



2009—2013

嘉实基金

企业公民报告

Harvest Fund
Corporate
Citizenship Report

115

2009—2013

嘉实基金

企业公民报告

Harvest Fund
Corporate
Citizenship Report

报告编写说明

报告概述：

本报告反映了嘉实基金从2009至2013年所开展的社会责任实践。报告内容基于嘉实基金的社会责任观，重点说明了嘉实基金在投资者回报、员工成长、社区回馈、环境保护等方面所开展的工作及取得的成效。

报告组织范围：

本报告覆盖嘉实基金管理有限公司及下属公司，为便于表达，在报告中分别使用“嘉实基金管理有限公司”、“嘉实基金”、“嘉实”、“我们”等称谓。

编写依据：

本报告编写参考全球报告倡议组织《可持续发展报告指南》（2013年修订版，简称G4.0标准）。

时间范围：

本报告的时间跨度为2009年1月1日至2013年12月31日。

数据来源与说明：

除特殊说明外，本报告引用的数据均来自公司的正式文件、内部刊物及相关统计，使用的货币单位均为人民币（元）。嘉实基金保证相关数据的真实性、客观性。

获取方式：

为了保护环境，我们推荐您阅读PDF格式的电子版报告。

您可以通过访问嘉实基金官方网站（<http://www.jsfund.cn>）下载获取。

若您需要纸质报告，请联系：

地址：北京市建国门北大街8号华润大厦16层

邮编：100005

电话：010—65215588

目录

总经理致辞	03
关于嘉实	04
数字·嘉实	
风险控制	
反洗钱	
企业公民@嘉实	07
重要议题	
利益相关方	
荣誉·嘉实	
服务投资者：回报信任	11
专业创造价值	
服务提升价值	
关怀员工：助力成长	17
薪酬福利	
职业发展	
工作平衡	
回馈社会：践行公益	20
提供更优质的教育	
建造更舒适的校舍	
灾害救助	
员工在行动	
保护环境：绿色办公	24
电子对账单	
绿色办公	

总经理致辞

远见者稳进

金融市场瞬息万变。我们坚信，唯有超越眼前所见，洞悉未来趋势，才能真正获得长远而持续的财富增值。十五年来，投资策略上的远见让我们坚守“以研究支持决策”的朴素理念，凭借科学理性的投资运作给投资者带来了丰厚的回报。远见还意味着我们要用未来的眼光去审视企业运营，用更为深刻的责任理念去统领企业发展，不仅关注投资者，还关注员工、行业、社会等利益相关方的责任履行，构建和谐共赢的关系，持续贡献于国家与社会的发展，并最终实现企业的可持续发展。



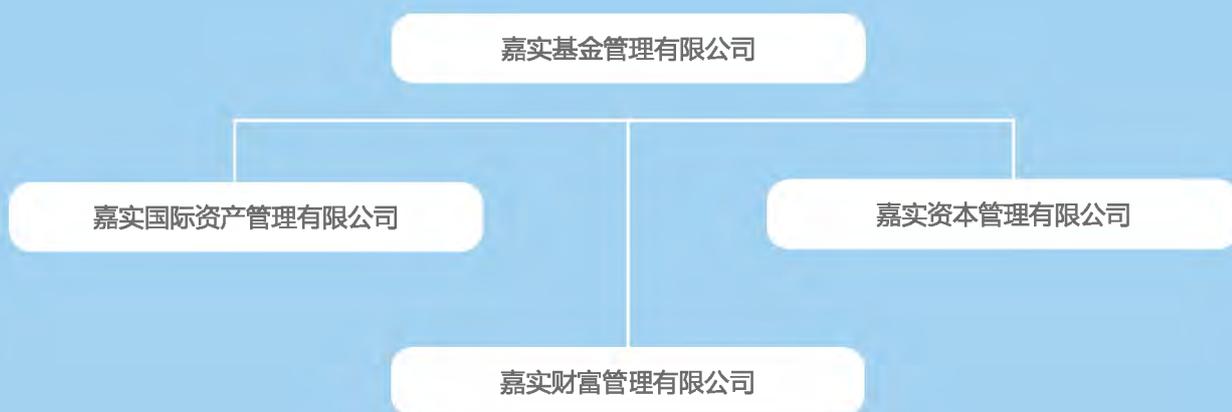
作为一家资产管理公司，我们不仅关注财富的增长，同样关注增长的财富如何惠及整个国家和社会。同时，我们深刻意识到，公益行为不是责任感召下的一时冲动，需要投入理性的思考、系统的规划，并持之以恒。2009年，我们发布了公司的第一份社会责任报告《嘉实基金企业公民报告（1999-2009）》，系统回顾嘉实成立以来十年的社会责任实践。在此基础上，我们逐步发展构建起了嘉实特有的公益体系，以教育支持和灾害救助为主线，以公司、员工、投资者为主体，与专业的基金会等合作伙伴一起持续、系统地开展公益活动，以投资管理的远见审慎和责任担当，助力和谐社会。

十五年，从20亿管理资产规模、30位员工，到3200亿管理资产规模、500位员工，嘉实的发展深刻诠释着“远见者稳进”。十五年，新的起点，意味着更大的责任。我们将继续稳健前行。

A handwritten signature in black ink, appearing to be the name of the General Manager, written in a cursive style.

“关于嘉实”

嘉实基金于1999年3月经中国证监会批准成立，并于2005年6月成为合资基金管理公司，是国内最早成立的十家基金公司之一。拥有证券投资基金设立与管理、全国社保基金投资管理、企业年金投资管理、境外证券投资管理和特定客户资产管理等业务资格。

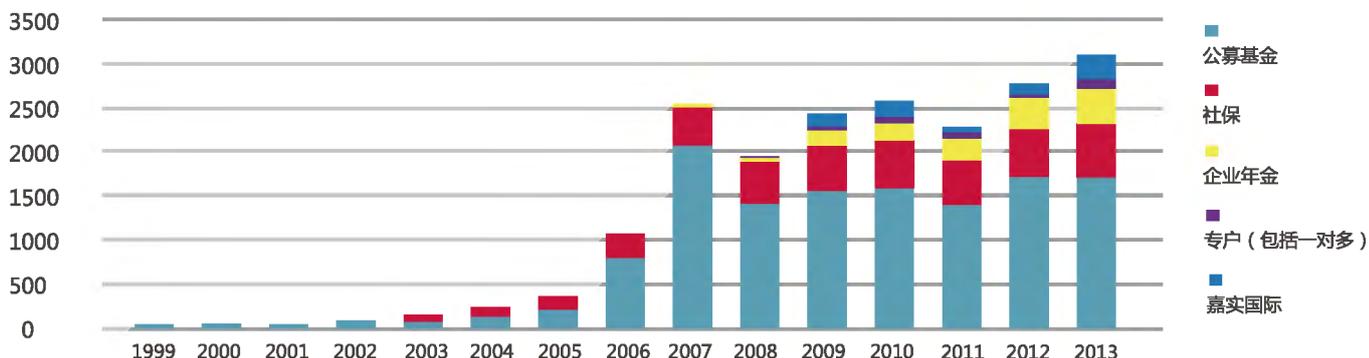


2008年8月，公司获准在香港设立全资子公司——嘉实国际资产管理有限公司，开启了国际化进程。2012年3月，公司在上海注册成立嘉实财富管理有限公司，开始启动在财富管理方面的业务拓展。2012年11月，公司经证监会核准设立全资子公司嘉实资本管理有限公司，业务范围为特定客户资产管理业务以及证监会许可的其他业务。

嘉实相信，“远见者稳进”。凭借合规务实的管理风格、科学理性的投资运作，公司保持着持续卓越的业绩。截至2013年12月31日，嘉实的资产管理规模近3200亿元，其中公募基金资产规模为1905亿元，居行业第二。同时，随着公司国际化平台的不断完善，嘉实已跻身全球200强资产管理公司行列。

数字嘉实

3200亿 资产管理规模近3200亿元



公募基金	社保基金	企业年金	专户 (一对多)
56只公募基金产品 1905亿公募基金资产规模 8个分公司, 12个区域 13个分支机构 120个代销商 (银行、券商) 累计1200多万个人投资者	首批社保基金管理人资格 7个社保组合 605.61亿元管理资产规模	首批企业年金管理人 126个企业年金账户 372.30亿元管理规模 为超过800万职工提供 企业年金服务	152亿元管理规模

区域分布图



风险控制

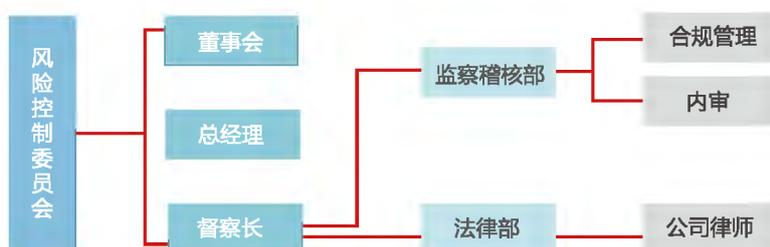
严格的风险控制、审慎的运营管理是公司可持续发展的关键，也是投资者利益的有效保障。嘉实以“内控前置”为理念，采用先进的风险管理架构和工具，在“制度上控制风险、技术上量化风险”。

先进的风险管理架构与工具

风险类型	风险类型			合规及操作风险	
	市场风险	信用风险	流动性风险	操作风险	合规及法律风险
风控系统及工具	嘉实风险控制与绩效考评系统 Barra Aegls 风险控制系统 JSIA系统 交易前的风险试算系统 Bloomberg系统			法律法规、业务制度和流程 监察稽核手册 风险控制自我评估 风险控制系统（恒生及JSIA） 内审政策和程序	
风险管理四道防线	董事会下属委员会及公司风险控制委员会				
	督察长、法律稽核和风险管理部				
	部门一线互控				
	岗位自控				

公司设立风险控制委员会，建立独立的内控体系和报告路径，识别、评估主要业务风险，划分风险责任单元，明确不同岗位和环节的操作流程，实施每日差错上报制度，形成权责对称、层层落实、奖惩分明的内控文化。公司已经获得ISAE3402（原SAS70）和GIPS国际认证，成立以来无任何处罚记录。

独立的内控体系和报告路径



反洗钱

为确保合规经营，嘉实建立了反洗钱工作管理办法、客户风险管理流程、可疑交易报告流程等专项制度，并成立反洗钱工作领导小组，统筹相关工作。领导小组组长由公司督察长担任，小组成员包括销售、注册登记、客户服务、信息技术、法律稽核等反洗钱相关部门负责人。此外，各相关部门均配备专职或兼职的反洗钱工作岗位。

“企业公民@嘉实”

作为一家资产管理公司，嘉实秉承“履行责任，构建和谐，持续贡献”的社会责任理念，致力于与利益相关方和谐共生，以持续贡献为指向，整合资源，不仅贡献财富，更要贡献智慧，以核心能力为载体实现责任的持续履行。

2009年，嘉实成立企业公民委员会，专职推进企业社会责任工作。委员会由各业务板块负责人组成，副总经理主管，每年召开两次会议，制定并执行年度社会责任规划。

重要议题

1、服务投资者

作为一家资产管理公司，嘉实肩负着千万投资者的信任和期许。我们希望凭借科学的投资理念、专业的投资研究为投资者带来稳定良好的投资回报。

2、关怀员工

嘉实的员工是来自不同教育背景的优秀人才。他们专业、高效的工作成就了今天的嘉实。让员工在良好的工作环境中实现自我发展，是嘉实的责任所在。

3、回馈社区

嘉实不仅关注个人财富的增长，更关注整个社会的福祉。我们致力于贫困地区的教育提升，积极投身灾害救助，并且鼓励每一位投资者、员工与嘉实一起践行公益。

4、保护环境

绿色办公、节能减排是嘉实长期履行的环境承诺。我们鼓励投资者使用电子账单，制定并严格遵守绿色办公制度。

利益相关方

利益相关方	对公司的期望
政府	合规经营，行业发展
股东	有效治理，可靠内控，持续发展
投资者	良好的投资回报，优质的服务体验
员工	薪酬福利，职业发展
社区	社区建设，社会发展
环境	节能减排，绿色办公

荣誉·嘉实

2013年4月

《上海证券报》第十届中国“金基金奖”：“金基金十年·卓越公司”、“2012年度金基金·TOP公司”

2013年3月

《中国证券报》第十届中国基金业金牛奖：“金牛基金管理公司”、“被动投资金牛基金公司”

《证券时报》2012年度中国基金业明星奖：“五年持续回报明星基金公司”

2012年7月

2011-2012中国最佳客户服务评选：“中国最佳客户服务”

2012年4月

《上海证券报》第九届中国“金基金奖”：“2011年度金基金·TOP公司”

2012年3月

《中国证券报》第九届中国基金业金牛奖：“金牛基金管理公司”、“被动投资金牛基金公司”

《证券时报》2011年度中国基金业明星奖：“2011年度10大明星基金公司”

2011年4月

《中国证券报》第八届中国基金业金牛奖：“金牛基金管理公司”

《上海证券报》第八届中国“金基金奖”：“2010年度金基金·TOP公司大奖”

《证券时报》第七届中国基金业明星奖：十大明星基金公司



2010年6月

《上海证券报》第七届中国“金基金奖”：“金基金·创新公司”

2010年5月

《中国证券报》第七届中国基金业金牛奖：“金牛特别贡献奖”、“金牛创新奖”、“被动投资金牛基金公司”

2010年1月

和讯网第七届中国财经风云榜：“2009年度十大品牌基金公司”、“2009年度最佳电子商务基金公司”、“2009年度产品创新”

《华夏时报》第三届中国机构投资者年会暨金蝉奖：“年度最佳稳健投资基金公司”

2009年2月

全国银行间同业拆借中心：“2008年全国银行间市场优秀交易成员”

2009年1月

和讯网第六届中国财经风云榜：“2008年度品牌基金公司”、“2008年最佳投资者关系基金公司”、“2008年最佳基金网上交易平台”

《中国证券报》第七届中国基金业金牛奖：“2008年度金牛基金管理公司”



“ 服务投资者：回报信任 ”

3200亿资产管理规模
累计1200多万名投资者
公募基金累计分红511亿余元

基金名称	2013年底（三年）	2013年底（五年）	2013年底（十年）
嘉实服务增值行业		★★★★★	
嘉实研究精选	★★★★★	★★★★★	
嘉实增长		★★★★★	★★★★★

作为一家资产管理公司，为投资者提供良好、稳定的回报是我们的初衷，也是始终追求的目标。我们用心力求卓越的服务，以建基于科学投资理念的专业资产管理，为投资者创造价值。

科学的投资理念

在跌宕起伏的市场环境中，科学的投资理念是通向投资成功之路的基石。十五年来，嘉实坚守“以研究支持决策”的朴素理念，采取深入的基本面研究与数量研究相结合的策略，通过对宏观策略、行业和公司等全方位精细研究，洞悉财富价值，为实现客户资产的长期稳定增值提供最有价值的决策依据。



核心研究能力是投研体系的中心资源，体现在行业研究、宏观策略、交易、信用研究、风险控制等方面。各投资策略小组均从中心资源处获取研究支持。

领先的投资团队

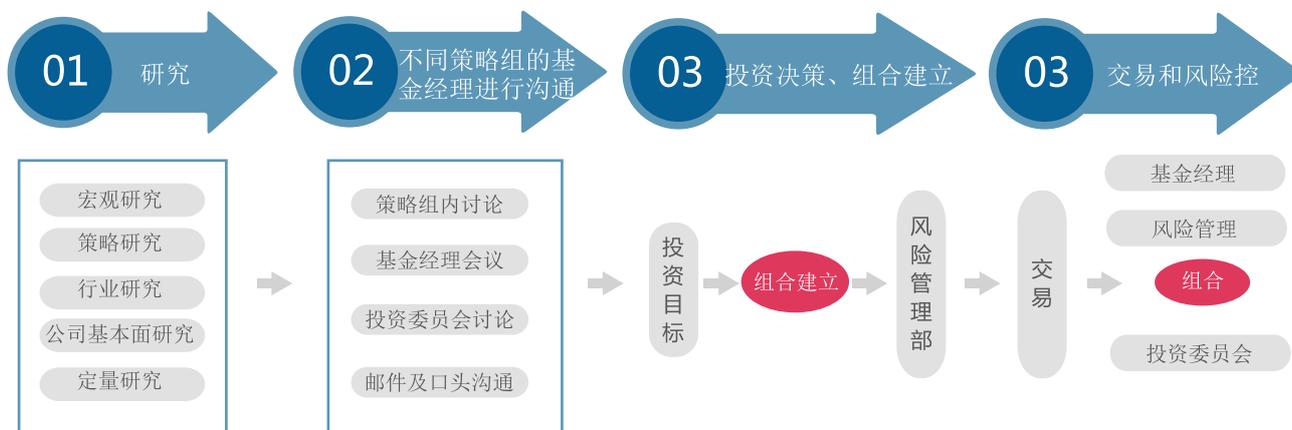
专业的团队是嘉实为客户创造价值的关键。经过十五年的发展和累积，嘉实已建立起一支130余名专业人员组成的优秀投资研究团队。

嘉实基金投资团队由11个部门组成，包括多元化的投资小组以及由研究、交易、风险管理、宏观策略等小组共同构成的强大支持平台。团队由投资研究工作管理委员会领导。

周密的投资流程

通过高效的团队协作将研究、决策、交易以及风险控制各环节紧密衔接，周密的投资流程为嘉实取得长期、稳定的优良业绩提供了可靠保证。

嘉实股票投资流程



优异的投资业绩

专业能力带来的是优异的投资业绩。嘉实最近3年业绩排名在同期可比的60家基金公司中位居第二，在前十大基金公司排名第一。其中，嘉实优质、嘉实增长及嘉实泰和等三只基金在各自分类中摘得业绩冠军。

嘉实基金部分产品业绩情况

证券简称	基金成立日	成立以来累计收益率	晨星评级 (三年)	晨星评级 (五年)	晨星评级 (十年)
嘉实债券	2003/07/09	107.25%	★★★	★★★	★★★★★
嘉实服务增值行业	2004/04/01	426.43%	★★★★★	★★★★★	
嘉实主题精选	2006/07/21	176.63%	★★	★★★★★	
嘉实研究精选	2008/05/27	133.03%	★★★★★	★★★★★	
嘉实沪深300ETF联接	2005/08/29	139.68%	★★	★★	
嘉实成长收益	2002/11/05	462.49%	★★★★★	★★★★★	★★★★★
嘉实增长	2003/07/09	609.26%	★★★	★★★★★	★★★★★
嘉实稳健	2003/07/09	211.80%	★★★	★★	★★

优异的投资业绩为我们的客户带来了良好的回报。截止2013年12月31日，51只公募基金，累计分红511亿余元。

专题：投资者回报研究中心

中国开放式基金的发展已经走过了十年的历程，行业整体表现大幅度超越股票和债券市场指数。但许多投资者并未在行业的增长中获得回报。2012年5月，嘉实成立“投资者回报研究中心”（简称回报中心），旨在帮助投资人从容应对市场波动，实现长期投资与中短期投资的协同，获取实实在在的投资回报。

嘉实FAS系统

基于对宏观经济的解读和金融市场的理解，借助于最前端的经济理论和数学模型，回报中心开发出从市场预测、资产配置到基金选择的投资决策系统“Forecast + Allocation + Selection”（简称嘉实FAS系统）。嘉实FAS系统把基金投资过程划分为预测市场，配置资产和选择基金三个步骤，分别用FAS预测、FAS-RR优化和FAS定基金进行综合判断，得出市场走势、资产配置和基金选择的最终结果。

嘉实FAS系统

我们的目标：正收益，超越中证开放式基金指数

内容包括
三个部分

01 最新市场预测
给出股票和债券市场
在未来6个月走势的
预测结果

02 当期资产配置：
依据市场预测结果对
股票和债券资产配置
比例做出相应调整

03 基金组合建议：
决定最终的两组基金投资组合
及配置比例：“嘉实旗下基金
组合”和“全市场基金组合”

从2012年5月开始，回报中心正式对外发布嘉实FAS系统研究成果，包括对未来六个月市场的预测、资产配置和基金组合建议，研究成果每季发布一次。截至2013年底，已正式发布五次，共计发布十二个基金组合建议，其中九个组合战胜比较基准（中证基金指数），且风险远低于中证基金指数。

嘉实定制账户

2012年12月，经中国证监会特批，嘉实正式启动定制账户业务，由回报中心负责管理。定制账户的核心是以每个投资者（机构或个人）的账户为服务单位，通过授权协议由专业管理机构为其管理投资账户，以提供个性化一站式财富管理服务。2013年12月，嘉实定制账户首年收官，投资人账户正收益比例超过98%。



投资者教育

金融市场中收益与风险并存。理性的投资理念是投资者获取回报的重要前提。嘉实基金自成立以来，一直致力于投资者教育，帮助投资者理性看待收益与风险。

公司充分利用官网、杂志、电子邮件及现场活动等渠道进行投资者教育。除大众版及高端版服务手册、嘉实理财指南、嘉实定投等印刷品外，公司还通过“嘉实基金大讲堂”与“嘉实尊享理财沙龙”两大品牌活动，为投资者普及理财知识和科学的投资理念。

2013年，公司在投资者教育方面投入56万元，开展40场活动，覆盖500万投资者。



多渠道沟通

嘉实为投资者提供多种沟通渠道。400-600-8800服务热线提供24小时自助语音查询服务及工作日8:30至21:00的人工服务。此外，投资者可以通过嘉实基金主页的“在线客服”或以Email的形式与公司联系。同时，嘉实还为投资者准备了新鲜资讯，推出手机短信、Email形式的对账单，并通过微博、微信、易信、手机终端等多种形式与投资者沟通。





嘉实用心提供的服务赢得了投资者的认同。公司每年会邀请客户对各项服务（包括电话、短信、邮件、账单、客户活动等）进行综合评价，总分为5分。历年来，嘉实的客户满意度平均在4.6分以上，并呈现提高趋势。2013年的客户满意度为4.83。

“关怀员工：助力成长”

员工职业能力公开课：65人次+E-learning

新员工培训：198人次

外派培训：30人次

培训投入：约95万元

员工是嘉实的核心资产。经过十五年沉淀，嘉实已经拥有一支专业、稳定、国际化、多元化的员工队伍。截至2013年底，嘉实共有701位员工。我们致力于为员工提供一个良好的工作环境，帮助每位员工实现个人发展。

薪酬福利

嘉实为员工提供有行业竞争力的薪酬福利，以及完善的社会保障。公司严格遵守国家劳动法律法规，与每位员工签订劳动合同，提供“五险一金”。此外，为员工提供企业补充养老保险，为员工及其子女提供商业医疗、意外保险和劳动保护产品。同时，公司还提供父母慰问金，三八节、六一节慰问金，端午节、中秋节、元宵节食品，以及电影卡、洗衣卡等额外福利。

职业发展

嘉实建立起了包括新人培训、基金销售培训、投研培训、管理培训在内的完整培训体系，为员工提供多种学习及能力提升的机会，帮助员工获取更好的职业发展。

海外培训

公司每年选派业务部门员工赴海外考察学习，开拓视野、吸纳国际先进的投资及管理经验。同时，通过DeAM-Harvest全球人才交流项目，选派员工赴海外工作交流1-6个月。

新人全球化培训

入职嘉实的新人经过严格的考试及筛选后，有机会参加外方股东提供的全球新人入职培训，系统提升投资业务能力、国际化沟通能力，与全球金融同行在同一起跑线上开启自己的职业生涯。



内部分享平台

嘉实鼓励员工积极分享业务知识及创新观点，打造学习型组织。2013年11月，嘉实正式启动内部业务分享平台，并成功举办了第一次主题活动——宏观形势分析及宏观研究方法探讨，6个会场约140名员工参与与分享。



工作平衡

瞬息万变的金融市场给基金从业人员带来巨大的工作压力。嘉实力求创造良好的公司氛围，努力平衡员工的工作和生活，让员工在愉悦的工作氛围中实现个人发展。

嘉实工会每年投入300多万元，为员工建立足球、篮球、网球、羽毛球、健身、摄影等俱乐部，员工可根据个人兴趣选择加入。同时，公司定期组织员工运动会、员工旅游及团队建设活动，工作之余放松身心。



“回馈社区：践行公益”

嘉实不仅关注财富的增长，更关注增长的财富如何惠及整个社会的福祉。为此，长期以来，我们一直积极践行公益，与投资者、行业伙伴和员工携手，回馈社区。同时，我们认为，公益行为不是责任感召下的一时冲动，需要投入理性的思考、系统的规划，并持之以恒。

提供更优质的教育

嘉实致力于为贫困地区的孩子提供更优质的教育，促进教育公平。我们与西部阳光农村发展基金会开展战略合作，支持贫困地区的教育发展。2009年，嘉实捐赠16万元支持甘肃省陇南市宕昌县的教师培训项目。项目采取“引入式实地培训模式”，10位来自山东的优秀教师赴宕昌开展为期15天的实地培训，200名农村教师从中受益。

“嘉实基金的认真态度让人敬佩。他们的工作人员与学员聊天了解他们的工作生活情况，与志愿者们交流，记录他们的内心感受，他们还亲自前往一个比较落后的学区考察了解当地的教育、生活状况。”

——摘自2009教师培训志愿者工作心得

专题：支持西部阳光县域基础教育提升

2010年，嘉实开始支持西部阳光在甘肃省陇南市成县开展县域基础教育提升项目。项目针对英语教师、代课教师、家长、教育主管部门负责人，开展了一系列培训，包括跨越式教学实验、读书活动推广、“差班”教育方法培训、艺术活动课程推广、乡土课程资源开发等内容。累计投入298.7万元。

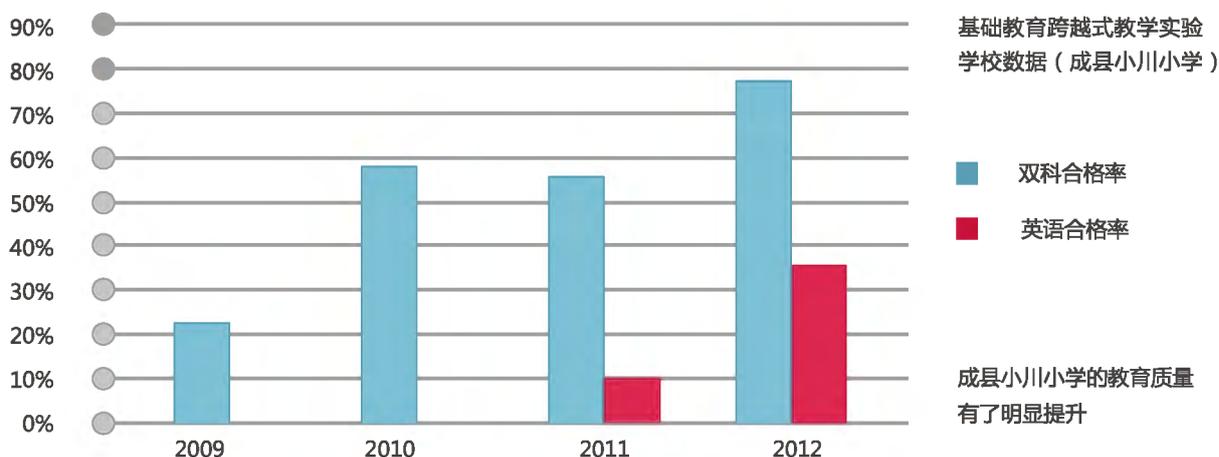
2010年，370位教师参加语文、数学等基础学科培训；50名乡镇和农村的中小学校长先后参加两期校长培训。

2011年，117名中小学英语教师参加口语、教材培训；58位教师参加复式教学培训；50名校长参加第三期校长培训。

2012年，77名音体美教师参加业务素质培训；128名英语教师参加培训。

2012年，为当地10所小学配置图书角，配备图书2000册；为当地3所学校配备体育运动器材600余件。

2013年，260名中小学教师参加班主任工作坊。



建造更舒适的校舍

嘉实希望所有的孩子都能在安全、整洁的校舍中学习、成长。2010年，由“嘉实守护天使基金”捐建的“嘉实石龙博爱小学”在雅安石龙落成。嘉实的股东德意志资产管理有限公司向学校捐助1万欧元，用于购买教学用具。2011年，嘉实捐赠80万元，用于改善青海省海南藏族自治州共和县切吉乡民族寄宿制小学、倒淌河镇民族寄宿制小学的教学楼。



专题：井冈山公益行

2009年，嘉实捐赠150万元用于建设井冈山实验中学科技楼，846名学生、61名教师的教学环境得到改善。2010年，10位投资者与嘉实一起出席教学楼落成仪式，与当地师生一起开展主题班会、分享励志故事。

2010年的初冬，我和其他10位同伴代表850万嘉实基金的投资者参加了井冈山实验中学嘉实科技楼的落成典礼。看着漂亮的科技楼和孩子们欢乐的笑脸，我深切地感悟到给予社会回报的快乐。这次公益之旅是一次心灵的愉快旅行。

——嘉实投资者：杜应吉

灾害救助

2009年，嘉实和员工为汶川地震灾区捐款189万元。

2010年，西南地区遭遇严重旱灾，嘉实与当地代销银行合作，为云南、贵州、四川的六所小学提供饮用水、大米、学习用品等物资支持，共计20万元。

2010年，甘肃舟曲发生泥石流，嘉实紧急采购药品、雨具、毛巾、手电、牛奶、饼干、妇女用品等救灾物资（共计20万元），发往灾区。

2011年，嘉实和青海省红十字会合作开展“救护关爱生命—玉树行”行动，面向当地援建工程人员、中小学师生及部分农户，印制藏汉双语救护培训教材，发放医疗急救包，开展救护师培训。

2012年玉树地震后，我们及时了解到家庭困难的受灾教师群体需求，将员工捐赠10万元购买的“吉祥八宝”（包括手电、水杯、围巾等日用品，以及慰问信、励志书籍等慰问品），送到灾区教师手中。



员工在行动

嘉实的每位员工都是公司企业社会责任的践行者。

2010年，“爱之嘉”员工公益社团成立，为员工提供了参与公益的平台。社团成立之后，将天使妈妈基金设立的天使之家孤儿寄养点作为公益活动基地，员工志愿者利用周末时间到天使之家照看孤残儿童，并定期组织募捐，协助策划宣传。

2010年，员工捐款16万余元用于玉树地区的藏族志愿者项目。藏族志愿者具有明显的文化及语言优势，项目最终选拔了12名藏族志愿者在藏区进行为期一年的教学和震后支持工作。



“保护环境：绿色办公”

自然是我们赖以生存的环境基础。作为一个企业公民，嘉实致力于削减自身运营给环境带来的影响。为此，我们向客户推广电子对账单，在公司内部倡导绿色办公。

电子对账单

纸质基金对账单每年要消耗大量木材。嘉实是国内最早开展电子对账单服务的基金公司之一。早在2006年，我们就发起“取消对账单，资助乡村教师”活动，开创性地将环保与公益相结合，得到投资者的热烈响应。

目前，嘉实基金有效持有人（对账日基金份额大于0的持有人）中，已有163万人选择电子对账单服务。

绿色办公

嘉实绿色办公制度（摘自内刊）

- 电子化办公，减少办公用纸
- 除公文外的文件均采用双面打印
- 废弃打印纸统一回收进行再次利用
- 下班关闭饮水机、充电器、打印机、电灯等一切用电器的电源
- 天气晴朗时使用自然采光
- 会议结束后立即关闭电子设施

我们积极倡导绿色办公，通过公司内刊，将绿色办公的理念传递给每一位员工。

此外，我们还鼓励员工使用公共交通出行、减少碳排放，对公共交通出行给予一定补助。如遇公司集体会议，涉及异地人员参会，首选电话会议或视频会议的方式。



嘉实基金管理有限公司

地址：北京市建国门北大街8号华润大厦16层

邮编：100005

电话：010—65215588



本报告采用环保纸印刷