嘉实多利分级债券型证券投资基金

【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：招商银行股份有限公司
送出日期：2014年3月26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。

基金托管人招商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应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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多利分级债券型证券投资基金		
基金简称	嘉实多利分级债券(场内简称：嘉实多利)		
基金主代码	160718		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年3月23日		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	369,924,427.97份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011年5月6日		
下属分级基金的基金简称	嘉实多利分级债券	多利优先	多利进取
下属分级基金的交易代码	160718	150032	150033
报告期末下属分级基金份额总额	217,411,272.97份	122,010,524.00份	30,502,631.00份

注：深圳证券交易所上市交易的基金份额为多利优先，基金代码：150032；多利进取，基金代码：150033。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，力争持续稳定增值。
投资策略	为持续稳妥地获得高于存款利率的收益，本基金首先运用“嘉实下行风险波动模型”，控制基金组合的年下行波动风险。在此前提下，本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等，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，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率 × 90% + 沪深300指数收益率 × 10%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010)65215588	(0755)83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010)65182266	(0755)83195201

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	2013年	2012年	2011年3月23日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	35,331,350.66	20,941,467.00	-10,962,206.21
本期利润	19,037,529.75	17,061,406.25	-1,531,629.85
加权平均基金份额本期利润	0.0343	0.0164	-0.0008
本期加权平均净值利润率	3.49%	1.67%	-0.08%
本期基金份额净值增长率	0.21%	1.29%	0.17%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	5,720,900.55	3,383,373.06	-12,189,327.70
期末可供分配基金份额利润	0.0155	0.0040	-0.0087
期末基金资产净值	346,791,572.01	815,189,253.63	1,399,229,816.56
期末基金份额净值	0.9375	0.9737	1.0017
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	1.67%	1.47%	0.17%

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

3.1.1 期间数据和指标		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	-3.51%	0.24%	-2.43%	0.18%	-1.08%	0.06%	
过去六个月	-4.23%	0.19%	-3.11%	0.17%	-1.12%	0.02%	
过去一年	0.21%	0.26%	-2.47%	0.18%	2.68%	0.08%	
自基金合同生效起至今	1.67%	0.24%	2.11%	0.16%	-0.44%	0.08%	

注：本基金业绩比较基准为中国债券总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。沪深300指数是沪深证券交易所联合发布的反映A股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成分股指数，具有良好的A股市场代表性。

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：

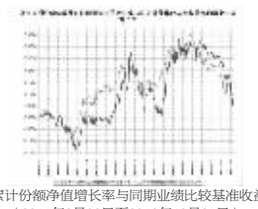
Benchmark(0)=1000

Return(t)=90%*(中国债券总指数(t)/中国债券总指数(t-1)-1)+10%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)

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

其中t=1,2,3,…。

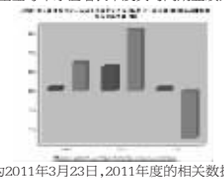
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图：嘉实多利分级债券累计份额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（2011年3月23日至2013年12月31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（十六（二）投资范围和（五）投资限制2.基金投资组合限制）的有关约定。

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



注：本基金基金合同生效日为2011年3月23日，2011年度的相关数据根据当年实际存续期（2011年3月23日至2011年12月31日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金基金合同二十（三）收益分配原则，本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。

§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2013年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、54只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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300ETF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（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。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		
王茜	本基金基金经理、嘉实多元债券基金经理、公司固定收益部总监。	2011年3月23日	-	11年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理，中信证券固定收益部，长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008年11月加盟嘉实基金。工商管理硕士，具有基金从业资格，中国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(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、《嘉实多利分级债券型证券投资基金合同》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10次，均为旗下指数基金或ETF因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，但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

经济回顾：全年来看经济呈现近年来少有的窄幅波动形态，上半年走势偏弱，下半年有所走强。货币政策全年呈现中性态度，上半年略松，下半年有所偏紧。

债市回顾：上半年，债市先是在经济数据偏弱、流动性较为宽松的背景下有所走强。但是随后由于内部政策监管坚强，以及外围市场动荡，引发资金面持续大幅波动，债市出现调整。整体来看，上半年长端收益率窄幅变动，短端收益率有系统性抬升。下半年，多重因素叠加使得债市调整加剧。主要背景是经济阶段性回暖超预期，同时货币政策以及监管政策持续加强，引发金融机构开始去杠杆。整体来看，下半年债市出现几乎单边下跌的走势，收益率曲线出现整体性上移，上移幅度在100BP左右。进入4季度之后，信用债调整开始加剧。

2013年上半年，本基金在大类资产配置方向上总体正确，一方面保持了债券类资产核心配置，同时适时降低了权益类资产的配置比重，有效避免了股票市场下跌对基金资产净值的影响，取得了较好的投资收益。下半年，由于对利率市场化及商业银行资产负债调整的认识不够深刻，在债券资产配置尤其是利率债券的配置上存在一定失误，对基金资产造成了较大的负面影响。

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0.9375元；本报告期基金份额净值增长率为0.21%，业绩比较基准收益率为-2.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济展望：我们认为上半年国内宏观经济可能会呈现低位弱稳定走势，延续前期的窄幅振荡格局。原因包括前期地产、基建投资的惯性延续，以及部分制造业的内生动力支撑。但是从方向来看，很难出现明显的回升走势。下半年，我们认为经济出现阶段性下滑的概率较大，主要原因是在资金面持续紧张的背景下前期的增长动力都将面临压力，同时政策再次托底刺激的力度和空间也将非常有限。

债券市场展望：上半年，利率债有望在当前水平进入波动区间，进一步上升或者下降的空间都比较有限。一方面经济持续弱势，而当前利率债水平已经较为充分的反应了基本面复苏以及金融机构持续去杠杆的压力。另一方面，由于当前的经济运行格局下资金水平仍然易紧难松，因此也制约了利率债收益率的下行空间。信用债则继续面临基本面持续弱势，以及资产配置转换的双重压力，预计整体信用利差仍有一定的上升空间。下半年，在我们预计经济出现衰退的假设背景下，利率债可能将率先迎来配置机会，窗口期标志是经济数据出现量价齐跌的现象。与以往短周期的规律不同的是，在未来的经济衰退周期中，信用债的调整时间可能更长，风险暴露程度可能更大。原因是不管从内生动力来讲，还是外部刺激空间来讲都将很难支撑经济重新出现明显的回升。

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历。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证券业协会等。

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二十（三）收益分配原则“本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。”因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

嘉实多利分级债券型证券投资基金2013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(2014)第20503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：嘉实多利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	275,358.15	11,799,178.68
结算备付金		10,484,470.93	19,912,239.17
存出保证金		117,849.18	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	439,036,727.02	1,229,152,031.76
其中：股票投资		31,321,386.54	141,512,938.67
基金投资		-	-
债券投资		407,715,340.48	1,087,639,093.09
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		1,323,077.80	16,536,274.25
应收利息	7.4.7.5	6,556,749.95	14,557,187.81
应收股利		-	-
应收申购款		2,682.28	2,281.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		457,796,915.31	1,292,209,193.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		108,299,966.90	472,149,086.67
应付证券清算款		-	982,000.99
应付赎回款		1,011,003.89	2,024,411.27
应付管理人报酬		214,830.68	485,743.94
应付托管费		61,380.21	138,783.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	57,030.57	397,628.88
应交税费		872,045.89	210,245.89
应付利息		109,049.94	91,271.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	380,035.22	540,767.10
负债合计		111,005,343.30	477,019,939.79
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	341,070,671.46	803,347,477.73
未分配利润	7.4.7.10	5,720,900.55	11,841,775.90
所有者权益合计		346,791,572.01	815,189,253.63
负债和所有者权益总计		457,796,915.31	1,292,209,193.42

注：报告截止日2013年12月31日，嘉实多利分级债券基金份额净值0.9375元，基金份额总额217,411,272.97份；多利优先份额净值1.0385元，基金份额总额122,010,524.00份；多利进取份额净值0.5335元，基金份额总额30,502,631.00份。本基金基金份额总额合计369,924,427.97份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实多利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		34,845,210.96	39,701,247.28
1.利息收入		31,888,965.01	48,039,938.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	419,204.27	2,233,372.39
债券利息收入		31,469,760.74	41,916,846.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,889,720.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益		19,051,695.99	-4,801,495.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,825,482.56	-31,283,536.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,051,627.37	24,103,283.87
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	174,586.06	2,378,756.23
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-16,293,820.91	-3,880,060.75
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	198,370.87	342,865.24
减：二、费用		15,807,681.21	22,639,841.03
1.管理人报酬		3,855,063.53	7,200,170.44
2.托管费		1,101,446.77	2,057,191.55
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,034,930.09	2,388,599.65
5.利息支出		9,300,368.33	10,461,819.21
其中：卖出回购金融资产支出		9,300,368.33	10,461,819.21
6.其他费用	7.4.7.19	515,872.49	532,060.18
三、利润总额		19,037,529.75	17,061,406.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润		19,037,529.75	17,061,406.25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实多利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1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）	803,347,477.73	11,841,775.90	815,189,253.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,037,529.75	19,037,529.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-462,276,806.27	-25,158,405.10	-487,435,211.37
其中：1.基金申购款	35,436,461.62	1,580,490.29	37,016,951.91
2.基金赎回款	-497,713,267.89	-26,738,895.39	-524,452,163.28
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）	341,070,671.46	5,720,900.55	346,791,572.01
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	1,396,806,430.22	2,423,386.34	1,399,229,816.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,061,406.25	17,061,406.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-593,458,952.49	-7,643,016.69	-601,101,969.18
其中：1.基金申购款	608,022,538.40	15,277,380.31	623,299,918.71
2.基金赎回款	-1,201,481,490.89	-22,920,397.00	-1,224,401,887.89
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）	803,347,477.73	11,841,775.90	815,189,253.63

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、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

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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（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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,855,063.53	7,200,170.44
其中：支付销售机构的客户维护费	702,334.23	1,588,979.92

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,101,446.77	2,057,191.55

注：支付基金托管人招商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

单位：人民币元

本期 2013年1月1日至2013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
招商银行	-	28,428,690.00	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
招商银行	10,047,179.45	144,825,365.02	-	-	190,700,000.00	19,626.58

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（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），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（2013年12月31日）及上年度末（2012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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
招商银行	275,358.15	94,026.14	11,799,178.68	234,667.09

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

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（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)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2013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（2013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（2013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（2013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2013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108,299,966.90元，于2014年1月22日先后到期。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	31,321,386.54	6.84
	其中：股票	31,321,386.54	6.84
2	固定收益投资	407,715,340.48	89.06
	其中：债券	407,715,340.48	89.06
	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	10,759,829.08	2.35
7	其他各项资产	8,000,359.21	1.75
	合计	457,796,915.31	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	20,147,926.54	5.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	732,805.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,126,372.00	1.77
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	402,598.00	0.12
J	金融业	1,072,601.00	0.31
K	房地产业	2,393,209.00	0.69
L	租赁和商务服务业	445,875.00	0.13
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	31,321,386.54	9.03

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	000963	华东医药	63,076	2,901,496.00	0.84
2	600079	人福医药	101,108	2,866,411.80	0.83
3	000538	云南白药	25,500	2,600,745.00	0.75
4	600649	城投控股	287,300	2,393,209.00	0.69
5	600655	豫园商城	307,600	2,386,976.00	0.69
6	300101	国腾电子	106,600	2,108,548.00	0.61
7	600594	益佰制药	61,362	2,001,628.44	0.58
8	000333	美的集团	37,627	1,881,350.00	0.54
9	601369	陕鼓动力	261,900	1,741,635.00	0.50
10	600475	华光股份	138,310	1,691,531.30	0.49

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（http://www.jsfund.cn）的年度报告正文。

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	000002	万 科A	35,171,089.65	4.31
2	600315	上海家化	23,627,617.84	2.90
3	601398	工商银行	10,821,529.02	1.33
4	600079	人福医药	10,657,223.96	1.31
5	600000	浦发银行	9,770,815.48	1.20
6	000895	双汇发展	8,803,541.63	1.08
7	601299	中国北车	8,769,189.77	1.08
8	600585	海螺水泥	7,585,970.90	0.93