

嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年 12月 31日

因此,本基金重点配置固定开放债期券,保持组合弹性,维持相对较高的久期,积极打,继续降低中低等级信用债配置比例。

4.6 管理人对于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约定的,日常估值由基金管理人(以下简称“本托管人”)在对基金估值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、年中估值未估值复核与基金估值会计核对相符。

4.7 托管人职责履行情况
报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人履行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的计算及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本托管人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况说明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》和其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责履行了托管人职责。

5.2 托管人报告期内本基金投资运作合规性、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》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人的投资运作履行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的计算及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本托管人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人本报告期内基金净值信息的真实、准确和完整发表意见
本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人的投资运作履行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的计算及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本托管人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 基金管理人内部控制制度的健全性及是否存在重大遗漏、虚假记载或误导性陈述等
报告期内,基金管理人内部控制制度健全,不存在重大遗漏、虚假记载或误导性陈述等。

5.5 基金管理人内部控制制度的健全性及是否存在重大遗漏、虚假记载或误导性陈述等
报告期内,基金管理人内部控制制度健全,不存在重大遗漏、虚假记载或误导性陈述等。

5.6 会计师事务所
普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师许洪洪、洪芸芸出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字[2014]第2182号)。

5.7 年度财务报表
1.1 资产负债表
单位:人民币元

Table with columns: 资产, 负债, 所有者权益, 附注号, 2013年12月31日, 2013年9月30日. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

1.2 利润表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 本期 2013年12月31日, 上期 2013年9月30日. Rows include 利息收入, 公允价值变动损益, 其他业务收入, etc.

2.1 现金流量表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 本期 2013年12月31日, 上期 2013年9月30日. Rows include 经营活动产生的现金流量, 筹资活动产生的现金流量, 投资活动产生的现金流量, etc.

2.2 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 2013年5月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日, 2013年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

2.3 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 2013年5月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日, 2013年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

2.4 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 2013年5月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日, 2013年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

2.5 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 2013年5月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日, 2013年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

8.1 报告期内本基金持有以上只限资产支持证券:
8.2 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
8.3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.4 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
8.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.7 投资组合报告附注
8.8 投资组合报告附注
8.9 投资组合报告附注
8.10 投资组合报告附注
8.11 投资组合报告附注

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人数量
9.2 期末基金份额持有人户数及持有人数量
9.3 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.4 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.5 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.6 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.7 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.8 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.9 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.10 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.11 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.12 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.13 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.14 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.15 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.16 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.17 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.18 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.19 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.20 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.21 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.22 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.23 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.24 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.25 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.26 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.27 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.28 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.29 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.30 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.31 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.32 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.33 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.34 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.35 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.36 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.37 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.38 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.39 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.40 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.41 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.42 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.43 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.44 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.45 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.46 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.47 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.48 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.49 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.50 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.51 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.52 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.53 期末基金份额持有人户数及持有人数量

9.54 期末基金份额持有人户数及持有人数量

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券简称, 数量(份), 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%), 0.17. Rows include 1, 119029, 招商10, 50,560, 5,096,000.00, etc.

Table with columns: 序号, 债券品种, 名称, 金额. Rows include 1, 国债期货, 342,784.08, etc.

Table with columns: 序号, 持有份额, 占基金份额比例, 持有份额, 占基金份额比例. Rows include 119004, 277,028.97, 518,702.6198, 17.02%, etc.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

Table with columns: 项目, 持有份额(数量), 占基金份额比例. Rows include 基金管理人, 9,041.76, 0.009%.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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