

嘉实超短债证券投资基金

2013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:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月26日

重要提示
基金管理人、董事、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月20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请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2013年1月1日起至2013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。

基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征.

Table with 3 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Includes contact information for 嘉实基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Includes website and address information.

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

Table with 4 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 2013年, 2012年, 2011年. Includes 本期已实现收益, 加权平均基金份额本期利润, etc.

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...

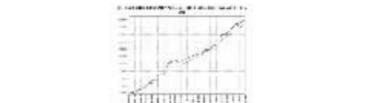
3.2 基金净值表现

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

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④.

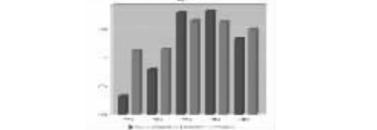
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实超短债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



注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。建仓期间本基金的各项资产配置比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的规定...

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位:人民币元

Table with 5 columns: 年度, 每10份基金份额的现金分配金额, 期末可供分配利润, 年度利润分配比例, 备注.

4.1 基金管理人报告

4.1.1 基金管理人及基金运作情况
基金管理人及基金运作情况
本基金管理人作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家基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。

4.1.2 基金管理人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约定的约定。

纯债债券、嘉实中证中国企业指数(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、嘉实中证金债中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意定期债券、嘉实美国成长股票(ODI)、嘉实丰颐策略定期债券、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、嘉实高票货币、嘉实1个月理财债券、其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券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、特定客户资产管理组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Lists 魏蔚 as the manager.

注:(1)任职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
在报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实超短债证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和内部控制方法
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。

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流程和流程独立决策,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。

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10次,均为向下指数基金或ETF因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易,但并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
2013年债券市场在资金面的主导下先跌后涨。全年流动性先松后紧,资金利率大幅波动。年初到5月,外汇占款持续增长,社会融资总量和银行信贷相对超预期,通胀压力也不大,整体资金面维持宽松。银行间7天回购利率均值3.1%左右。5-7月份市场重启公开市场正回购操作,5月后央行突发表声,反映其不希望资金面总量继续宽松的态度,但回笼力度相对偏弱。

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1.0080元;本报告期基金份额净值增长率为2.67%,业绩比较基准收益率为3.00%。

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2014年,宏观经济、通胀率和资金面仍将影响货币市场的主要因素。整体看,美国量化宽松政策推进节奏趋缓,但带来的影响仍较复杂。

共实施了9次分配利润合计19,415,718.75元,报告期内利润分配具体情况参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(3)本基金的基金管理人于2014年1月15日发布《嘉实超短债证券投资基金2013年第一次收益分配公告》,收益分配基准日为2013年12月31日,每10份基金份额发放现金红利0.069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约定。

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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实超短债证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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
报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金资产的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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
本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具及风险管理”部分未在本托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 审计报告

嘉实超短债证券投资基金2013年度财务报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师许菲、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[2014]第21204号)。

投资者可通过登录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:嘉实超短债证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

Balance Sheet table with columns: 资产, 附注, 2013年12月31日, 2012年12月31日. Includes 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

7.2 利润表
会计主体:嘉实超短债证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

Income Statement table with columns: 资产, 附注, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Includes 利息收入, 公允价值变动收益, etc.

注:报告截止日2013年12月31日,本基金份额总额1,008.00份,基金份额净值1.0080元。

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

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 权益投资, 固定收益投资, etc.

8.2 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

Table with 5 columns: 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(%).

8.3 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
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%).

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 品种名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.5 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
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.6 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.7 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.8 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.9 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.10 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.11 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.12 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.13 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.14 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.15 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.16 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.17 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

8.18 投资组合报告附注
(1)本基金报告期内未持有股票投资,因此不存在股票投资明细。
(2)本基金报告期内未持有股指期货,因此不存在股指期货投资明细。
(3)本基金报告期内未持有权证,因此不存在权证投资明细。

6.1 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。

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

Table with 2 columns: 项目, 与本基金的关系. Lists 嘉实基金管理有限公司, 中国银行股份有限公司, etc.

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(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行。

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

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的管理费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的托管费, etc.

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一基金资产净值0.14%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.3 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.4 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.5 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.6 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.7 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.8 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.9 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.10 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.11 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.12 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.13 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.14 销售服务费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Includes 当期发生的基金应支付的销售服务费, etc.

Table with 5 columns: 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(%).

8.4 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

Table with 5 columns: 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(%).

注:报告期末,本基金仅持有上述2项资产支持证券。

8.5 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贵金属投资明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%).

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注
(1)本基金计价方法说明

(2)基金估值:在证券交易所市场,实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;未上市债券采用估值技术确定公允价值。

8.9.2 报告期末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。

8.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Includes 存出保证金, 应收债券销售款, etc.

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 3 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 持有人结构. Includes 机构投资者, 个人投资者.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
9.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金管理人持有本基金, etc.

9.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金情况
本期末,基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.3 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.4 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.5 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.6 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.7 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.8 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.9 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.10 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.11 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.12 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.13 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下:

Table with 2 columns: 项目, 占基金总份额比例. Includes 基金基金经理持有本基金, etc.

9.2.14 基金基金经理持有本基金情况
本期末,基金基金经理持有本基金情况如下: