（上接B81版）

(83)长江证券股份有限公司

住所,办公地址	湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦		
法定代表人	杨泽柱	联系人	李良
电话	（027）65799999	传真	（027）85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579或4008-888-999

(84)西南证券股份有限公司

住所,办公地址	重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦		
法定代表人	余维佳	联系人	张煜
电话	（023）63786141	传真	（023）6378212
网址	www.swsc.com.cn	客服电话	4008096096

(85)万联证券有限责任公司

住所,办公地址	广州市中山二路18号电信广场36、37层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	（020）37865070	传真	020-22373718-1013
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

(86)渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	（022）28451861	传真	（022）28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(87)山西证券股份有限公司

住所,办公地址	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	（0351）8686659	传真	（0351）8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

(88)信达证券股份有限公司

住所,办公地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
电话	（010）63081000	传真	（010）63080978
网址	www.cindasc.com	客服电话	95321

(89)新时代证券有限责任公司

住所,办公地址	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501		
法定代表人	刘汝军	联系人	孙恺
电话	（010）83561149	传真	（010）83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

(90)平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755)82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511-8

(91)东莞证券股份有限公司

住所,办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
法定代表人	张运勇	联系人	苏卓仁
电话	（0769）22112062	传真	（0769）22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	（0769）961130

(92)国都证券股份有限公司

住所,办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	（010）84183389	传真	(010)84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(93)东海证券股份有限公司

住所,办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

(94)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路88 号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼		
法定代表人	曾小普	联系人	俞驰
电话	（0791）86285337	传真	（0791）86282293
网址	www.gstock.com	客服电话	4008222111

(95)第一创业证券股份有限公司

住所,办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	（0755）25832852	传真	（0755）82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

(96)金元证券股份有限公司

住所	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
办公地址	深圳市深南大道4001号时代金融中心17层		
法定代表人	王作义	联系人	马贤清
电话	(0755)83025022	传真	(0755)83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(97)西部证券股份有限公司

住所,办公地址	陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼		
法定代表人	刘建武	联系人	梁采华
电话	(029)87416168	传真	(029)87406710
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

(98)华龙证券有限责任公司

住所,办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	（0931）4890208	传真	（0931）4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	（0931）96668、4006898888

(99)华鑫证券有限责任公司

住所,办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元		
法定代表人	洪家新	联系人	孔泉
电话	（0755）82083788	传真	（0755）82083408
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	（021）32109999、（029）68918888

(100)中山证券有限责任公司

住所,办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	（0755）82570586	传真	（0755）82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

(101)江海证券有限公司

住所,办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	刘爽
电话	0451-85863719	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

(102)长城国瑞证券有限公司

住所,办公地址	厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼		
法定代表人	王勇	联系人	卢金文
电话	（0592）5161642	传真	（0592）5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	（0592）5163588

(103)爱建证券有限责任公司

住所,办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼		
法定代表人	宫龙云	联系人	陈敏
电话	（021）32229888	传真	021-68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	（021）6334678

(104)天风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼		
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼		
法定代表人	余磊	联系人	崔成
电话	027-87610052	传真	027-87618863
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008005000

(105)杭州数米基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼		
注册地址	杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号		
法定代表人	陈柏青	联系人	张裕
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	http://www.fund123.cn/	客服电话	4000-766-123

(106)北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区望京SOHO塔2 B座2507		
注册地址	北京市朝阳区望京SOHO塔2 B座2507		
法定代表人	钟斐斐	联系人	袁永姣
电话	010-61840688	传真	010-61840699
网址	www.ncfjj.com	客服电话	4000-618-518

(107)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址	北京市西城区广安门外大街28号富卓大厦A座7层		
注册地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层 1006#		
法定代表人	张巍	联系人	文雯
电话	010-83363101	传真	010-83363072
网址	8.jrj.com.cn	客服电话	400-118-1166

(108)凤凰金信（银川）投资管理有限公司

办公地址	北京市朝阳区霄月路18号院 朝来高科技产业园18号楼		
注册地址	宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房		
法定代表人	程刚	联系人	张旭
电话	010-58160168	传真	010-58160173
网址	http://www.fengfd.com/	客服电话	400-810-55919

(109) 上海万得投资顾问有限公司

办公地址	上海市浦东新区福山路33号建工大厦8楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座		
法定代表人	王廷富	联系人	姜吉灵
电话	021-68882280	传真	021-68882281
网址	王廷富	客服电话	400-821-0203

(110)北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦		
注册地址	北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室		
法定代表人	李昭琛	联系人	付文红
电话	010-62676405	传真	010-62676582
网址	http://www.xincai.com/	客服电话	010-62675369

（二）基金注册登记机构

嘉实基金管理有限公司（同上）

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所,办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	（021）31358666	传真	（021）31358600
经办律师	吕红、黎明		

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼		
办公地址	上海卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	许康玮、张勇		

四、基金的名称

本基金名称：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型，以定期开放方式运作。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金投资于国内依法发行或上市的债券、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、国债、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金可持有因投资分离交易可转债而产生的权证，对因此持有的权证，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：除每个开放期的前3个月和后3个月以及开放期外，本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金追求本金安全的风险控制目标和收益稳定递增的产品运作风格，定期满足投资人的变现需求。

1、资产配置策略

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。

在具备足够多预期风险可控、收益率良好的投资标的时，本基金优先投资于剩余期限或回售期与封闭期剩余期限匹配的短期债券或银行存款等固定收益类资产，以持有到期策略为主，谋求稳定的本金和票息收入。本基金可根据所持固定收益类资产的信用状况变化，动态调整组合；可通过正回购，融资买入预期收益率高于回购成本的固定收益类投资工具，力求杠杆放大收益。

2、组合风险控制措施

“嘉实下行风险波动模型”，从组合层面以及个券层面分别度量组合潜在的下行风险，根据宏观环境以及证券市场表现，设置一定的阈值，将组合可能的下行波动控制在较小范围内。在组合层面，本基金使用下方波动率、CVaR（条件在险价值）等指标，结合情景分析和压力测试的方法，评价组合在未来一段时间发生下行波动的可能性及幅度。在个券层面，对债券等固定收益类资产，本基金将通过凸度分析法，将债券的凸度与宏观环境相联系，当预期未来进入加息通道、债券市场收益率水平持续上移时，本基金根据期限结构和类属配置目标，通过凸性分析选择波动特性最优的债券，从而降低组合可能面临的下行风险。

3、信用债券投资策略

本基金精选预期风险可控、收益率较高的信用债券，结合适度分散的行业配置策略，构造和优化组合，谋求为投资人创造较高的风险调整后回报。

（1）个别债券选择

本基金参考国内信用评级机构的评级，依据“嘉实信用分析系统”的研究成果，执行“嘉实投资备选库流程”，生成或更新买入信用债券备选库。

本基金主要从信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、信用评级、收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）、剩余期限、久期、凸性、流动性（发行总量、流通量、上市时间）等指标，结合组合管理层面的要求，决定是否将个债纳入组合及其投资数量。

（2）行业配置

宏观信用环境变化，影响同一发债人的违约概率，影响不同发债人间的违约相关度，影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率。影响不同信用等级发债人的违约概率。同时，不同行业对宏观经济的相关性差异显著，不同行业的潜在违约率差异显著。

本基金借助“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究平台，基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究，运用定性定量模型，在自下而上的个债精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

（3）利差套利策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益，可根据市场利率水平、收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期，调整回购放大的杠杆比例，控制杠杆放大的风险。

（4）信用风险控制措施

本基金实施谨慎的信用评估和市场分析、个债和行业层面的分散化投资策略，当发债企业的基本面情况出现恶化时，运用“尽早出售（first sale, best sale）”策略，控制投资风险。

本基金使用各信用级别持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要偿债指标范围等描述性统计指标，还运用VaR、Credit Metrics、Credit Portfolio Views等模型，估计组合在给定置信水平和事件期限内可能遭受的最大损失，以便有效评估和控制组合信用风险暴露。

（5）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

中小企业私募债收益率由基准收益率与信用利差叠加组成，信用风险表现在信用利差的变化上；信用利差主要受两方面影响，一是系统性信用风险，即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是非系统性信用风险，即该信用债本身的信用变化。

针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。因为经济周期的复苏初期通常是中小企业私募债表现的最佳阶段，而过热期通常是中小企业私募债表现的最差阶段。本基金运用深刻的基本面研究，力求前瞻性判断经济周期，在经济周期的复苏初期保持适当增加的中小企业私募债配置比例，在经济周期的过热期保持适当降低的中小企业私募债配置比例。

针对非系统性信用风险，本基金通过“嘉实信用分析系统”，分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。

针对流动性风险，本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债投资，主要采取分散投资，控制个债持有比例；主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售（first sale, best sale）”策略，控制投资风险。

4、其他债券投资策略

（1）久期调整策略

本基金根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

（2）期限结构调整策略

本基金通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，可适当调整长期、中期和短期债券的配置方式，以求适当降低机会成本风险和再投资风险，或从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

（3）互换策略

本基金可同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，利用不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面的差别，赚取收益率差。

（4）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，基金可获得较高的资本利得收入。

（5）流动性管理策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。

5、资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。本基金可根据市场发展，精选投资夹层工具，在控制风险的前提下谋求收益增强。

6、可转债投资策略

本基金将根据组合风险控制措施，纪律性地控制可转债总体投资仓位。在个债选择上，本基金将深入研究内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格），保护条款的适用范围、期权价值、基础股票的质地和成长性、流通性，发现投资价值，积极寻找各种套利机会，谋求在较高安全边际下获取增强收益。

7、权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证，但可持有因参与分离交易可转债一级市场申购而产生的权证。对所持有的权证，本基金将在其可交易之日起的30 个交易日内卖出。权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

8、投资决策

（1）决策依据

1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2）宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况。

3）分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

（2）决策程序

1）投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

2）相关研究部门或岗位根据嘉实中央研究平台、嘉实信用分析系统等流程规定，进行分析，提出分析报告。

3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。

5）监察稽核部负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准 = 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。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，经基金托管人同意，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2016年9月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,476,956,022.77	98.33
	其中：债券	1,476,956,022.77	98.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,453,132.77	0.36
8	其他资产	19,637,426.93	1.31
9	合计	1,502,046,582.47	100.00

2.报告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。

3.报告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。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,040,700.00	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,704,000.00	7.50
	其中：政策性金融债	81,704,000.00	7.50
4	企业债券	536,989,322.77	49.31
5	企业短期融资券	470,868,000.00	43.24
6	中期票据	386,354,000.00	35.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,476,956,022.77	135.62

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127429	G16京汽1	500,000	51,655,000.00	4.74
2	011698144	16珠海华发SCP005	500,000	50,045,000.00	4.60
3	041651036	16中煤能源CP001	500,000	50,025,000.00	4.59
4	011698262	16皖管投资SCP001	500,000	49,995,000.00	4.59
5	136607	16宁安01	500,000	49,870,000.00	4.58

6.报告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.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.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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

9.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。

10.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。

11.投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,141.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,622,285.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,637,426.93

(4)报告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。

(5)报告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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本报告期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	净值增长率①	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
自基金合同生效起至2013年12月31日	0.90%	0.05%	2.04%	0.01%	-1.14%	0.04%
2014年度	11.85%	0.14%	3.53%	0.01%	8.32%	0.13%
2015年度	10.71%	0.16%	2.65%	0.01%	8.06%	0.15%
2016年上半年	1.04%	0.08%	1.00%	0.01%	0.04%	0.07%
2016年1月1日至2016年9月30日	2.25%	0.07%	1.51%	0.01%	0.74%	0.06%

嘉实如意宝定期债券C

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至2013年12月31日	0.70%	0.05%	2.04%	0.01%	-1.34%	0.04%
2014年度	11.46%	0.14%	3.53%	0.01%	7.93%	0.13%
2015年度	10.24%	0.16%	2.65%	0.01%	7.59%	0.15%
2016年上半年	0.87%	0.08%	1.00%	0.01%	-0.13%	0.07%
2016年1月1日至2016年9月30日	1.91%	0.07%	1.51%	0.01%	0.40%	0.06%

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

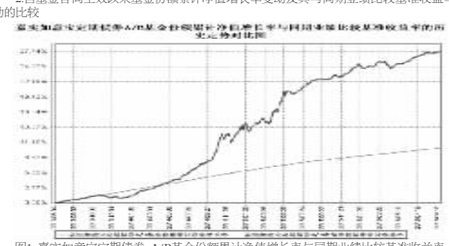

图1:嘉实如意宝定期债券 A/B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

（2013年6月4日至2016年9月30日）

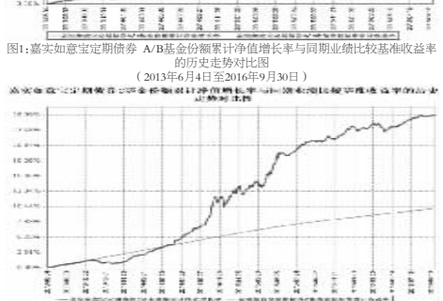

图2:嘉实如意宝定期债券 C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013年6月4日至2016年9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。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）销售服务费

（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）基金上市费和年费；

（10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初3个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初3个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

（3）销售服务费

本基金A类/B类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初3个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“1.基金费用的种类中第4－10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费率

（1）A类基金份额前端申购费率

当投资者申购A类基金份额时，本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户包括全国社会保障基金、地方社会保障基金（若法规允许）、企业年金单一计划及集合计划、企业年金养老金产品等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

直销中心养老金客户 A类基金份额申购金额（含申购费）	直销中心养老金客户 A类基金份额前端申购费率
M＜100万元	0.20%
100万元≤M＜300万元	0.12%
300万元≤M＜500万元	0.032%
M≥500万元	按笔收取,1000元/笔

其他投资者申购本基金A类基金份额申购费率见下表：

其他投资者 A类基金份额申购金额（含申购费）	其他投资者 A类基金份额前端申购费率
M＜100万元	0.50%
100万元≤M＜300万元	0.30%
300万元≤M＜500万元	0.08%
M≥500万元	按笔收取,1000元/笔

（2）B类基金份额后端申购费率　B类基金份额，仅限嘉实基金网上直销销售，申购费率如下：

B类基金份额持有期限（H）	B类基金份额后端申购费率
H＜365天	0.20%
365天≤H＜1095天	0.10%
H≥1095天	0

（3）C类基金份额申购费率

C类基金份额申购费率为零。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购开放式基金业务，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠过程按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购开放式基金业务，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

本基金的申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费率

本基金A类/B类/C类基金份额赎回费率最高不超过赎回金额的5%。赎回费率见下表：

A类/B类/C类基金份额赎回费率

持有时间	赎回费率
不足30天	0.1%
满30天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对于所收取的A类、B类、C类基金份额赎回费，基金管理人将其总额的100%计入基金财产。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基