

嘉实信用债券型证券投资基金

[2015] 第一季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中银银行股份有限公司

报告送出日期:2015年4月21日

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人和基金管理人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。

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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金的财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

嘉实信用债券

基金代码 07025

契约型开放式

基金合同期限 2011年8月1日至2014年7月31日

报告期末基金份额总额 965,073,827.64份

投资目标 在基金有效控制风险和保持资产流动性的基础上,追求长期稳健增值。

本基金在深入研究的基础上,严控信用分析和积极主动的

投资风险,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。

本报告期基金的财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

嘉实信用债券 A 嘉实信用债券 C

1.本期已实现收益 -917,145.64 -1,306,830.20

2.本期利润 1,183,799.97 256,037.30

3.加权平均基金份额本期利润 0.0021

4.期末基金资产净值 614,431,000.00 329,362,758.78

5.期末基金份额净值 1.0003

6.期末可供分配基金份额利润 0.0000

7.期末可供分配金额 36,544,038.18份 30,530,889.46份

报告期利润自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

嘉实信用债券 A 嘉实信用债券 C

1.本期已实现收益 -917,145.64 -1,306,830.20

2.本期利润 1,183,799.97 256,037.30

3.加权平均基金份额本期利润 0.0021

4.期末基金资产净值 614,431,000.00 329,362,758.78

5.期末基金份额净值 1.0003

6.期末可供分配基金份额利润 0.0000

7.期末可供分配金额 36,544,038.18份 30,530,889.46份

报告期利润自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 3.2 报告期基金期末净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实信用债券 A

阶段 净值增长 增值收益率 业绩比较基准收益率 基准收益率差 ①-③ ②-③

过去三个月 0.27% 0.58% 0.32% -0.05% 0.46%

嘉实信用债券 C

阶段 净值增长 增值收益率 业绩比较基准收益率 基准收益率差 ①-③ ②-③

过去三个月 -0.10% -0.59% -0.20% -0.39% -0.12% -0.47%

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

嘉实信用债券 A

阶段 净值增长 增值收益率 业绩比较基准收益率 基准收益率差 ①-③ ②-③

过去三个月 0.27% 0.58% 0.32% -0.05% 0.46%

图1:嘉实信用债券 A 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图 (2011年9月14日至2015年3月31日)

嘉实信用债券 C

阶段 净值增长 增值收益率 业绩比较基准收益率 基准收益率差 ①-③ ②-③

过去三个月 -0.10% -0.59% -0.20% -0.39% -0.12% -0.47%

图2:嘉实信用债券 C 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图 (2011年9月14日至2015年3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指标将符合基金合同(十四)“投资范围和投资限制”和“投资禁止行为”与限制2.基金投资组合比例的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

单位:本基金的基金经理期

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

胡永青 基金经理 经理 2014年1月28日 - 12年

注:(1)基金经管日期是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规则》的有关规定。

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,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公公平交易专项说明

4.3.1 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.3 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.4 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.5 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.6 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.7 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.8 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.9 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.10 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.11 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.12 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.13 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.14 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.15 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.16 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.17 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.18 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.19 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.20 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.21 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.22 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.23 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.24 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.25 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.26 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.27 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.28 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.29 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.30 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.31 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.32 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.33 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.34 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.35 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.36 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.37 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.38 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.39 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.40 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.41 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.42 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.43 公公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同的规定,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.