嘉实超短债证券投资基金

【2014】年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月31日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月26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2014年1月1日起至2014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	嘉实超短债证券投资基金
基金简称	嘉实超短债债券
基金主代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月26日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	938,263,615.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本金稳妥,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面,将基金的大部分资产投资于货币市场工具,保持基金资产的高流动性,同时提供稳定的收益;另一方面,通过价值挖掘,将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具,为基金资产提供超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率
风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金,低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	34,287,958.74	22,756,825.21	56,667,304.45
本期利润	43,818,494.12	20,988,442.75	50,483,066.92
加权平均基金份额本期利润	0.0459	0.0304	0.0304
本期加权平均净值利润率	4.48%	3.00%	3.00%
本期基金份额净值增长率	6.60%	2.67%	3.63%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	562,555.81	2,155,592.71	1,304,839.87
期末可供分配基金份额利润	0.0006	0.0065	0.0017
期末基金资产净值	963,096,705.27	332,452,312.42	774,076,057.53
期末基金份额净值	1.0265	1.0080	1.0085
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	33.24%	24.98%	21.73%

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)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(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	1.08%	0.05%	0.72%	0.01%	0.36%	0.04%
过去六个月	2.43%	0.04%	1.47%	0.01%	0.96%	0.03%
过去一年	6.60%	0.04%	2.97%	0.01%	3.63%	0.03%
过去三年	13.42%	0.05%	9.50%	0.01%	3.92%	0.04%
过去五年	19.30%	0.04%	15.70%	0.01%	3.60%	0.03%
自基金合同生效起至今	33.24%	0.04%	27.83%	0.01%	5.41%	0.03%

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

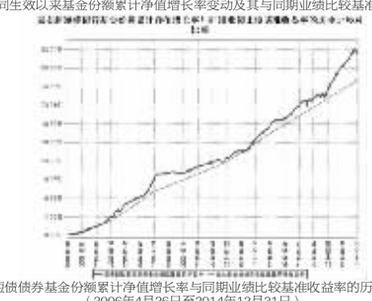
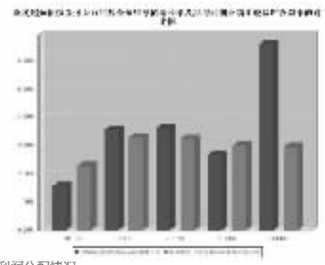


图:嘉实超短债债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2014年12月31日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定:(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年;(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%,投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

3.2.3 过去五年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



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
2014	0.4670	30,357,277.30	14,156,672.02	44,513,949.32	
2013	0.2720	11,433,974.87	9,366,820.74	20,800,795.61	
2012	0.3480	37,990,871.56	20,506,354.17	58,497,225.73	
合计	1.0870	79,782,123.73	44,029,846.93	123,811,970.66	

§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2014年12月31日,基金管理人共管理25只封闭式证券投资基金、66只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和封闭、嘉实元和、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300指数(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、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金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		
魏莉	本基金基金经理,嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实理财宝7天债券、嘉实1个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2009年1月16日	-	11年	曾任职于国家开发银行国际金融局,中国银行澳门分行资金部经理,2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士,CFA,CPA,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期、离职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

在报告期内,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、《嘉实超短债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,及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

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7次,均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易,不存在利益输送等异常交易行为。

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

2014年,市场以11月中旬为分界点,资金面先松后紧,债券市场先涨后跌。资金面是贯穿全年市场的关键性主导因素。整体看,11月之前市场流动性保持中性偏宽松,只是在春节期间、财政集中缴税、季末银行争存存款、IPO集中发行等时点呈现短期阶段性紧张,但在央行的引导和调控下,资金成本的波动仍在可控范围内。1季度外汇占款增加,央行重启了正回购,但数量有限,市场流动性持续宽松;2-4季度央行则公开市场通过回购缩量、国库现金招标、央票到期等方式净投放资金,正回购利率也逐步下行,并且间接引导银行间市场回购开盘利率,进行利率走廊管理。14年央行对市场资金面调控手段更具针对性和灵活性,期间两次定向下调存款准备金率,通过SLO、MLF、PSL等工具释放流动性,增加银行存款偏离度季末考核,稳定市场对资金面预期,切实增强金融对实体经济的支持。伴随各种利好消息,宽松资金面推动债券市场持续上涨,1年期国开债收益率年初5.49%,6月末下行至4.28%,11月中旬达到3.52%;同期,10年国开债收益率年初5.82%,6月末下行至4.96%,11月中旬达到3.85%。但是11月中下旬开始,因财政税款上缴、股票IPO集中发行,股市上涨分流资金等因素影响,资金面转为紧张。11月21日央行非对称降息后,股市大幅上涨,债市却短暂冲高后转为回调。12月8日中证登发布通知加强交易所企业债回购风险管理,更进一步引发债市暴跌,10年国开债收益率冲高到4.51%。之后市场资金面持续紧张,12月下旬银行间跨年末回购成交利率一度飙升至8%以上,推动债券收益利率全线上行,下半年涨幅全部回吐,直至年前最后一批IPO资金解冻后才略有企稳,1年国开债年末收于3.95%,10年国开债则收于4.09%。信用产品方面,全年短融收益率基本跟随基准利率波动,整体信用息差收窄,但中高信用等级和较低信用等级债券之间仍维持相对较宽的息差,原因是经济下行中对信用风险的担忧,投资偏好向高等级和国企发行的信用债集中。1年期高评级的AAA级短融收益率由年初的6.32%一度降至11月中旬4.03%,年末收于4.72%,中等评级的AA级短融收益率则由年初的7.06%一度降至4.50%,年末收于5.63%,市场下跌时不同资质等级的信用息差有所扩宽。中票和企业债收益率也波幅剧烈。

2014年,本基金秉持稳健投资原则,谨慎把握政策方向,深入分析宏观经济走势和资金面变化,灵活调整投资策略,在确保组合安全性和流动性的前提下,谨慎操作,努力创造相对稳定的投资收益。上半年判断市场形势配置较长久期,下半年利率下行后则调整为中性较短久期,降低组合承担的利率风险;在控制信用风险的前提下,选择交易所债券、银行间短融和中票进行平衡配置,并搭配不同期限的同业存款进行现金流管理,在获取稳定票息收入的同时为组合提供流动性储备。整体看,2014年本基金成功应对了市场冲击和规模波动,实现了较好回报。并且组合的持仓结构相对安全,静态收益比较高,流动性和弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

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1.0265元;本报告期基金份额净值增长率为6.60%,业绩比较基准收益率为2.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,宏观经济、货币政策和短期资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看,美国经济温和复苏,将成功结束量化宽松政策;但欧洲和日本经济差强人意;油价大跌,国际资本流动不确定性增加,由此带来的影响将错综复杂;国内经济进入新常态,经济增长中枢下移,经济结构仍需改善,改革进入攻坚年,通胀形势趋稳。综合当前国内外整体经济和货币环境,预计央行将持续稳健偏宽松的货币政策。2月5日央行已重启降准措施,未来继续降息和降准的概率增加,但会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性,运用各类创新工具进行预调微调,根据经济情况调整,全面刺激政策将非常谨慎。央行公开市场操作、回购利率和各种定向工具运用将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。从债券市场发展前景看,2015年债市供给、特别是信用债仍将增长。2015年将进一步推进利率市场化改革,更大程度发挥市场机制在资源配置中的基础性作用,过去市场中的各种隐性风险将逐步显性化,债券信用风险暴露和违约风险增加。股票市场继续上涨和IPO扩容也会对市场资金面有更多分流。2015年银行同业业务的规范和推动金融去杠杆过程仍将继续,对这方面业务的监管将在发展中不断完善,这都将对债券和资金市场带来复杂和深远影响,投资者要重点关注这方面的政策。

针对上述复杂的市场环境,本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性和流动性为首要任务,兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,平衡配置同业存款和债券投资,谨慎控制组合的信用配置,保持合理流动性资产配置,细致管理现金流,以控制利率风险和应对组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

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基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1)报告期内实施了2013年第11次基金利润分配,具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

(2)根据本基金基金合同(十八(二)收益分配原则)的约定:"6.在符合有关基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过0.001元的前提下,本基金每个月应将至少90%的可分配收益进行分红。每年分红次数不超过20次"。本基金报告期内共实施了11次分配利润,符合基金合同的约定。具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实超短债证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实超短债证券投资基金2014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(2015)第20105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:嘉实超短债证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	112,606,701.52	62,196,998.64
结算备付金		7,338,395.57	12,658,966.00
存出保证金		45,860.42	6,621.48
交易性金融资产	7.4.7.2	1,236,113,053.49	403,604,395.65
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,225,113,053.49	381,604,395.65
资产支持证券投资		11,000,000.00	22,000,000.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	30,009,832.94	6,702,483.53
应收股利		-	-
应收申购款		13,834,144.98	166,177.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,399,947,988.92	485,335,643.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		433,948,951.99	141,799,409.20
应付证券清算款		-	10,011,003.40
应付赎回款		1,072,278.26	158,172.83
应付管理人报酬		545,244.25	118,979.49
应付托管费		186,180.96	40,627.14
应付销售服务费		332,465.99	72,548.44
应付交易费用	7.4.7.7	31,109.82	14,150.39
应交税费		-	86,681.11
应付利息		195,788.71	42,158.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	539,263.67	539,600.35
负债合计		436,851,283.65	152,883,330.86
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	938,263,615.86	329,810,299.25
未分配利润	7.4.7.10	24,833,089.41	2,642,013.17
所有者权益合计		963,096,705.27	332,452,312.42
负债和所有者权益总计		1,399,947,988.92	485,335,643.28

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.0265元,基金份额总额938,263,615.86份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实超短债证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一.收入		64,903,619.62	37,990,750.55
1.利息收入		60,980,838.23	40,855,733.83
其中:存款利息收入	7.4.7.11	5,072,095.78	5,164,674.94
债券利息收入		54,550,466.63	33,783,550.03
资产支持证券利息收入		1,342,840.87	1,814,246.57
买入返售金融资产收入		15,434.95	93,262.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-5,720,253.99	-1,103,510.65
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	-5,720,253.99	-1,103,510.65
资产支持证券投资收益		-	-
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	9,530,535.38	-1,768,382.46
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	112,500.00	6,909.83
减:二.费用		21,085,125.50	17,002,307.80
1.管理人报酬		3,919,116.23	2,884,976.92
2.托管费		1,338,234.88	985,114.10
3.销售服务费		2,389,705.09	1,759,132.17
4.交易费用	7.4.7.18	30,864.55	27,063.69
5.利息支出		13,022,877.35	10,952,753.75
其中:卖出回购金融资产支出		13,022,877.35	10,952,753.75
6.其他费用	7.4.7.19	384,327.40	393,267.17
三、利润总额		43,818,494.12	20,988,442.75
减:所得税费用		-	-
四、净利润		43,818,494.12	20,988,442.75

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实超短债证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	329,810,299.25	2,642,013.17	332,452,312.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,818,494.12	43,818,494.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	608,453,316.61	22,886,531.44	631,339,848.05
其中:1.基金申购款	8,408,723,667.98	212,566,006.79	8,621,289,674.77
2.基金赎回款	-7,800,270,351.37	-189,679,475.35	-7,989,949,826.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-44,513,949.32	-44,513,949.32
五、期末所有者权益(基金净值)	938,263,615.86	24,833,089.41	963,096,705.27
项目	上年度可比期间 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)	767,544,173.27	6,531,884.26	774,076,057.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,988,442.75	20,988,442.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-437,733,874.02	-4,077,518.23	-441,811,392.25
其中:1.基金申购款	6,055,632,419.33	82,343,301.42	6,137,975,720.75
2.基金赎回款	-6,493,366,293.35	-86,420,819.65	-6,579,787,113.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-20,800,795.61	-20,800,795.61
五、期末所有者权益(基金净值)	329,810,299.25	2,642,013.17	332,452,312.42

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与最近一期年度报告不一致,会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,919,116.23	2,884,976.92
其中:支付销售机构的客户维护费	917,302.38	872,441.78

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0.41%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×0.41% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,338,234.88	985,114.10

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.14%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×0.14% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
嘉实基金管理有限公司	98,425.58
中国银行	329,007.74
合计	427,433.32
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
嘉实基金管理有限公司	88,067.51
中国银行	284,221.13
合计	372,288.64

注:支付基金销售机构的销售服务费按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,按月支付给嘉实基金管理有限公司,再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25% / 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 2014年1月1日至2014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
中国银行	-	111,285,434.93	-	-	1,172,340,000.00	251,253.51
上年度可比期间 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
中国银行	50,238,973.54	40,429,348.08	-	-	1,957,870,000.00	282,864.77

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(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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(2014年12月31日)及上年度末(2013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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	2,606,701.52	48,240.96	22,196,998.64	58,929.75

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,活期银行存款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(2014年1月1日至2014年12月31日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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(2014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

本期末(2014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证券。

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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249,939,105.09元,是以如下债券作为质押:

金额单位: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
041466017	14苏城建CP001	2015年1月5日	100.16	80,000	8,012,800.00
101454068	14中能集MTN001	2015年1月5日	99.00	300,000	29,700,000.00
101355002	13陕有色MTN001	2015年1月5日	99.91	500,000	49,955,000.00
011499076	14包钢集SCP001	2015年1月5日	99.83	700,000	69,881,000.00
1282039	12铁道MTN1	2015年1月5日	100.66	500,000	50,330,000.00
1182226	11首钢