.55	647,893,406.25
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,554,363,536.53	1,232,376,372.44
未分配利润	7.4.7.10	103,147,954.98	99,264,588.12
所有者权益合计		1,657,511,491.51	1,331,640,960.56
负债和所有者权益总计		1,958,215,798.06	1,979,534,366.81

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 1,554,363,536.53 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：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		40,256,807.96	192,232,100.30
1. 利息收入		111,597,956.05	58,905,658.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	580,782.30	470,360.65
债券利息收入		110,798,141.17	57,558,447.92
资产支持证券利息收入		165,737.50	860,440.76

买入返售金融资产收入		53,295.08	16,409.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-31,763,328.42	112,676,327.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-24,444,083.42	93,101,548.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,061,959.05	19,222,231.09
资产支持证券投资收益		-0.34	-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	2,742,714.39	352,548.33
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-47,037,615.02	17,199,380.32
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	7,459,795.35	3,450,733.19
减：二、费用		41,847,995.04	26,837,149.90
1. 管理人报酬		14,842,832.93	6,691,685.11
2. 托管费		4,110,323.05	1,853,082.01
3. 销售服务费		9,134,051.05	4,117,960.06
4. 交易费用	7.4.7.18	6,382,798.36	5,009,084.22
5. 利息支出		6,907,876.93	8,717,051.87
其中：卖出回购金融资产支出		6,907,876.93	8,717,051.87
6. 其他费用	7.4.7.19	470,112.72	448,286.63
三、利润总额		-1,591,187.08	165,394,950.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-1,591,187.08	165,394,950.40

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：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）	1,232,376,372.44	99,264,588.12	1,331,640,960.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,591,187.08	-1,591,187.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	321,987,164.09	5,474,553.94	327,461,718.03

其中：1. 基金申购款	1,402,315,625.32	85,062,393.09	1,487,378,018.41
2. 基金赎回款	-1,080,328,461.23	-79,587,839.15	-1,159,916,300.38
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）	1,554,363,536.53	103,147,954.98	1,657,511,491.51
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）	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

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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(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

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管理费	14,842,832.93	6,691,685.11
其中:支付销售机构的客户维护费	425,219.67	359,199.10

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 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	4,110,323.05	1,853,082.01

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
	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
嘉实基金管理有限公司	8,227,711.53
中国工商银行	437,086.27
合计	8,664,797.80
获得销售服务费 各关联方名称	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

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

上年度可比期间 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

注：本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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。

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

本报告期内（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），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。

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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 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 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	
	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	25,250,876.97	246,373.06	75,971,259.99	170,841.81

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（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），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2016 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

本期末（2016 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证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2016 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 52,039,721.94 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
1180114	11 焦作建投债	2017 年 1 月 18 日	102.97	500,000	51,485,000.00
1380139	13 闽西兴杭债	2017 年 1 月 18 日	77.27	134,000	10,354,180.00
合计				634,000	61,839,180.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 221,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 6 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	135,412,827.53	6.92
	其中：股票	135,412,827.53	6.92
2	固定收益投资	1,742,579,732.50	88.99
	其中：债券	1,742,579,732.50	88.99
	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	42,519,031.92	2.17
7	其他各项资产	37,704,206.11	1.93
8	合计	1,958,215,798.06	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	88,363,371.01	5.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,648,189.32	1.25
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	26,401,267.20	1.59
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	135,412,827.53	8.17

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	600582	天地科技	5,936,054	29,502,188.38	1.78
2	300012	华测检测	2,285,824	26,401,267.20	1.59
3	600666	奥瑞德	814,119	21,940,507.05	1.32
4	600737	中粮屯河	1,670,700	20,816,922.00	1.26
5	002008	大族激光	689,397	15,580,372.20	0.94
6	002051	中工国际	499,921	11,458,189.32	0.69
7	600068	葛洲坝	1,000,000	9,190,000.00	0.55
8	600867	通化东宝	23,866	523,381.38	0.03

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 只股票。

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	002311	海大集团	125,580,171.54	9.43
2	002714	牧原股份	109,026,762.13	8.19
3	002408	齐翔腾达	107,367,970.88	8.06
4	300224	正海磁材	88,721,621.12	6.66
5	002699	美盛文化	69,275,686.19	5.20
6	002458	益生股份	69,109,572.17	5.19
7	002001	新和成	66,825,143.59	5.02

8	002673	西部证券	59,676,727.28	4.48
9	600666	奥瑞德	59,610,396.97	4.48
10	002089	新海宜	59,168,568.31	4.44
11	002008	大族激光	59,046,879.03	4.43
12	002385	大北农	55,573,675.58	4.17
13	300101	振芯科技	51,064,989.84	3.83
14	300383	光环新网	50,151,605.14	3.77
15	002299	圣农发展	49,044,705.32	3.68
16	000687	华讯方舟	48,885,702.32	3.67
17	002268	卫士通	47,684,902.91	3.58
18	600867	通化东宝	46,652,221.22	3.50
19	600886	国投电力	46,197,286.72	3.47
20	002019	亿帆医药	46,186,858.25	3.47
21	601601	中国太保	44,591,235.76	3.35
22	002548	金新农	42,579,728.98	3.20
23	601169	北京银行	42,349,153.70	3.18
24	600271	航天信息	41,802,181.46	3.14
25	000876	新希望	40,710,153.60	3.06
26	600958	东方证券	38,820,983.09	2.92
27	300012	华测检测	37,253,959.24	2.80
28	600598	北大荒	37,248,991.75	2.80
29	600068	葛洲坝	36,189,853.47	2.72
30	600730	中国高科	36,027,981.32	2.71
31	000909	数源科技	35,610,466.74	2.67
32	600582	天地科技	31,163,808.94	2.34
33	601311	骆驼股份	29,526,773.82	2.22
34	300188	美亚柏科	26,690,253.12	2.00

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002714	牧原股份	130,123,673.41	9.77
2	002311	海大集团	118,160,158.10	8.87
3	002408	齐翔腾达	107,024,675.71	8.04

4	300224	正海磁材	103,825,623.96	7.80
5	002001	新和成	85,255,404.20	6.40
6	002458	益生股份	75,527,006.97	5.67
7	002699	美盛文化	72,928,176.60	5.48
8	002385	大北农	57,032,641.59	4.28
9	300383	光环新网	54,525,081.40	4.09
10	002019	亿帆医药	53,835,606.46	4.04
11	002089	新海宜	53,157,527.57	3.99
12	002673	西部证券	52,960,001.83	3.98
13	601601	中国太保	51,206,148.13	3.85
14	002299	圣农发展	49,757,259.50	3.74
15	002268	卫士通	47,759,730.48	3.59
16	601169	北京银行	47,716,079.44	3.58
17	002548	金新农	47,649,294.81	3.58
18	000687	华讯方舟	47,567,992.26	3.57
19	300101	振芯科技	46,726,604.11	3.51
20	600867	通化东宝	45,950,115.01	3.45
21	600886	国投电力	43,251,160.92	3.25
22	002008	大族激光	42,471,918.54	3.19
23	000876	新希望	41,899,696.02	3.15
24	600271	航天信息	40,859,768.89	3.07
25	600958	东方证券	37,581,269.57	2.82
26	600598	北大荒	34,853,052.93	2.62
27	600730	中国高科	32,372,090.06	2.43
28	000909	数源科技	30,402,684.46	2.28
29	600666	奥瑞德	28,756,362.07	2.16
30	300188	美亚柏科	27,311,764.32	2.05
31	600525	长园集团	27,241,199.20	2.05

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	2,475,144,097.31
卖出股票收入（成交）总额	2,467,758,247.97

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	90,722,990.40	5.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,577,000.00	7.27
	其中：政策性金融债	120,577,000.00	7.27
4	企业债券	964,683,486.50	58.20
5	企业短期融资券	279,880,000.00	16.89
6	中期票据	285,711,000.00	17.24
7	可转债（可交换债）	1,005,255.60	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,742,579,732.50	105.13

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	019539	16 国债 11	604,140	60,335,461.80	3.64
2	127086	10 乌城投	600,000	60,036,000.00	3.62
3	1280226	12 泉州路桥 债 02	500,000	53,335,000.00	3.22
4	1180114	11 焦作建投 债	500,000	51,485,000.00	3.11
5	150208	15 国开 08	500,000	50,640,000.00	3.06

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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	314,467.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,388,488.81
5	应收申购款	1,250.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,704,206.11

8.12.4 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	127003	海印转债	1,005,255.60	0.06

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
5,824	266,889.34	1,366,091,525.19	87.89%	188,272,011.34	12.11%

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	794.91	0.00%

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	1,232,376,372.44
本报告期基金总申购份额	1,402,315,625.32
减:本报告期基金总赎回份额	1,080,328,461.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,554,363,536.53

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士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 110,000.00 元，该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	682,302,559.20	13.80%	477,615.91	13.80%	-
中信证券股份有限公司	2	639,595,947.95	12.94%	447,718.15	12.94%	-

中信建投证券 股份有限公司	2	575,650,124.77	11.65%	402,955.09	11.65%	-
招商证券股份 有限公司	2	560,497,052.54	11.34%	392,350.97	11.34%	-
中泰证券股份 有限公司	1	517,711,909.28	10.47%	362,598.27	10.48%	-
国金证券股份 有限公司	1	432,713,399.91	8.75%	302,902.94	8.75%	-
东方证券股份 有限公司	1	351,565,941.13	7.11%	246,098.87	7.11%	新增
国信证券股份 有限公司	2	343,962,846.47	6.96%	240,776.05	6.96%	-
北京高华证券 有限责任公司	2	281,281,344.46	5.69%	196,898.25	5.69%	-
海通证券股份 有限公司	2	266,226,486.36	5.39%	186,360.98	5.39%	-
广发证券股份 有限公司	1	118,783,215.52	2.40%	83,149.18	2.40%	-
中国中投证券 有限责任公司	1	102,041,425.17	2.06%	71,429.01	2.06%	-
长江证券股份 有限公司	3	44,143,276.51	0.89%	30,900.63	0.89%	新增 2 个
中国银河证券 股份有限公司	1	26,408,006.01	0.53%	18,485.60	0.53%	-
中国国际金融 股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司						
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注 4：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 5：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

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
国泰君安证券股份有限公司	22,905,110.31	9.31%	922,900,000.00	2.62%	-	-
中信证券股份有限公司	118,071,362.15	47.97%	6,876,900,000.00	19.55%	-	-
中信建投证券股份有限公司	85,614,958.69	34.78%	12,537,500,000.00	35.65%	-	-
招商证券股份有限公司	9,283,032.03	3.77%	4,586,000,000.00	13.04%	-	-

中泰证券股份 有限公司	2,070,294.36	0.84%	455,000,000.00	1.29%	-	-
国金证券股份 有限公司	730,160.28	0.30%	178,000,000.00	0.51%	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	1,169,400,000.00	3.33%	-	-
国信证券股份 有限公司	5,064,091.85	2.06%	715,200,000.00	2.03%	-	-
北京高华证券 有限责任公司	2,417,378.10	0.98%	1,015,600,000.00	2.89%	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	1,078,500,000.00	3.07%	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	197,300,000.00	0.56%	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	4,781,200,000.00	13.60%	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	465,000,000.00	1.32%	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	190,000,000.00	0.54%	-	-

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
2017 年 3 月 29 日