

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2015] 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人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。

本基金的管理人和基金托管人同意将定期报告中包含的基本情况，于2015年4月17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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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未来表现。投资人应在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金简称:嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金代码:000414

运作方式:契约型开放式

合同生效日:2013年1月26日

报告期末基金份额总额:226,586,244.61份

投资目标:通过资产配置对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。

投资策略:本基金主要采用市场性的资产配置为主的多种绝对收益策略，强调系统性风险，力争实现稳健的绝对回报。

业绩比较基准:本基金的业绩基准为混合型基金，通过多种绝对收益策略的市场配置，力争在扣除一定的管理费后，取得超越业绩基准的绝对收益。

风险收益特征:本基金属于中低风险品种，其预期收益和预期风险均低于股票型基金，但高于货币市场基金，其风险收益特征介于二者之间，而相对其业绩基准，由于其收益策略对冲带来的稳定性，因此投资者一定能获得超越业绩基准的绝对收益。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期:2015年1月1日 - 2015年3月31日

1.本期已实现收益:101,509,525.98

2.本期利润:36,731,268.81

3.加权平均基金份额本期利润:0.0738

4.期末基金份额净值:239,466,066.70

注:(1)本期利润指收入扣除非经常性损益后的收入,不包含公允价值变动收益(估值调整)影响和相关费用后的余额,本期利润为本公司实际收取的本公司的公允价值变动收益。(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将低于上述列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

报告期末,本基金未持有债券。

报告期:2013年12月6日至2015年3月31日

报告期:2013年1月1日 - 2015年3月31日

报告期:2013年1月1日 - 2015年3月31日