嘉实理财宝7天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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	嘉实理财宝7天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝7天债券	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月29日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	292,721,121.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
下属分级基金的交易代码:	070035	070036
报告期末下属分级基金的份额总额	168,560,023.37份	124,161,097.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据各种宏观经济指标决定组合的平均剩余期限和比例分布;根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例;根据各类资产的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	李芳菲
	联系电话	(010)65215588	(010)66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65182266	(010)63201816

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8月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
本期已实现收益	27,739,417.98	33,766,035.42	13,991,776.21	8,019,568.75
本期利润	27,739,417.98	33,766,035.42	13,991,776.21	8,019,568.75
本期净值收益率	3.3976%	3.6992%	0.9608%	1.0619%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	168,560,023.37	124,161,097.82	969,964,071.01	795,114,270.48
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2013年末		2012年末	
累计净值收益率	4.3910%	4.8003%	0.9608%	1.0619%

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)嘉实理财宝7天债券A与嘉实理财宝7天债券B适用不同的销售服务费率。(3)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(4)本基金收益在基金份额"7 天持有周期到期日"集中结转为基金份额。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实理财宝7天债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.8674%	0.0035%	0.3403%	0.0000%	0.5271%	0.0035%
过去六个月	1.6264%	0.0035%	0.6805%	0.0000%	0.9459%	0.0035%
过去一年	3.3976%	0.0052%	1.3500%	0.0000%	2.0476%	0.0052%
自基金合同生效起至今	4.3910%	0.0048%	1.8123%	0.0000%	2.5787%	0.0048%

嘉实理财宝7天债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.9415%	0.0035%	0.3403%	0.0000%	0.6012%	0.0035%
过去六个月	1.7761%	0.0035%	0.6805%	0.0000%	1.0956%	0.0035%
过去一年	3.6992%	0.0052%	1.3500%	0.0000%	2.3492%	0.0052%
自基金合同生效起至今	4.8003%	0.0048%	1.8123%	0.0000%	2.9880%	0.0048%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

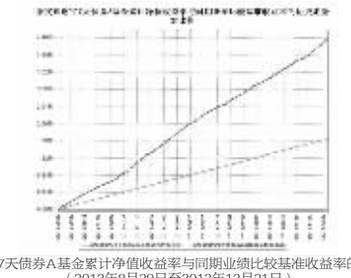


图1:嘉实理财宝7天债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年12月31日)

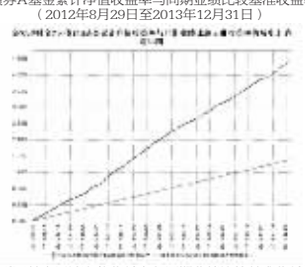
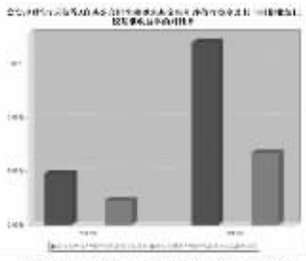


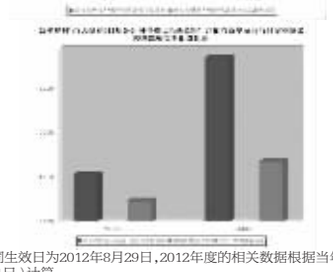
图2:嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年12月31日)

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2:2013年12月19日,本基金管理人发布《关于嘉实理财宝7天债券基金经理变更的公告》,桑迎先生不再担任本基金基金经理;聘请魏莉女士担任本基金基金经理职务。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益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2012年8月29日,2012年度的相关数据根据当年实际存续期(2012年8月29日至2012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

嘉实理财宝7天债券A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013年	21,990,148.69	5,940,771.32	-191,502.03	27,739,417.98	
2012年	8,558,406.04	5,138,918.50	294,451.67	13,991,776.21	
合计	30,548,554.73	11,079,689.82	102,949.64	41,731,194.19	

单位:人民币元

嘉实理财宝7天债券B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013年	25,753,508.77	8,180,845.98	-168,319.33	33,766,035.42	
2012年	3,241,263.22	4,506,512.43	271,793.10	8,019,568.75	
合计	28,994,771.99	12,687,358.41	103,473.77	41,785,604.17	

§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		
魏莉	本基金基金经理、嘉实货币、嘉实短债债券、嘉实安心货币、嘉实1个月理财债券基金经理	2013年12月19日	-	10年	曾任职于国家开发银行国际金融局,中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士,CFA、CPA,具有基金从业资格,中国国籍。
桑迎	本基金基金经理、嘉实安心货币基金经理	2012年8月29日	2013年12月19日	8年	曾任交通银行外汇交易员,华夏银行总行交易员。2008年1月加入嘉实基金管理有限公司,历任交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。银行与金融专业硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)基金经理桑迎的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理魏莉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、《嘉实理财宝7天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,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

2013年资金面是货币市场的主要影响因素,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。央行2月份重启公开市场正回购操作,5月重启央票发行,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。在资金面和宏观经济数据配合下,各机构配置需求旺盛,债券收益率整体下行,部分投资者更增加杠杆运作。但是6月20日开始,企业所得税年度集中清缴、外汇市场变化、银行补缴法定准备金、理财产品集中到期、季末银行争存存款等多种因素的影响叠加,市场资金面迅速紧张,恐慌情绪6月20日达到顶峰,银行间7天回购利率升至11.7%。之后央行出面稳定市场情绪,并对部分银行提供流动性支持,市场信心才有所恢复。资金成本的持续高企导致整体债市下跌,短期债券受到的冲击尤为剧烈。下半年,在央行操作主导下,市场流动性一直呈现紧平衡状态。宏观经济复苏态势较为平稳,央行继续关注货币总量和物价压力,不放松的态度坚决。下半年利率中枢持续抬升,3季度和4季度银行间7天回购利率均值分别为4.01%和4.74%。下半年央行公开市场操作以短期逆回购为主,并通过SLF和SLO等创新工具增加操作的灵活性和针对性。资金成本上升推动银行调整资产负债结构,利率市场化的进程加快;投资者彻底接受央行不放松的态度,调整政策预期,整体收益率曲线重定价,债市大幅下跌,利率债和高等级信用债收益率创历史新高。年末1年期国开金融债收益率5.49%,较年初升幅超过200bps。信用产品方面,短融收益率跟随基准利率抬升,1年期高评级的AAA级短融年末收益率6.32%,中等评级的AA级短融收益率7.06%,均创历史新高。

2013年,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性和流动性为首要任务;密切跟踪各项经济数据,及时分析市场资金面变化,把握投资时钟,适时调整投资策略和组合配置。组合规模在13年波动剧烈,1季度规模有较大增长,但2季度受市场波动和银行吸存影响规模迅速大幅下降,下半年规模持续缩减。上半年,组合持仓平衡配置同业存款和短期债券,管理现金流分布,合理运用杠杆资源,保障组合流动性的同时实现较高的静态收益;保持中性较短久期,减小组合承担的利率风险。但6月之后因规模持续缩减,组合被动调整持仓,以应对流动性为主,未能跟随市场分享更高的再投资收益。但经过上述操作,年末组合已基本调整到位,持仓结构相对安全,流动性和调整空间充分,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝7天债券A的基金份额净值收益率为3.3976%,嘉实理财宝7天债券B的基金份额净值收益率为3.6992%,同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

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、通胀走势和资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看,美国量化宽松政策退出节奏已经逐步明朗,由此带来的影响将错综复杂;国内经济复苏形势平稳,但年内通胀较大概率将回到3%以上。综合当前国内外整体经济和货币环境,预计央行将持续稳健偏紧的货币政策,并着力增强政策的前瞻性、针对性和灵活性,运用各类创新工具进行预调微调。2014年将进一步推进利率市场化改革,更大程度发挥市场机制在资源配置中的基础性作用,预期未来资金面难以回到宽松状况。央行公开市场操作和回购利率将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。从债券市场发展前景看,2014年债市供给、特别是信用债的供给仍将增长。2014年股票市场重启IPO,对资金面和债券市场也会有一定影响。2014年银行同业业务的规范和推动金融去杠杆过程仍将继续,对这方面业务的监管将在发展中不断完善,这都将对债券和资金市场带来复杂和深远影响,投资者要重点关注这方面的政策。针对上述复杂的市场环境,本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性和流动性为首要任务,兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,平衡配置同业存款和债券投资,谨慎控制组合的信用配置,保持合理流动性资产配置,细致管理现金流,以控制利率风险和应对组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

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第十六部分二、收益分配原则的约定:"3.本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,在基金份额"7 天持有周期到期日"集中支付。","5.本基金每日进行收益计算并分配时,在基金份额"7 天持有周期到期日"累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式",本期A类份额已实现收益为27,739,417.98元,每日分配,到期支付,合计分配27,739,417.98元,B类份额已实现收益为33,766,035.42元,每日分配,到期支付,合计分配33,766,035.42元,符合本基金基金合同的约定。

§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

在托管嘉实理财宝7天债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金托管协议》的约定,对嘉实理财宝7天债券型证券投资基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,除2013年7月1日,嘉实理财宝7天债券型证券投资基金的基金投资组合平均剩余期限为129天,违反了基金合同中"基金投资组合平均剩余期限不得超过127天"的约定。嘉实基金管理有限公司在嘉实理财宝7天债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的嘉实理财宝7天债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

嘉实理财宝7天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20499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:嘉实理财宝7天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	114,229,620.21	485,856,474.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	129,967,308.11	961,065,788.32
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		129,967,308.11	961,065,788.32
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	65,000,000.00	359,500,979.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,792,872.94	18,497,041.87
应收股利		-	-
应收申购款		5,490,100.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		317,479,901.26	1,824,920,283.97
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		23,999,868.00	58,559,850.72
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		73,430.38	266,080.21
应付托管费		21,757.15	78,838.59
应付销售服务费		50,175.91	187,756.92
应付交易费用	7.4.7.7	15,987.98	36,941.03
应交税费		-	-
应付利息		2,137.24	6,230.24
应付利润		206,423.41	566,244.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	389,000.00	140,000.00
负债合计		24,758,780.07	59,841,942.48
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	292,721,121.19	1,765,078,341.49
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		292,721,121.19	1,765,078,341.49
负债和所有者权益总计		317,479,901.26	1,824,920,283.97

注:报告截止日2013年12月31日,嘉实理财宝7天债券A基金份额净值1.0000元,基金份额总额168,560,023.37份;嘉实理财宝7天债券B基金份额净值1.0000元,基金份额总额124,161,097.82份。嘉实理财宝7天债券基金份额总额合计为292,721,121.19份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实理财宝7天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8月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		78,418,068.20	27,600,667.97
1.利息收入		67,206,639.39	26,764,663.73
其中:存款利息收入	7.4.7.11	29,436,889.96	19,082,620.95
债券利息收入		34,267,759.30	5,705,261.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,501,990.13	1,976,781.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益		11,211,428.81	835,944.06
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	11,211,428.81	835,944.06
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益		-	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.13	-	60.18
减:二、费用		16,912,614.80	5,589,323.01
1.管理人报酬		4,730,005.97	2,020,878.84
2.托管费		1,401,483.26	598,778.99
3.销售服务费		2,564,733.06	1,504,932.68
4.交易费用	7.4.7.14	-	-
5.利息支出		7,674,916.62	1,251,380.20
其中:卖出回购金融资产支出		7,674,916.62	1,251,380.20
6.其他费用	7.4.7.15	541,475.89	213,352.30
三、利润总额		61,505,453.40	22,011,344.96
减:所得税费用		-	-
四、净利润		61,505,453.40	22,011,344.96

注:本基金合同生效日为2012年8月29日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年8月29日至2012年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实理财宝7天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)	1,765,078,341.49	-	1,765,078,341.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	61,505,453.40	61,505,453.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,472,357,220.30	-	-1,472,357,220.30
其中:1.基金申购款	21,750,686,027.27	-	21,750,686,027.27
2.基金赎回款	-23,223,043,247.57	-	-23,223,043,247.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-61,505,453.40	-61,505,453.40
五、期末所有者权益(基金净值)	292,721,121.19	-	292,721,121.19
项目	上年度可比期间 2012年8月29日(基金合同生效日)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)	9,528,525,870.62	-	9,528,525,870.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,011,344.96	22,011,344.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-7,763,447,529.13	-	-7,763,447,529.13
其中:1.基金申购款	9,533,362,807.21	-	9,533,362,807.21
2.基金赎回款	-17,296,810,336.34	-	-17,296,810,336.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-22,011,344.96	-22,011,344.96
五、期末所有者权益(基金净值)	1,765,078,341.49	-	1,765,078,341.49

注:本基金合同生效日为2012年8月29日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年8月29日至2012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、会计估计与最近一期年度报告一致。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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
嘉实资本管理有限公司(嘉实资本)	基金管理人的控股子公司

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8月29日(基金合同生效日)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8月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,730,005.97	2,020,878.84
其中:支付销售机构的客户维护费	1,023,122.36	670,948.65

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0.27%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×0.27%/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8月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,401,483.26	598,778.99

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%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×0.08%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B	合计
嘉实基金管理有限公司	111,342.18	51,683.39	163,025.57
中国农业银行股份有限公司	1,220,617.63	18,307.74	1,238,925.37
合计	1,331,959.81	69,991.13	1,401,950.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年8月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B	合计
嘉实基金管理有限公司	7,694.57	787.49	8,482.06
中国农业银行股份有限公司	1,398,575.19	22,458.19	1,421,033.38
合计	1,406,269.76	23,245.68	1,429,515.44

注:(1)嘉实理财宝7天债券A类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给嘉实基金管理有限公司,再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。其计算公式为:日A类基金份额销售服务费=前一日A类基金份额资产净值×0.30%/当年天数。(2)嘉实理财宝7天债券B类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给嘉实基金管理有限公司,再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其达到B类条件的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。其计算公式为:日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额资产净值×0.01%/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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
	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
中国农业银行	60,577,331.50	40,950,706.33	-	-	432,000,000.00	25,181.48

注:上年度可比期间(2012年8月29日(基金合同生效日)至2012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

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	