

嘉实黄金证券投资基金(QDII-FOF)

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2014年4月22日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告期内,严格按照法律法规及基金合同的规定,恪尽职守,勤勉尽责,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。

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 境外资产托管人.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日), 单位:人民币元.

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)所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可能低于所列数字。

3.2.1 本报告期末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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④.

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变动的比较

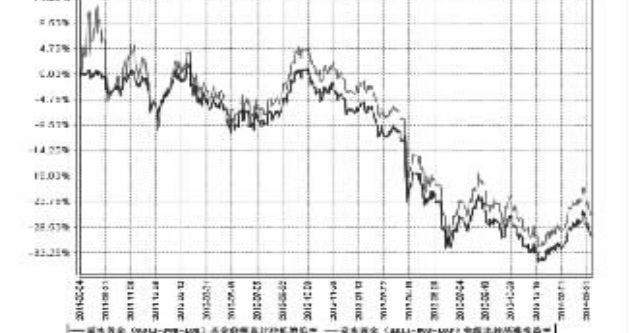


图:嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年8月4日至2014年3月31日)

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之日起3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“(二)投资组合限制(六)投资限制(2)投资组合限制”的有关规定;注:2.自2014年3月11日,本基金管理人发布《关于嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金变更的公告》,杨阳先生不再担任本基金基金经理,聘请杨宇先生担任本基金基金经理职务。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明.

注:(1)基金经理的任职日期是指基金基金合同生效之日;基金经理杨宇的任职日期是指公司作出决定后公告之日;基金经理杨宇作出决定后公告之日;(2)证券从业的合法通过行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实黄金证券投资基金(L0F)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

报告期内,基金管理人严格执行证监会《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,各投资组合按照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;通过交易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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年一季度,国际黄金市场呈现震荡上扬的格局,在经历了2013年度的下跌盘整后,国际黄金价格在2014年初的1200美元附近开始持续反弹,在3月17日达到近期峰值1240美元,受到乌克兰局势继续升级、避险情绪的缓解以及美联储加息预期的调整影响,2014年3月中下旬黄金价格出现高位跳水,回落至1300美元左右,随着美联储加息预期的调整,核心通胀在2014年呈现双向上升趋势,这将对黄金价格产生正面支撑,尽管乌克兰局势仍对金价产生扰动,但是乌克兰局势未来发展的不确定性也让更多的避险资金倾向于选择黄金这一天然的对冲品种。

4.5 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球地缘政治紧张局势持续升级的环境下,东北亚军事紧张及朝鲜半岛局势和火箭推进技术地区紧张局势,都给国际黄金价格提供支撑,同时,在各国央行增加黄金储备、美国就业复苏不可能一蹴而就等多重因素的共同作用下,黄金作为同一时期具有贵金属和货币特征的投资品,将发挥其对冲货币贬值的作用,投资黄金具有其长期投资价值。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 投资组合报告.

5.2 投资组合报告

5.2.1 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末,本基金未持有行业分类的股票及存托凭证。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

报告期末,本基金未持有金融衍生品。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

Table with 6 columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%)

注:报告期末,本基金仅持有上述6只基金。

5.10 投资组合报告

5.10.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例(%)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 221,074,665.00

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或购买本基金基金份额。

8.1 备查文件目录

- (1)中国证监会核准嘉实黄金证券投资基金(L0F)募集的文件;
- (2)《嘉实黄金证券投资基金(L0F)基金合同》;
- (3)《嘉实黄金证券投资基金(L0F)托管协议》;
- (4)《嘉实黄金证券投资基金(L0F)招募说明书》;
- (5)基金管理人业务资格批复、营业执照;
- (6)报告期内嘉实黄金证券投资基金(L0F)公告的所有报告。

8.2 存放地点

北京市建国门内大街9号华润大厦嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)纸质查阅:查阅时间:每日上午9:30-11:30,13:00-17:30,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查阅:投资者可通过网站: http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8880,或电邮: E-mail:service@jsfund.cn.

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2014年4月22日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告期内,严格按照法律法规及基金合同的规定,恪尽职守,勤勉尽责,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。

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 境外资产托管人.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日), 单位:人民币元.

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)所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可能低于所列数字。

3.2.1 本报告期末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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④.

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变动的比较

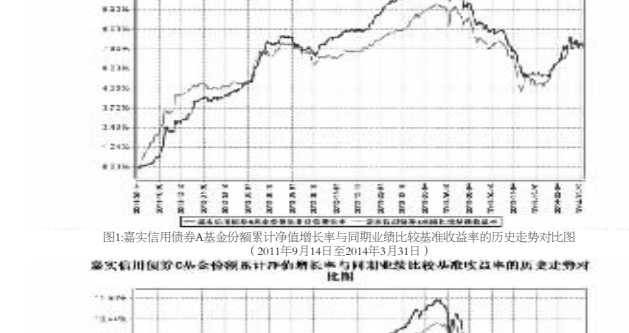


图:嘉实信用债(CA)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年9月4日至2014年3月31日)

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之日起3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“(四)投资组合限制(2)投资组合限制”的有关规定;注:2.自2014年3月11日,本基金管理人发布《关于嘉实信用债(CA)基金变更的公告》,聘请杨宇先生担任本基金基金经理职务,与现任基金经理杨宇先生共同管理本基金。

5.11 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.12 本基金基金经理杨宇先生,没有担任基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 410,527,254.74

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或购买本基金基金份额。

8.1 备查文件目录

- (1)中国证监会核准嘉实信用债(CA)募集的文件;
- (2)《嘉实信用债(CA)基金合同》;
- (3)《嘉实信用债(CA)托管协议》;
- (4)《嘉实信用债(CA)招募说明书》;
- (5)基金管理人业务资格批复、营业执照;
- (6)报告期内嘉实信用债(CA)公告的所有报告。

8.2 存放地点

北京市建国门内大街9号华润大厦嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)纸质查阅:查阅时间为工作日上午9:30-11:30,13:00-17:30,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查阅:投资者可通过网站: http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8880,或电邮: E-mail:service@jsfund.cn.

嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2014年4月22日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告期内,严格按照法律法规及基金合同的规定,恪尽职守,勤勉尽责,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。

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 境外资产托管人.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日), 单位:人民币元.

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)所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可能低于所列数字。

3.2.1 本报告期末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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④.

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变动的比较

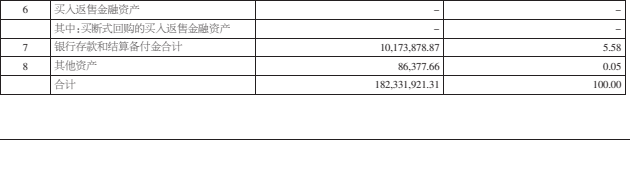


图:嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年8月11日至2014年3月31日)

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之日起3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“(二)投资组合限制(六)投资限制(2)投资组合限制”的有关规定;注:2.自2014年3月11日,本基金管理人发布《关于嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更的公告》,杨阳先生不再担任本基金基金经理,聘请杨宇先生担任本基金基金经理职务。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明.

注:(1)基金经理的任职日期是指基金基金合同生效之日;基金经理杨宇的任职日期是指公司作出决定后公告之日;基金经理杨宇作出决定后公告之日;(2)证券从业的合法通过行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金(L0F)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

报告期内,基金管理人严格执行证监会《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,各投资组合按照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;通过交易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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年一季度,沪深两市市场呈现震荡上扬的格局,在经历了2013年度的下跌盘整后,沪深两市在2014年初的2000点附近开始持续反弹,在3月17日达到近期峰值2100点,受到乌克兰局势继续升级、避险情绪的缓解以及美联储加息预期的调整影响,2014年3月中下旬沪深两市出现高位跳水,回落至2000点左右,随着美联储加息预期的调整,核心通胀在2014年呈现双向上升趋势,这将对沪深两市产生正面支撑,尽管乌克兰局势仍对两市产生扰动,但是乌克兰局势未来发展的不确定性也让更多的避险资金倾向于选择沪深两市这一天然的对冲品种。

4.5 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球地缘政治紧张局势持续升级的环境下,东北亚军事紧张及朝鲜半岛局势和火箭推进技术地区紧张局势,都给沪深两市提供支撑,同时,在各国央行增加黄金储备、美国就业复苏不可能一蹴而就等多重因素的共同作用下,沪深两市作为同一时期具有贵金属和货币特征的投资品,将发挥其对冲货币贬值的作用,投资沪深两市具有其长期投资价值。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 投资组合报告.

5.2 投资组合报告

5.2.1 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末,本基金未持有行业分类的股票及存托凭证。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

报告期末,本基金未持有金融衍生品。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

Table with 6 columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%)

注:报告期末,本基金仅持有上述6只基金。

5.10 投资组合报告

5.10.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例(%)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 256,714,201.64

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或购买本基金基金份额。

8.1 备查文件目录

- (1)中国证监会核准嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;
- (2)《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金(L0F)基金合同》;
- (3)《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金(L0F)托管协议》;
- (4)《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金(L0F)招募说明书》;
- (5)基金管理人业务资格批复、营业执照;
- (6)报告期内嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的所有报告。

8.2 存放地点

北京市建国门内大街9号华润大厦嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)纸质查阅:查阅时间为工作日上午9:30-11:30,13:00-17:30,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查阅:投资者可通过网站: http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8880,或电邮: E-mail:service@jsfund.cn.

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2014年4月22日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告期内,严格按照法律法规及基金合同的规定,恪尽职守,勤勉尽责,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。

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 境外资产托管人.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日), 单位:人民币元.

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)所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可能低于所列数字。

3.2.1 本报告期末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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④.

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变动的比较

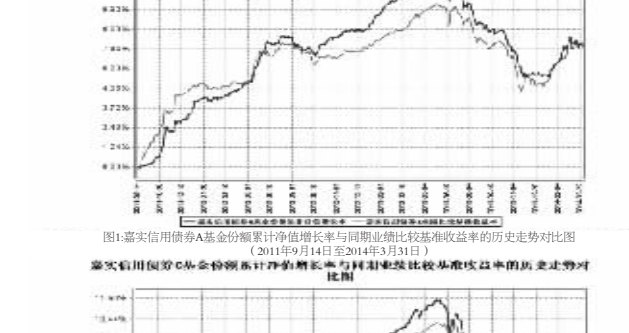


图:嘉实信用债(CA)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年9月4日至2014年3月31日)

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之日起3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“(四)投资组合限制(2)投资组合限制”的有关规定;注:2.自2014年3月11日,本基金管理人发布《关于嘉实信用债(CA)基金变更的公告》,聘请杨宇先生担任本基金基金经理职务,与现任基金经理杨宇先生共同管理本基金。

5.11 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.12 本基金基金经理杨宇先生,没有担任基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票及存托凭证。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 410,527,254.74

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或购买本基金基金份额。

8.1 备查文件目录

- (1)中国证监会核准嘉实信用债(CA)募集的文件;
- (2)《嘉实信用债(CA)基金合同》;
- (3)《嘉实信用债(CA)托管协议》;
- (4)《嘉实信用债(CA)招募说明书》;
- (5)基金管理人业务资格批复、营业执照;
- (6)报告期内嘉实信用债(CA)公告的所有报告。

8.2 存放地点

北京市建国门内大街9号华润大厦嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)纸质查阅:查阅时间为工作日上午9:30-11:30,13:00-17:30,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查阅:投资者可通过网站: http://www.jsfund.cn

</