

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

[2014]第三季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月21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。

本报告期中的财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金
基金主代码	000183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月30日
报告期末基金份额总额	88,623,514.25份

投资目标 本基金在审慎的投资管理及风险管理下，力争当期总回报最大化，以谋求长期增值。

投资策略 本基金将通过深入研究宏观经济、行业及个股的配置，结合对宏观经济、行业及个股的深入研究，自下而上地选择具备投资价值的股票，对投资组合类属资产的配置进行优化配置和动态调整，在规避基金组合风险的前提下进一步提高基金的总回报。

业绩比较基准 一年期定期存款利率+0.5%

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。

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

§ 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

主要财务指标		报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
1.本期已实现收益		15,290,869.68	
2.本期利润		12,684,461.99	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0244	
4.期末基金资产净值		95,616,371.66	1.07%

注: (1) 本期已实现收益指基金本期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。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的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值增长率①	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	2.86%	0.67%	0.01%	0.01%	1.97%	0.66%

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



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。

2)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。

3)2014年1月19日,本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期开放债券基金基金经理变更的公告》,万晓西先生、刘宁女士不再担任本基金基金经理。

§ 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间	证券从业年限	说明
胡永青	本基金、嘉实增益债券型基金基金经理,嘉实元和基金经理	2014年3月28日	-	11年 曾任天安保险资产管理有限公司固定收益组合经理,信诚基金管理有限公司投资经理,信诚基金管理有限公司基金经理,基金经理,2013年11月加入嘉实基金管理有限公司担任宏观策略研究员,基金经理,目前基金管理公司基金经理。
刘宁	本基金、嘉实增益债券型基金基金经理,嘉实元和基金经理,嘉实丰益策略定期开放债券型基金基金经理	2013年7月30日	1910年	10年 2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多业务部门工作,先后担任债券交易员、基金经理助理、机构投资部基金经理,现任基金经理。
万晓西	本基金、嘉实信用债券型基金基金经理,嘉实丰益策略定期开放债券型基金基金经理,嘉实丰益信用债券型基金基金经理,嘉实丰益信用债券型基金基金经理,嘉实丰益信用债券型基金基金经理	2013年9月4日	14年	2008年7月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多业务部门工作,2008年5月开始从事债券投资工作,先后担任债券交易员、基金经理助理、机构投资部基金经理,现任基金经理。

注: (1) 本基金基金经理是指基金合同生效之日起,基金管理人对基金作出的决定后公告之日; (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 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作原理符合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 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易原则的执行情况

报告期内,基金管理人严格履行证监会《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,并在获取投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有平等权利,通过完善交易制度、公平的交易分配机制、交易流程控制,持续改进公平交易原则的执行情况;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,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,基金管理人严遵遵循《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.4 报告期内基金的经营业绩说明

4.4.1 报告期内基金的经营业绩和运作分析

报告期内,经济形势下行压力持续,货币政策和投资政策持续宽松,利率下行幅度较大,资金面宽松,流动性宽松,利率下行幅度较大,资产配置向低风险资产倾斜,本基金在资产配置和风险管理上,坚持长期投资,在风险控制的基础上,通过完善交易制度、公平的交易分配机制、交易流程控制,持续改进公平交易原则的执行情况;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.4.2 报告期内基金的经营业绩和运作分析

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,我们认为宏观经济企稳概率较大,结束前阶段的明显回落,低位运行的压力来自于

经济数据改善以及央行公开市场操作等,再度出现下行行情;信用债在刚性兑付需求下,充足度

充足,流动性风险相对较低,利率下行幅度较大,资产配置向低风险资产倾斜,本基金在资产配置和风险管理上,坚持长期投资,在风险控制的基础上,通过完善交易制度、公平的交易分配机制、交易流程控制,持续改进公平交易原则的执行情况;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.6 报告期内基金的经营业绩和运作分析

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.7 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配政策的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.9 管理人对报告期内基金持有人数或基金资产净值是否有重大变动情况的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.10 管理人对报告期内基金投资组合报告的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.11 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.12 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.13 管理人对基金持续经营能力的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.14 管理人对基金估值方法的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.15 管理人对基金风险评价的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.16 管理人对基金过往业绩的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.17 管理人对基金未来业绩的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.18 管理人对基金投资组合的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.19 管理人对基金资产估值的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.20 管理人对基金费用的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.21 管理人对基金收益的说明

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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。

4.22 报告期内基金的利润分配情况

报告期内,本基金运作严遵法律法规《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰益策略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取最大利益。本基金运作管理符合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