

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

合同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 托管人报告期内本基金投资运作遵守监管、净值计算、利润分配等情况的说明
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约定,对基金管理人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的复核,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 托管人对年度报告中财务信息内容的核实、准确编制及发表意见
本报告中的财务报表、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,投资组合投资数据真实、准确和完整。

5.4 审计报告
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,注册会计师许洪波、洪嘉平出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字[2015]第20126号)。

投资者可通过登录于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表
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
报告截止日:2014年12月31日

资产	附注	期末 2014年12月31日	上年末 2013年12月31日
货币资金		45,210,377.51	6,812,716,747.59
结算备付金		42,538.98	-
应收利息		-	-
应收申购款		-	-
可供出售金融资产	7.4.1.1	407,428,524.04	407,148,524.04
持有至到期投资		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产		-	-
固定资产		-	-
无形资产		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		456,677,440.53	7,226,865,271.63
负债		-	-
短期借款		-	-
应付账款		-	-
应付利息		-	-
应付赎回款		-	-
应付手续费		-	-
应付税费		-	-
其他负债		-	-
负债总计		-	-
所有者权益		-	-
实收资本		345,920,214.42	345,920,214.42
未分配利润		110,757,226.11	110,757,226.11
所有者权益合计		456,677,440.53	7,226,865,271.63

注:资产负债表中的货币资金、可供出售金融资产等项目,均按期末余额列示。

7.2 利润表
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
报告截止日:2014年12月31日

项目	附注	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年同期 2013年1月1日至2013年12月31日
一、营业收入		51,540,921.29	6,924,259.89
利息收入		33,343,209.39	8,864,752.79
公允价值变动收益		18,197,711.90	7,318,883.63
其他收入		-	-
二、营业支出		-	-
利息支出		-	-
其他支出		-	-
三、营业利润		51,540,921.29	6,924,259.89
四、利润总额		51,540,921.29	6,924,259.89
五、净利润		51,540,921.29	6,924,259.89
六、每股收益		-	-
基本每股收益		-	-
稀释每股收益		-	-
七、其他综合收益		-	-
八、综合收益总额		51,540,921.29	6,924,259.89

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.984元,基金份额总额61,632,976.20份。

注:利润表中的利息收入、利息支出、其他收入、其他支出、其他综合收益等项目,均按期末余额列示。

7.3 所有者权益(或基金净值)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
报告截止日:2014年1月1日至2014年12月31日

项目	附注	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年同期 2013年1月1日至2013年12月31日
一、所有者权益(或基金净值)		345,920,214.42	345,920,214.42
1. 实收资本(或股本)		345,920,214.42	345,920,214.42
2. 未分配利润		110,757,226.11	110,757,226.11
3. 其他综合收益		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
八、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
九、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十一、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十八、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
十九、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十一、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十八、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
二十九、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十一、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十八、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
三十九、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十一、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十八、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
四十九、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十一、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十二、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十三、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十四、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十五、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十六、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-
4. 其他所有者权益变动		-	-
五十七、所有者权益(或基金净值)变动		-	-
1. 实收资本(或股本)变动		-	-
2. 未分配利润变动		-	-
3. 其他综合收益变动		-	-</