

信息披露 Disclosure

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2014 年 度 报 告 摘 要

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年末 2013年12月31日
银行存款	6.4.7.1	63,477,276.88	1,812,718,637.93
结算备付金	—	273,822,806.99	—
存出保证金	—	253,447,593.53	—
交易性金融资产	6.4.7.2	2,108,059,935.92	—
其中：股票投资	—	2,108,059,935.92	—
资产支持证券投资	—	—	—
贵金属投资	—	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.3	—	246,000,000.00
应收利息	—	20,008,444.44	98,082,083.03
应收股利	6.4.7.5	162,233.38	7,660,148.46
应收申购款	—	—	—
其他资产	—	—	—
资产总计	6.4.7.6	2,718,978,883.34	2,164,460,866.42
负债和所有者权益	附注号	2014年6月30日	2013年12月31日
负债：	—	—	—
交易性金融负债	—	—	—
衍生金融负债	—	—	—
应付证券清算款	6.4.7.3	—	—
应付利息	—	3,550,128.08	1,478,571.31
应付股利	—	638,100.45	309,642.84
应付赎回款	—	—	—
其他负债	—	—	—
所有者权益	—	—	—
实收基金	—	—	—
未分配利润	—	—	—
所有者权益合计	—	—	—

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年12月31日
报告期发生的基金应支付的管理费	—	19,273,801.15	—
其中：支付销售机构的客户维护费	—	5,695,174.45	—
(注：支付销售机构的客户维护费按照前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，于次月月初支付，计算公式为：(日基金资产净值×0.25%)/当年天数)	—	—	—
报告期发生的基金应支付的托管费	—	3,491,254.79	—
其中：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按照前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，于次月月初支付，计算公式为：(日基金资产净值×0.25%)/当年天数)	—	—	—
6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易	—	—	—
6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.6 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.7 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.9 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.10 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.50 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.51 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.52 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.53 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.54 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.55 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.56 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.57 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.58 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.59 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.60 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.61 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.62 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.63 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.64 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.65 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.66 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.67 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.68 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.69 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.70 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.71 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.72 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.73 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.74 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.75 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.76 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.77 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.78 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.79 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.80 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.81 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.82 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.83 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.84 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.85 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.86 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.87 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.88 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.89 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.90 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.91 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.92 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.93 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.94 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.95 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.96 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.97 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.98 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.99 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—
6.4.7.4.100 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况	—	—	—

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.030元，基金份额总额2,633,496,051.61份。

会计主体：嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年12月31日
一、收入	—	92,148,232.85	—
1.利息收入	—	30,253,653.41	—
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,344,164.08	—
债券利息收入	—	—	—
资产支持证券利息收入	—	—	—
买入返售金融资产收入	—	10,909,489.35	—
2.投资收益	—	10,653,578.64	—
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,673,975.70	—
基金投资收益	—	—	—
3.公允价值变动收益	6.4.7.13	3,986,213.18	—
其中：卖出金融资产公允价值变动收益	—	—	—
其他公允价值变动收益	—	—	—
4.公允价值变动收益	6.4.7.14	-4,882,500.00	—
5.其他收入	—	29,205,654.34	—
其中：公允价值变动收益	6.4.7.15	48,879,820.65	—
6.其他收入	—	—	—
7.其他收入	—	—	—
8.其他收入	—	—	—
9.其他收入	—	—	—
10.其他收入	—	—	—
11.其他收入	—	—	—
12.其他收入	—	—	—
13.其他收入	—	—	—
14.其他收入	—	—	—
15.其他收入	—	—	—
16.其他收入	—	—	—
17.其他收入	—	—	—
18.其他收入	—	—	—
19.其他收入	—	—	—
20.其他收入	—	—	—
21.其他收入	—	—	—
22.其他收入	—	—	—
23.其他收入	—	—	—
24.其他收入	—	—	—
25.其他收入	—	—	—
26.其他收入	—	—	—
27.其他收入	—	—	—
28.其他收入	—	—	—
29.其他收入	—	—	—
30.其他收入	—	—	—
31.其他收入	—	—	—
32.其他收入	—	—	—
33.其他收入	—	—	—
34.其他收入	—	—	—
35.其他收入	—	—	—
36.其他收入	—	—	—
37.其他收入	—	—	—
38.其他收入	—	—	—
39.其他收入	—	—	—
40.其他收入	—	—	—
41.其他收入	—	—	—
42.其他收入	—	—	—
43.其他收入	—	—	—
44.其他收入	—	—	—
45.其他收入	—	—	—
46.其他收入	—	—	—
47.其他收入	—	—	—
48.其他收入	—	—	—
49.其他收入	—	—	—
50.其他收入	—	—	—
51.其他收入	—	—	—
52.其他收入	—	—	—
53.其他收入	—	—	—
54.其他收入	—	—	—
55.其他收入	—	—	—
56.其他收入	—	—	—
57.其他收入	—	—	—
58.其他收入	—	—	—
59.其他收入	—	—	—
60.其他收入	—	—	—
61.其他收入	—	—	—
62.其他收入	—	—	—
63.其他收入	—	—	—
64.其他收入	—	—	—
65.其他收入	—	—	—
66.其他收入	—	—	—
67.其他收入	—	—	—
68.其他收入	—	—	—
69.其他收入	—	—	—
70.其他收入	—	—	—
71.其他收入	—	—	—
72.其他收入	—	—	—
73.其他收入	—	—	—
74.其他收入	—	—	—
75.其他收入	—	—	—
76.其他收入	—	—	—
77.其他收入	—	—	—
78.其他收入	—	—	—
79.其他收入	—	—	—
80.其他收入	—	—	—
81.其他收入	—	—	—
82.其他收入	—	—	—
83.其他收入	—	—	—
84.其他收入	—	—	—
85.其他收入	—	—	—
86.其他收入	—	—	—
87.其他收入	—	—	—
88.其他收入	—	—	—
89.其他收入	—	—	—
90.其他收入	—	—	—
91.其他收入	—	—	—
92.其他收入	—	—	—
93.其他收入	—	—	—
94.其他收入	—	—	—
95.其他收入	—	—	—
96.其他收入	—	—	—
97.其他收入	—	—	—
98.其他收入	—	—	—
99.其他收入	—	—	—
100.其他收入	—	—	—

注：本基金截至2014年6月30日止，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

1	本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	65,175,771.34	65,175,771.34
2	本期公允价值变动损益	477,967,091.61	7,352,897.04
3	其中:上市股票申购款	1,626,642,930.42	29,898,402.22
4	2.基金赎回款	-1,148,675,838.82	-22,545,505.18
5	本期基金净值变动数(本期净资产变动数)	-	-
6	期末所有者权益(基金净值)	2,633,496,081.61	79,612,360.52
7			2,713,108,412.13