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

嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§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	嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强收益定期债券
基金主代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月24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	626,530,066.12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	在具备足够多预期风险可控、收益率良好的投资标的时,优先考虑短期融资券及非AAA级别的其他信用债券的配置。同时,还可通过其他债券,衍生工具等辅助投资策略,规避风险、增强收益;基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究,运用定性定量模型,采取适度分散的行业配置策略以及自下而上的个债精选策略。
业绩比较基准	中债企业债总财富指数收益率
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	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9月24日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	78,520,052.70	29,098,886.99
本期利润	76,924,480.36	25,921,885.60
加权平均基金份额本期利润	0.0288	0.0077
本期加权平均净值利润率	2.85%	0.76%
本期基金份额净值增长率	2.67%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	2,805,499.27	25,917,925.01
期末可供分配基金份额利润	0.0045	0.0077
期末基金资产净值	629,335,565.39	3,412,871,766.61
期末基金份额净值	1.004	1.008
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	3.49%	0.80%

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

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	0.50%	0.05%	-1.62%	0.08%	2.12%	-0.03%
过去六个月	-0.63%	0.07%	-2.02%	0.08%	1.39%	-0.01%
过去一年	2.67%	0.09%	1.76%	0.09%	0.91%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.49%	0.08%	3.52%	0.08%	-0.03%	0.00%

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

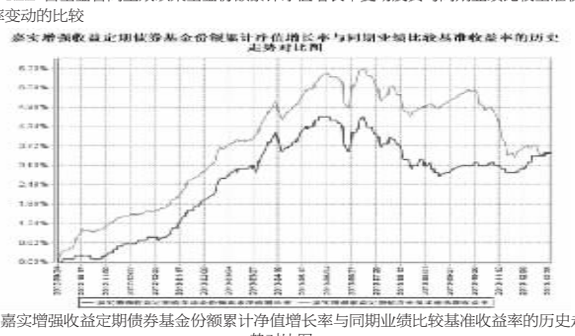


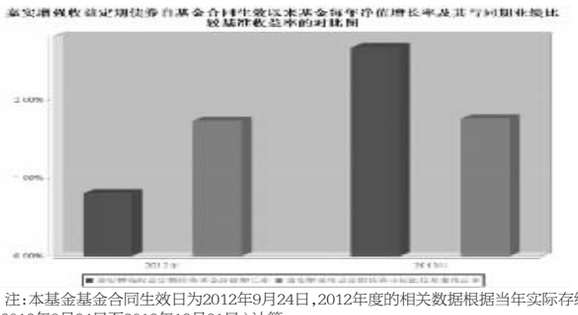
图:嘉实增强收益定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月24日至2012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"第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制"的有关约定。

注2:2013年7月5日,本基金管理人发布《关于嘉实增强收益定期债券基金经理变更的公告》,陈雯雯女士不再担任本基金基金经理;聘请万晓西先生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2012年9月24日,2012年度的相关数据根据当年实际存续期(2012年9月24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

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
2013	0.3090	100,695,935.99	3,992,111.14	104,688,047.13	
2012	-	-	-	-	
合计	0.3090	100,695,935.99	3,992,111.14	104,688,047.13	

§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		
万晓西	本基金基金经理,嘉实信用债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币基金经理,公司现金管理部副总监	2013年7月5日	-	13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,2013年12月至今担任现金管理部副总监。经济学硕士,中国国籍。
陈雯雯	本基金基金经理、嘉实信用债券基金经理	2012年9月24日	2013年7月5日	6年	2006年7月加盟嘉实基金管理有限公司,曾任固定收益部信用分析师、投资组合经理,会计学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)基金经理陈雯雯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、《嘉实增强收益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,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年经济全年运行稳中有降,一二季度在去库存和结构调整压力下小幅回落,三季度基建投资放量促发经济反弹,四季度经济再度下行,但下降速度较为缓慢。从三驾马车的角度分析,投资增速依然较为稳定,同时出口、消费有底部复苏的迹象,因此整体经济走势仍然较为平稳,全年推算,2013年消费贡献度下降,投资贡献上升,净出口贡献小幅回落。通胀水平较为平稳,CPI全年2.6%,显著低于年初调控目标3.5%,PPI全年-1.9%,连续两年下降,尽管下半年以来跌幅趋缓,但回升趋势难以确认。2013年影响资本市场的最大变量是利率市场化大潮下的资金价格,金融机构在盈利和竞争压力驱动下进行了广泛的金融创新包括银行同业、非银通道、信托受益权以及互联网金融等各方面,而央行为控制系统性金融风险把住了流动性的总闸门,使得银行间回购利率出现剧烈波动,以国债为代表的收益率曲线平坦化抬升。

债券市场回顾:债券市场在2013年演绎了先喜后悲的过程,一季度延续了2012年的强势表现,中低等级信用债继续领衔上涨,二季度市场遭受监管风波和6月钱荒冲击,收益率显著震荡上行,三四季度虽然经济基本面对债市的利空影响已经逐渐消除,但是由于央行实施中性偏紧的货币政策,银行间市场流动性依然较为紧张,监管力度的加强使得金融机构加大去杠杆力度,因此债券市场整体在下半年继续表现疲弱,收益率曲线呈现平坦化上移, 中债总财富指数全年下跌2.26%,10年期国债收益率全年上行幅度近100BP,10年期政策性金融债收益率上行135BP左右,而5年期AA企业债收益率上涨幅度在130个BP。

运作分析:上一个封闭期主要为应付赎回,在市场下跌过程中持续卖出债券;新的封闭期开始后,基金基于债券市场谨慎的判断,严格控制中低等级信用债比例,压缩组合久期,增配高等级短融和协议存款,组合获取了小幅正收益。

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1.004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1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济整体走势将以稳定为主,通胀相对也平稳,市场更多地把关注点放在三中全会之后的改革举措落实上来。从影响去年资本市场较大的资金面来看,虽然有春节的季节性冲击,但预计不会出现12月末的超预期紧张情况,整体资金面维持在和去年4季度均值大体相当的水平,在春节之后资金利率有望得以宽松。全年来看,相对于2013年而言资金面对于市将不构成较大的负面因素。

对于债券市场,我们认为从基本面的角度,利率债将有阶段性的表现机会,但在整体货币政策没有大幅转向之前,预计短期收益率水平还将在高位震荡;着眼全年来看,流动性的边际改善和经济下行压力下对资金需求的减弱有助于利率债的表现,我们将密切关注利率债的配置机会。在经济结构调整压力下,信用债受到基本面和资金面的双重挤压,加之各类金融机构资产配置调整的冲击,利差继续上升应该是大概率的事情,特别是在信用风险事件没有爆发之前,市场对于低等级品种将保持谨慎态度。对于权益市场,我们认为新一届政府对经济增速下滑容忍度提高,经济转型压力加大,市场还将维持低位震荡走势,缺少趋势性机会;但由于估值处在低位,流动性的边际改善将使得市场出现阶段性的机会。

我们将按照绝对收益、稳定增值的思路,重点配置高等级信用品种,控制久期,适度采用杠杆,做好流动性安排,耐心等待债券市场出现趋势性机会,谨慎地参与可转债投资,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

(1)本基金的基金管理人于2013年1月14日发布《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金2012年第一次收益分配公告》,收益分配基准日为2012年12月21日,每10份基金份额发放现金红利0.077元,具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

(2)本基金的基金管理人于报告期内实施了2次利润分配,符合基金合同十七(三)收益分配原则"3. 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每三个月最少分配一次,每年最多分配 12 次,每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日单位份额可供分配利润的 90%"的约定。具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

(3)本基金的基金管理人于2014年1月3日发布《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金2013年第三次收益分配公告》,收益分配基准日为2013年12月23日,每10份基金份额发放现金红利0.030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相关约定。

§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

嘉实增强收益定期开放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20489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:嘉实增强收益定期开放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	175,960,698.85	8,281,605.37
结算备付金		583,447.47	14,716,506.88
存出保证金		753,013.78	-
交易性金融资产	7.4.7.2	569,586,008.00	4,459,728,850.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		494,197,008.00	4,323,184,850.00
资产支持证券投资		75,389,000.00	136,544,000.00
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		-	54,027,996.38
应收利息	7.4.7.5	9,514,090.52	52,947,958.49
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		756,397,258.62	4,589,702,917.12
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		124,999,657.50	1,172,967,995.23
应付证券清算款		23,306.12	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		426,471.86	2,311,256.05
应付托管费		106,617.97	577,814.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	11,658.71	66,709.30
应交税费		1,016,006.07	24,021.15
应付利息		107,975.00	749,114.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	370,000.00	134,240.00
负债合计		127,061,693.23	1,176,831,150.51
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	626,530,066.12	3,386,953,841.60
未分配利润	7.4.7.10	2,805,499.27	25,917,925.01
所有者权益合计		629,335,565.39	3,412,871,766.61
负债和所有者权益总计		756,397,258.62	4,589,702,917.12

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.004元,基金份额总额626,530,066.12份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实增强收益定期开放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9月24日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		150,550,896.37	39,105,277.20
1.利息收入		176,707,586.83	42,979,775.96
其中:存款利息收入	7.4.7.11	4,945,989.25	3,374,852.40
债券利息收入		157,161,195.47	32,018,068.63
资产支持证券利息收入		5,085,586.27	538,740.48
买入返售金融资产收入		9,514,815.84	7,048,114.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-24,956,506.18	-697,882.63
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	-22,705,771.82	-701,302.63
资产支持证券投资收益		-2,250,734.36	3,420.00
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	-1,595,572.34	-3,177,001.39
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	395,388.06	385.26
减:二、费用		73,626,416.01	13,183,391.60
1.管理人报酬		21,711,239.74	7,283,236.65
2.托管费		5,427,809.90	1,820,809.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	102,072.67	44,287.95
5.利息支出		45,919,901.44	3,860,680.30
其中:卖出回购金融资产支出		45,919,901.44	3,860,680.30
6.其他费用	7.4.7.19	465,392.26	174,377.53
三、利润总额		76,924,480.36	25,921,885.60
减:所得税费用		-	-
四、净利润		76,924,480.36	25,921,885.60

注:本基金合同生效日为2012年9月24日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年9月24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:嘉实增强收益定期开放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)	3,386,953,841.60	25,917,925.01	3,412,871,766.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	76,924,480.36	76,924,480.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,760,423,775.48	4,651,141.03	-2,755,772,634.45
其中:1.基金申购款	4,106,569.39	57,286.32	4,163,855.71
2.基金赎回款	-2,764,530,344.87	4,593,854.71	-2,759,936,490.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-104,688,047.13	-104,688,047.13
五、期末所有者权益(基金净值)	626,530,066.12	2,805,499.27	629,335,565.39
项目	上年度可比期间 2012年9月24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)	3,387,448,915.83	-	3,387,448,915.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,921,885.60	25,921,885.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-495,074.23	-3,960.59	-499,034.82
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-495,074.23	-3,960.59	-499,034.82
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)	3,386,953,841.60	25,917,925.01	3,412,871,766.61

注:本基金合同生效日为2012年9月24日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2012年9月24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、基金注册登记机构、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9月24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9月24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	21,711,239.74	7,283,236.65
其中:支付销售机构的客户维护费	5,954,632.43	2,035,064.72

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0.8%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×0.8% / 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9月24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	5,427,809.90	1,820,809.17

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	50,007,063.01	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年9月24日(基金合同生效日)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	50,065,426.30	-	240,000,000.00	14,160.00	-	-

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9月24日(基金合同生效日)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9月24日(基金合同生效日)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	960,698.85	221,631.68	8,281,605.37	376,841.32

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9月24日(基金合同生效日)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

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票

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股票。

7.4.5.1.2 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
124461	13清远债	2013年12月20日	2014年1月6日	未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	网下申购

7.4.5.1.3 受限证券类别:其他

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(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

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额94,999,657.50元,是以如下债券作为质押:

单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041354054	13大唐潮州CP001	2014年1月2日	99.37	200,000	19,874,000.00
041361045	13沪电力CP001	2014年1月2日	99.28	200,000	19,856,000.00
011316004	13华电股SCP004	2014年1月2日	99.83	300,000	29,949,000.00
011367001	13神华能源SCP001	2014年1月2日	99.47	300,000	29,841,000.00
合计				1,000,000	99,520,000.00

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30,000,000.00元,于2014年1月2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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	569,586,008.00	75.30
	其中:债券	494,197,008.00	65.34
	资产支持证券	75,389,000.00	9.97
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	176,544,146.32	23.34
7	其他各项资产	10,267,104.30	1.36
	合计	756,397,258.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

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

报告期末,本基金未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内(2013年1月1日至2013年12月31日),本基金未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期