

嘉实多利分级债券型证券投资基金

[2014]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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

§ 1 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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等,内容保证原则不存在虚假记载、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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

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

报告期末基金份额总额:316,279,068.16份

基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下,力争取得稳定增值。

本基金在严格控制组合久期等风险的前提下,通过资产配置、久期管理、资产选择、投资组合构建等方法,在控制组合风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金在有效控制风险的前提下,通过资产配置、久期管理、资产选择、投资组合构建等方法,在控制组合风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

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:本基金为债券基金,其预期风险和预期收益低于股票基金,混合型基金,高于货币市场基金。

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

下属分级基金的基金简称:嘉实多利分级债券

基金主代码:160718

下属分级基金的交易代码:150032

报告期末下属分级基金的份额总额:194,555,783.16份

总份额:97,378,628.00份

24,344,657.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)

1.本期已实现收益 630,850.61

2.本期利润 2,360,190.81

3.期初平均基金份额总额 0.0070

4.期末基金份额净值 286,184.9688

5.期末基金净值 0.9048

注: (1)本期已实现收益指本期利息收入、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)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的交易费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金价值表现

3.2.1 报告期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

嘉实多利分级债券基金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2014年3月31日)

注:基金管理人和招募说明约定的约定,本基金基金合同生效日起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、投资范围和(五)投资限制(2)基金投资组合限制”的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

王茜 基金经理,嘉实多利分级债券基金经理,嘉实基金管理有限公司固收组成员,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任日期即指公司作出决定后任职之日;(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,本基金管理人严格按照《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

和谨慎运作,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约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司内部

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时公平对待各投资组合,通过完善交易流程内部分割和集中管理,公平对待各投资组合。

4.3.2 基金投资的前十名股票中没有超出基金合同“投资限制(2)投资组合限制”的股票。

4.4 公平交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生异常交易行为。

4.4.1 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.2 报告期内本基金的公平交易说明

4.5 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,本基金运作符合有关法律法规和基金合同的规定。

4.6 管理人对本基金年度投资收益的预测

本基金年度投资收益预测为0.9048元;本报告期基金份额净值增长率为0.977%,业绩比较基

准收益率为1.40%。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

4.8 其他需要说明的事项

4.9 报告期内本基金的利润分配情况

4.10 报告期内本基金的费用情况

4.11 报告期内本基金的交易费用

4.12 报告期内本基金的税收情况

4.13 报告期内本基金的费用情况

4.14 报告期内本基金的费用情况

4.15 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

4.16 其他需要说明的事项

4.17 报告期内本基金的利润分配情况

4.18 报告期内本基金的费用情况

4.19 报告期内本基金的交易费用

4.20 报告期内本基金的税收情况

4.21 报告期内本基金的费用情况

4.22 报告期内本基金的费用情况

4.23 报告期内本基金的交易费用

4.24 报告期内本基金的税收情况

4.25 报告期内本基金的费用情况

4.26 报告期内本基金的交易费用

4.27 报告期内本基金的税收情况

4.28 报告期内本基金的费用情况

4.29 报告期内本基金的交易费用

4.30 报告期内本基金的税收情况

4.31 报告期内本基金的费用情况

4.32 报告期内本基金的交易费用

4.33 报告期内本基金的税收情况

4.34 报告期内本基金的费用情况

4.35 报告期内本基金的交易费用

4.36 报告期内本基金的税收情况

4.37 报告期内本基金的费用情况

4.38 报告期内本基金的交易费用

4.39 报告期内本基金的税收情况

4.40 报告期内本基金的费用情况

4.41 报告期内本基金的交易费用

4.42 报告期内本基金的税收情况

4.43 报告期内本基金的费用情况

4.44 报告期内本基金的交易费用

4.45 报告期内本基金的税收情况

4.46 报告期内本基金的费用情况

4.47 报告期内本基金的交易费用

4.48 报告期内本基金的税收情况

4.49 报告期内本基金的费用情况

4.50 报告期内本基金的交易费用

4.51 报告期内本基金的税收情况

4.52 报告期内本基金的费用情况

4.53 报告期内本基金的交易费用

4.54 报告期内本基金的税收情况

4.55 报告期内本基金的费用情况

4.56 报告期内本基金的交易费用

4.57 报告期内本基金的税收情况

4.58 报告期内本基金的费用情况

4.59 报告期内本基金的交易费用

4.60 报告期内本基金的税收情况

4.61 报告期内本基金的费用情况

4.62 报告期内本基金的交易费用

4.63 报告期内本基金的税收情况

4.64 报告期内本基金的费用情况

4.65 报告期内本基金的交易费用

4.66 报告期内本基金的税收情况

4.67 报告期内本基金的费用情况

4.68 报告期内本基金的交易费用

4.69 报告期内本基金的税收情况

4.70 报告期内本基金的费用情况

4.71 报告期内本基金的交易费用

4.72 报告期内本基金的税收情况

4.73 报告期内本基金的费用情况

4.74 报告期内本基金的交易费用

4.75 报告期内本基金的税收情况

4.76 报告期内本基金的费用情况

4.77 报告期内本基金的交易费用

4.78 报告期内本基金的税收情况

4.79 报告期内本基金的费用情况

4.80 报告期内本基金的交易费用

4.81 报告期内本基金的税收情况

4.82 报告期内本基金的费用情况

4.83 报告期内本基金的交易费用

4.84 报告期内本基金的税收情况

4.85 报告期内本基金的费用情况

4.86 报告期内本基金的交易费用

4.87 报告期内本基金的税收情况

4.88 报告期内本基金的费用情况

4.89 报告期内本基金的交易费用

4.90 报告期内本基金的税收情况

4.91 报告期内本基金的费用情况

4.92 报告期内本基金的交易费用

4.93 报告期内本基金的税收情况

4.94 报告期内本基金的费用情况

4.95 报告期内本基金的交易费用

4.96 报告期内本基金的税收情况