

# 嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

## 2014 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 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	嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实丰益策略定期债券
基金主代码	000183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 30 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

报告期末基金份额总额	88,623,514.25 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争当期总回报最大化，以谋求长期保值增值。
投资策略	本基金通过研究经济运行趋势，深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，结合中长期利率走势、各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等方面因素，自上而下地决定债券组合久期，对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。在规避基金组合风险的同时进一步增强基金组合收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率 + 0.5%
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。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	汤嵩彦
	联系电话	(010) 65215588	95559
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-600-8800	95559
传真		(010) 65182266	021-62701216

## 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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	2014 年	2013 年 7 月 30 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	39,212,995.45	11,665,134.91
本期利润	45,898,218.31	6,697,462.51
加权平均基金份额本期利润	0.0934	0.0098
本期加权平均净值利润率	9.01%	0.98%
本期基金份额净值增长率	11.43%	1.00%

3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	10,687,985.30	3,964,951.37
期末可供分配基金份额利润	0.1206	0.0058
期末基金资产净值	99,311,499.55	687,174,746.99
期末基金份额净值	1.121	1.006
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	12.55%	1.00%

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) 上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	3.89%	0.32%	0.86%	0.01%	3.03%	0.31%
过去六个月	6.86%	0.23%	1.75%	0.01%	5.11%	0.22%
过去一年	11.43%	0.18%	3.53%	0.01%	7.90%	0.17%
自基金合同生效起至今	12.55%	0.15%	5.08%	0.01%	7.47%	0.14%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.5%

上述“一年期银行定期存款收益率”是指当期封闭期的第1个工作日中国人民银行公布并执行的一年期“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：

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

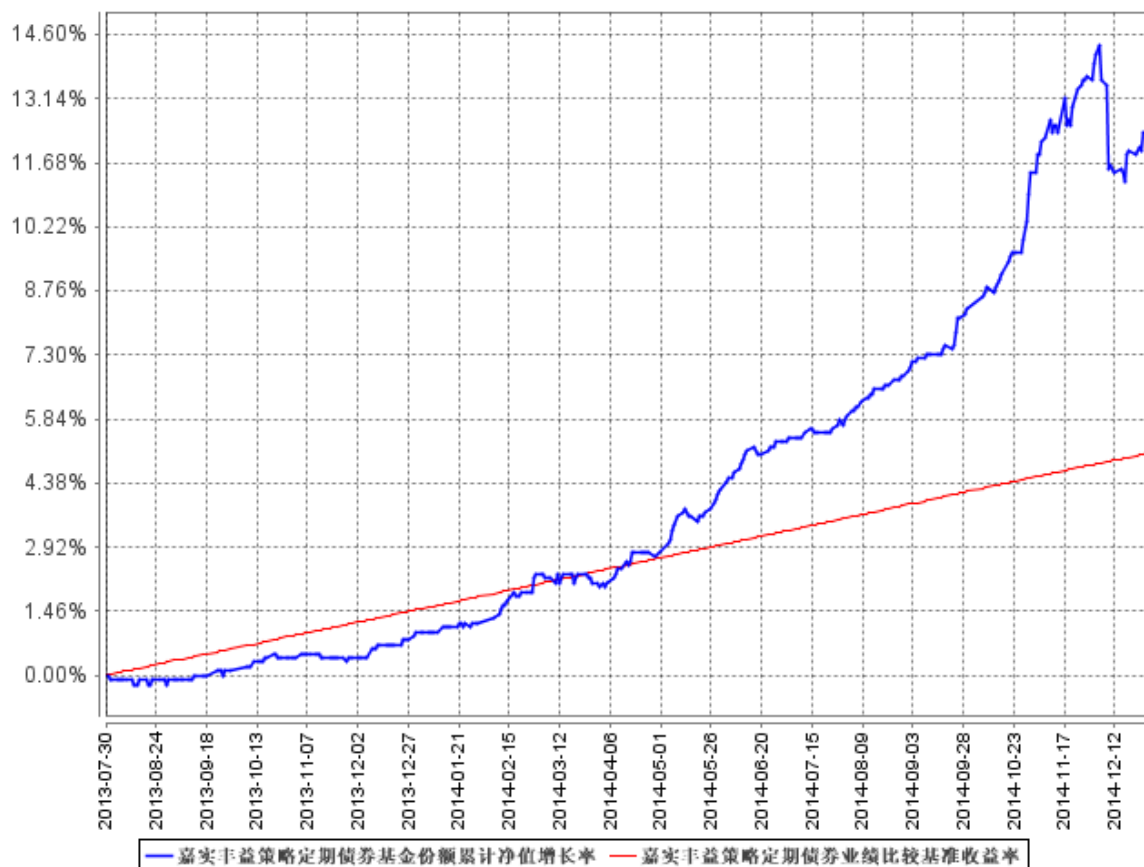
$$\text{Return}(t)=100\% \times (\text{一年期定期存款税后收益率} + 0.5\%) / 365$$

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

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

#### 嘉实丰益策略定期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：嘉实丰益策略定期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

(2013 年 7 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日)

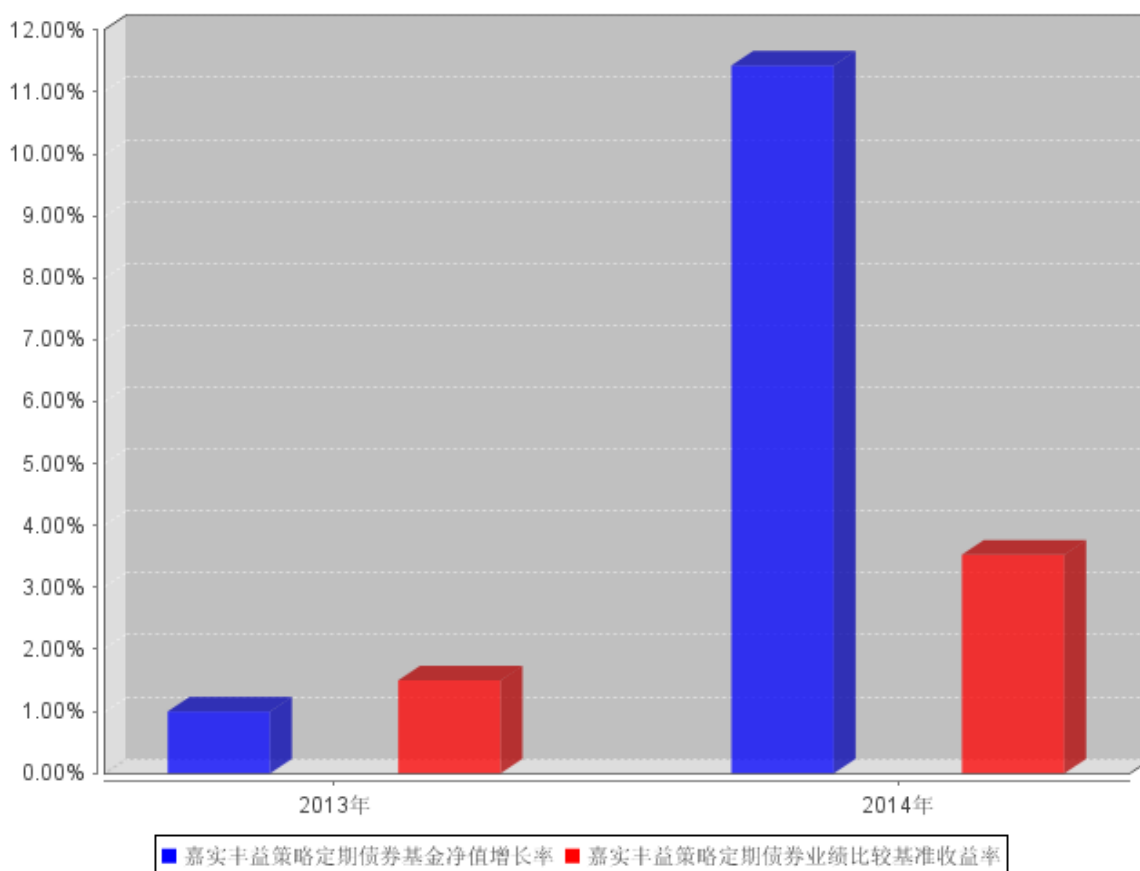
注 1：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和（四）投资限制”的有关约定。

注 2：2014 年 3 月 28 日，本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期债券基金经理变更的公告》，聘请胡永青先生担任本基金基金经理职务，与基金经理刘宁女士、万晓西先生共同管理本基金。

注 3：2014 年 9 月 19 日，本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期债券基金经理变更的公告》，万晓西先生、刘宁女士不再担任本基金基金经理。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

嘉实丰益策略定期债券自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 7 月 30 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 7 月 30 日至 2013 年 12 月 31 日）计算。

### 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
2014	-	-	-	-	
2013	0.0400	2,671,488.45	61,084.26	2,732,572.71	
合计	0.0400	2,671,488.45	61,084.26	2,732,572.71	

## § 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。公司注册地在上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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 2014 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、66 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和封闭、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 300 指数 (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。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		
胡永青	本基金、嘉实增强收益定期债券、嘉实信用债券、嘉实元和基金经理	2014年3月28日	-	11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。
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实如意宝定期债券、嘉实丰益信用定期债券基金经理	2013年7月30日	2014年9月19日	10年	经济学硕士，2004年5月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005年开始从事投资相关工作，先后担任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。
万晓西	本基金、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实3个月理财债券基金经理，公司现金管理部总监	2013年9月4日	2014年9月19日	14年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理，2013年2月加入嘉实基金管理有限公司，现任现金管理部总监。经济学硕士，中国国籍。

注：（1）基金经理刘宁的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理万晓西、胡永青的任职日期是指公司作出决定后公告之日，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、《嘉实丰益策略定期开放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 7 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

2014 年经济回顾：经济总体运行呈现出前高后低的走势，全年 7.4% 的 GDP 增速体现了经济持续低迷的状况。其中，从结构来看主要的拖累来自于固定资产投资的持续下滑，2014 年初城镇固定资产投资增速为 17.9%，而年末就已经回落至 15.7%。从行业角度来看，地产投资的大幅下滑是经济的主要拖累因素，2014 年初地产投资增速高达 19.3%，而年末该增速就已经大幅回落至 10.5%。

1 季度外汇占款增加，央行重启了正回购，但数量有限，市场流动性持续宽松；2-4 季度央行则公开市场通过回购缩量、国库现金招标、央票到期等方式净投放资金，正回购利率也逐步下行，并且间接引导银行间市场回购开盘利率，进行利率走廊管理。14 年央行对市场资金面调控手段更具针对性和灵活性，期间两次定向下调存款准备金率，通过 SLO、MLF、PSL 等工具释放流动性，增加银行存款偏离度季末考核，稳定市场对资金面预期，切实增强金融对实体经济的支持。

在经济走势持续低迷，货币政策逐渐宽松的推动下，债券市场整体收益率出现大幅度下行。以 10 年国债收益率来看，全年下降大约 100 个 BP。同时，不同等级的信用利差也出现了真正意义上的分化走势，低等级信用利差持续维持历史高位，而高等级信用利差回落至历史偏低水平。

上半年，本基金维持较高组合仓位，增持中高等级信用债，低配可转债，取得了稳定的净值增长，但出于绝对收益的考虑组合久期较短，收益相对有限；下半年，持仓以信用债为底仓为主，三季度少量增持了可转债的投资，分享了股债双涨的行情成果。

### 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 1.121 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.43%，业绩比较基准收益率为 3.53%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济整体下滑态势将短期难以扭转，伴随着明年政府经济增速目标的下调，改革有望在低位稳定的经济环境中成为市场运行的主基调，部分领域如财税、土地等深层次改革的破冰将会起步，我们有望看到企业经营效率的提升，改变规模扩张的粗放经营模式，从而降低无效

的资金损耗，带来长期无风险收益率的下行；但本届政府选择何种路径来实现经济层面的改革，是“刮骨疗毒”还是“扬汤止沸”，还有待观察，不同的路径可能会带来对利率曲线的不同影响。

债券市场整体而言，尽管 2014 年收益率下行幅度较大，但在偏宽松的货币政策呵护和通缩压力蔓延下依旧具有机会，利率债波段机会可期，信用债在政策扰动下估值回升依旧有一定配置价值；中期来看，房地产是否经历良性调整，债风险系统性爆发引发刚性兑付风险依旧不能排除，这也取决于政府采用何种方式来推进改革，同时，利率市场化的进程还会持续推进，结构性的利率波动在所难免，因此 2015 年更多地以自下而上角度参与信用债投资是较为理性的选择。操作上，一季度的债券市场机会相对比较确定，信用债优于利率债，可转债机会依旧值得关注，债券市场风险点在于地方政府债务在各级政府甄别汇总后结果可能会有超预期的处置安排。

我们将按照绝对收益、稳定增值的思路，重点配置中高等级信用品种，控制久期，运用较高杠杆，做好流动性安排，积极参与可转债投资，但注意控制波动水平，争取为持有人谋求长期稳定的正回报。

#### 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，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（第十六部分三、收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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

2014 年度，基金托管人在嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2014 年度，嘉实基金管理有限公司在嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 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

2014 年度，由嘉实基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金 2014 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(2015)第 20123 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：嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,448,666.39	420,114,724.72
结算备付金		2,876,719.97	3,320,539.34
存出保证金		38,283.83	20,551.28
交易性金融资产	7.4.7.2	101,415,129.21	311,497,636.00
其中：股票投资		636,444.00	-
基金投资		-	-
债券投资		100,778,685.21	311,497,636.00
资产支持证券投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,988,665.00	9,977,736.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		110,767,464.40	744,931,187.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		8,099,992.60	57,000,000.00
应付证券清算款		2,905,243.88	45,013.09
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		58,985.49	407,184.53
应付托管费		16,852.99	116,338.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	14,889.89	7,904.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	360,000.00	180,000.00
负债合计		11,455,964.85	57,756,440.40
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	7.4.7.9	88,623,514.25	683,209,795.62
未分配利润	7.4.7.10	10,687,985.30	3,964,951.37
所有者权益合计		99,311,499.55	687,174,746.99
负债和所有者权益总计		110,767,464.40	744,931,187.39

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.121元，基金份额总额88,623,514.25份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年7月30日(基 金合同生效日)至 2013年12月31日
<b>一、收入</b>		56,193,014.48	11,760,810.32
1. 利息收入		32,465,471.95	17,064,644.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,990,197.89	10,089,240.87
债券利息收入		24,126,883.41	5,743,340.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		348,390.65	1,232,063.25
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		17,042,319.67	-337,224.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	17,042,319.67	-337,224.54
资产支持证券投资收益		-	-
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	-	-
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	6,685,222.86	-4,967,672.40
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	-	1,063.00
<b>减：二、费用</b>		10,294,796.17	5,063,347.81
1. 管理人报酬		3,549,177.06	2,020,158.63
2. 托管费		1,014,050.60	577,188.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	84,628.66	33,034.63
5. 利息支出		5,238,429.60	2,249,485.84
其中：卖出回购金融资产支出		5,238,429.60	2,249,485.84
6. 其他费用	7.4.7.19	408,510.25	183,480.54
<b>三、利润总额</b>		45,898,218.31	6,697,462.51

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		45,898,218.31	6,697,462.51

注：本基金合同生效日为 2013 年 7 月 30 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2013 年 7 月 30 日至 2013 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	683,209,795.62	3,964,951.37	687,174,746.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,898,218.31	45,898,218.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-594,586,281.37	-39,175,184.38	-633,761,465.75
其中：1. 基金申购款	3,702,279.27	247,060.93	3,949,340.20
2. 基金赎回款	-598,288,560.64	-39,422,245.31	-637,710,805.95
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）	88,623,514.25	10,687,985.30	99,311,499.55
项目	上年度可比期间 2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 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）	683,148,772.93	-	683,148,772.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,697,462.51	6,697,462.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	61,022.69	61.57	61,084.26

其中：1. 基金申购款	61,022.69	61.57	61,084.26
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-2,732,572.71	-2,732,572.71
五、期末所有者权益（基金净值）	683,209,795.62	3,964,951.37	687,174,746.99

注：本基金合同生效日为 2013 年 7 月 30 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2013 年 7 月 30 日至 2013 年 12 月 31 日。

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	_____ 李松林	_____ 王红
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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不一致，会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则的施行对本基金本报告期及上年度可比期间无重大影响。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.2 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。

### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 7 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,549,177.06	2,020,158.63
其中：支付销售机构的客户维护费	1,408,025.93	799,447.82

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 0.7% 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 × 0.7% / 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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 7 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,014,050.60	577,188.17

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 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

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 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

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 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（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 7 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 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
交通银行	3,448,666.39	177,020.02	114,724.72	2,348,471.37

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，活期银行存款按适用利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。（2）本期末（2014 年 12 月 31 日），本基金无存于交通的定期存款，本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），由交通银行保管的银行存款产生的利息收入无定期存款利息收入；上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金无存于交通银行的定期存款，上年度可比期间（2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），由交通银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入 2,266,833.34 元。

#### 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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2013 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（2014 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

###### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2014 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。

**7.4.12.1.2 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
110030	格力转债	2014年12月30日	2015年1月13日	未上市	100.00	100.00	2,710	271,000.00	271,000.00	-

**7.4.12.1.3 受限证券类别：其他**

本期末（2014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**

本期末（2014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**

本期末（2014年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

**7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 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 8,099,992.60 元，于 2015 年 1 月 5 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。

**§ 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	636,444.00	0.57
	其中：股票	636,444.00	0.57
2	固定收益投资	100,778,685.21	90.98
	其中：债券	100,778,685.21	90.98
	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	6,325,386.36	5.71
7	其他各项资产	3,026,948.83	2.73
	合计	110,767,464.40	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	636,444.00	0.64
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	-	-
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	-	-
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	636,444.00	0.64

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002318	久立特材	21,300	636,444.00	0.64
---	--------	------	--------	------------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

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	002318	久立特材	645,603.00	0.09

注：报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金仅买入上述 1 只股票。

### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

报告期内（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未卖出股票。

### 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	645,603.00
卖出股票收入（成交）总额	-

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	99,965,419.37	100.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	813,265.84	0.82
8	其他	-	-
	合计	100,778,685.21	101.48

## 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	1380119	13 平潭国投 债	200,000	20,206,000.00	20.35
2	1480242	14 嘉公路	100,000	10,347,000.00	10.42
3	1480391	14 常房债	100,000	10,260,000.00	10.33
4	122078	11 东阳光	90,000	9,261,000.00	9.33
5	122106	11 唐新 01	80,000	8,068,800.00	8.12

### 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	38,283.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,988,665.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

合计	3,026,948.83
----	--------------

#### 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
1,100	80,566.83	-	-	88,623,514.25	100.00%

### 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	-	-

### 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 ( 2013 年 7 月 30 日 ) 基金份额总额	683,148,772.93
本报告期期初基金份额总额	683,209,795.62
本报告期基金总申购份额	3,702,279.27

减:本报告期基金总赎回份额	598,288,560.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,623,514.25

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

2014年3月28日，本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期债券基金经理变更的公告》，聘请胡永青先生担任本基金基金经理职务，与基金经理刘宁女士、万晓西先生共同管理本基金。

2014年9月19日，本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期债券基金经理变更的公告》，万晓西先生、刘宁女士不再担任本基金基金经理。

2014年10月10日本基金管理人发布公告，聘请邵健先生、李松林先生担任公司副总经理职务。

2014年12月10日本基金管理人发布公告，安奎先生因任期届满不再担任公司董事长，邓红国先生任公司董事长。

#### (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 60,000.00 元,该审计机构已连续 2 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

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	
中信证券股份有限公司	2	-	-	67,049.35	100.00%	-

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。

### 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	
	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



中信证券股份有限公司	866,429,228.86	100.00%	18,679,401,000.00	100.00%
------------	----------------	---------	-------------------	---------

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 3 月 31 日