

嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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作为其未来表现的预测。
投资者有风险,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。

2 基金产品概况

基金名称	嘉实丰益信用定期债券
基金代码	000177
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	670,943,915.26份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以求谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过密切跟踪经济周期走势,深入分析财政及货币政策对经济运行的影响,结合各主要资产品种的期限结构、流动性及估值等因素配置,做出投资组合决策,并定期对投资组合资产配置进行优化再平衡调整,力求基金投资组合的相对超额收益最大化。
业绩比较基准	中证中债综合财富指数收益率+1.5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)
1.本期已实现收益	6,222,004.67
2.本期利润	11,850,056.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174
4.期末基金资产净值	678,947,340.17
5.期末基金份额净值	1.017

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) 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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

期间	净值增长率①	净值增长率与基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.75%	0.05%	1.02%	0.01%	0.73%
①-③				0.73%	0.61%

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

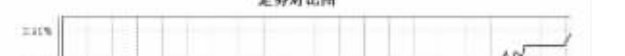


图:嘉实丰益信用定期债券基金基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同生效日2013年8月21日至报告期末未满一年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6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“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
刘宁	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年8月21日	-	9年	经济学硕士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2005年开始从事投资管理相关工作,先后担任债券研究员、基金经理助理、基金经理等职务,具有基金从业资格,证券投资管理经验。

注: (1) 任职日期是指基金基金合同生效之日; (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 管理人对外报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《嘉实丰益信用定期开放债券型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,在严格控制投资风险的基础上,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 公平交易制度的执行情况
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,严格执行投资管理流程和风险控制,在确保获得投资信息、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交易品种的公平交易执行机制,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;通过IT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 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金未发现异常交易行为。
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2014年第一季度,经济整体数据出现持续低于预期的走势,其中投资回落较为明显,构成经济要的下行压力;通胀水平也呈现低位徘徊。
资产面:公开市场操作央行采取了相对呵护市场的方式,在防止季节性波动方面的预调控,同时热钱前流压力较大,国内需求较为疲弱等因素使得一季度资金面情况好于预期,出现较为宽松的格局,叠加一季度常规货币投放的解释,一季度市场流动性出现了较大幅度的上升,收益率曲线整体呈现期限化下行态势。
权益面:金融、金融地产、企业盈利收益差别不大,企业盈利由于对收益较高,收益略高于其他板块,总体来看,一季度各类品种均取得不错收益。
报告期内本基金本着稳健投资原则,在风险收益匹配之间进行平衡。策略上以利率债策略为主,配置上选择确定性强的品种,维持低杠杆,另外在一季度市场情绪较好情况下,组合资金中适当拉长长期和提高杠杆水平,通过参与中期信用等级信用债波段操作方式与组合相结合。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.012元;本报告期基金份额净值增长率为1.75%,业绩比较基准收益率为1.02%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望: 一季度经济状况,我们预计将会呈现弱稳定格局,一方面前期回落的惯性仍然存在,构成对二季度一定的压力;另一方面政策微调作用将逐渐显现,对经济下行起到一定的支撑作用。因此综合来看,二季度与一季度相比,经济持续回落的趋势可能会暂时有所缓解,但并不会出现明显的回升。就金面而言,我们认为资金面为宽裕的格局已经度过,未来流动性由底部有所回升,但整体上升幅度有限,因此债市收益率仍没有实质性宽松,整体仍然是中偏弱格局,利率债在二级市场交投将逐渐下降,中期内部结构性机会,带动实体经济对资金的需求有所回升,本基金对经济基本面保持谨慎,我们认为二季度债券市场呈现震荡上行,并不存在明显的机会。在经济持续低位运行背景下,部分行业的业绩仍然会继续分化,不排除信用风险持续暴露的可能性,对于信用债整体投

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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作为其未来表现的预测。
投资者有风险,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。

本报告期间的财务资料未经审计。
本报告自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	嘉实丰益策略定期债券
基金代码	000183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月10日
报告期末基金份额总额	683,209,795.62份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过密切跟踪经济周期走势,深入分析财政及货币政策对经济运行的影响,结合各主要资产品种的期限结构、流动性及估值等因素配置,做出投资组合决策,并定期对投资组合资产配置进行优化再平衡调整,力求基金投资组合的相对超额收益最大化。
业绩比较基准	中证中债综合财富指数收益率+0.5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)
1.本期已实现收益	7,513,803.89
2.本期利润	7,519,283.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	694,694,030.20
5.期末基金份额净值	1.017

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) 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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

期间	净值增长率①	净值增长率与基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.09%	0.09%	0.67%	0.01%	0.22%
①-③				0.22%	0.06%

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:嘉实丰益策略定期债券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

注:本基金合同生效日2013年7月10日至报告期末未满一年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6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“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

注:2014年3月28日,本基金管理人发布《关于嘉实丰益策略定期债券基金经理变更的公告》,聘请胡青先生担任本基金基金经理职务,与现任基金经理刘宇女士、方刚先生共同管理本基金。

4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
刘宁	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年7月10日	-	9年	经济学硕士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2005年开始从事投资管理相关工作,先后担任债券研究员、基金经理助理、基金经理等职务,具有基金从业资格,证券投资管理经验。
方刚	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年9月4日	-	13年	曾任于中国银行股份有限公司总行及深圳发展银行总行,先后担任研究员、债券研究员、债券研究员,具有基金从业资格,证券投资管理经验。
胡青	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2014年3月28日	-	11年	曾任天安保险股份有限公司固定收益部副经理,现嘉实基金管理有限公司固定收益部副总监,具有基金从业资格,证券投资管理经验。

注: (1) 任职日期是指基金基金合同生效之日; (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 管理人对外报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《嘉实丰益策略定期开放债券型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,在严格控制投资风险的基础上,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 公平交易制度的执行情况
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,严格执行投资管理流程和风险控制,在确保获得投资信息、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交易品种的公平交易执行机制,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;通过IT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 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金未发现异常交易行为。
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2014年第一季度,经济下滑速度有所加剧,政府对于经济平稳运行的考量,三月末出台了“微刺激”政策,但

收益仍构成上行压力。
本基金主要配置在开放日前到期的债券和存款,降低期限长债持仓,保持组合相对较低的杠杆,降低中低信用等级债持仓比例。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	2,698,441,009.80	66.29
4	其中:债券	2,695,898,809.80	66.22
5	资产支持证券	2,542,200.00	0.06
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他	-	-
合计		2,698,441,009.80	66.21

5.2 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债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。
5.3 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投资明细
报告期末,本基金未持有股票。
5.4 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资产支持证券投资明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.5 报告期末基金投资组合公允价值(元)和占基金资产净值比例(%)

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011376701	13国债07附息01	2,000,000	200,320,000.00	4.52
2	120016	08国债01	1,527,220	151,403,216.00	6.93
3	041353204	13国债07附息01	1,200,000	120,828,000.00	5.39
4	041361812	13国债07附息01	1,200,000	120,756,000.00	5.32
5	120017	08国债02	1,134,200	112,362,767.40	3.65

5.6 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资产支持证券投资明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。
5.7 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贵金属投资明细
报告期末,本基金未持有贵金属投资。
5.8 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权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证投资。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

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

1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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作为其未来表现的预测。
投资者有风险,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。

2 基金产品概况

基金名称	嘉实丰益纯债定期债券
基金代码	000116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	3,049,549,416.39份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以求谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过密切跟踪经济周期走势,深入分析财政及货币政策对经济运行的影响,结合各主要资产品种的期限结构、流动性及估值等因素配置,做出投资组合决策,并定期对投资组合资产配置进行优化再平衡调整,力求基金投资组合的相对超额收益最大化。
业绩比较基准	中证中债综合财富指数收益率+0.25%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)
1.本期已实现收益	17,823,940.67
2.本期利润	54,566,125.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179
4.期末基金资产净值	3,077,213,515.81
5.期末基金份额净值	1.009

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) 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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

期间	净值增长率①	净值增长率与基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.80%	0.05%	0.57%	0.01%	0.93%
①-③				0.93%	0.04%

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:嘉实丰益纯债定期债券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

注:本基金合同生效日2013年8月21日至报告期末未满一年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6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“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
陈旻	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年5月21日	-	9年	曾任中国基金证券研究员和研究员,2006年加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2009年加入嘉实基金固定收益部,担任固定收益研究员、基金经理助理、基金经理,具有基金从业资格,证券投资管理经验。

注: (1) 任职日期是指基金基金合同生效之日; (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 管理人对外报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《嘉实丰益纯债定期开放债券型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,在严格控制投资风险的基础上,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 公平交易制度的执行情况
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,严格执行投资管理流程和风险控制,在确保获得投资信息、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交易品种的公平交易执行机制,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;通过IT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 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金未发现异常交易行为。
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
今年第一季度,经济整体数据出现持续低于预期的走势,其中投资回落较为明显,构成主要的下行压力。同时,通胀水平也呈现低位徘徊。在此背景下,一季度资金面也出现比较明显的宽松状况。在经济低于预期,以及资金面持续宽松的驱动下,债市整体呈现收益率先刚性化下行。
本报告期,本基金操作方向以降低仓位和降低高等信用债为主,保持基金净值稳步增长。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.009元;本报告期基金份额净值增长率为1.80%,业绩比较基准收益率为0.87%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望: 一季度经济状况,我们预计将会呈现弱稳定格局,一方面前期回落的惯性仍然存在,构成对二季度一定的压力;另一方面政策微调作用将逐渐显现,起到一定的支撑作用。因此综合来看,二季度与一季度相比,经济持续回落的趋势可能会暂时有所缓解,但并不会出现明显的回升。就金面而言,我们认为资金面为宽裕的格局已经度过,未来流动性由底部有所回升,但整体上升幅度有限,因此债市收益率仍没有实质性宽松,整体仍然是中偏弱格局,利率债在二级市场交投将逐渐下降,中期内部结构性机会,带动实体经济对资金的需求有所回升,本基金对经济基本面保持谨慎,我们认为二季度债券市场呈现震荡上行,并不存在明显的机会。在经济持续低位运行背景下,部分行业的业绩仍然会继续分化,不排除信用风险持续暴露的可能性,对于信用债整体投

嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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作为其未来表现的预测。
投资者有风险,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。

2 基金产品概况

基金名称	嘉实丰益纯债定期债券
基金代码	000116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	3,049,549,416.39份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以求谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过密切跟踪经济周期走势,深入分析财政及货币政策对经济运行的影响,结合各主要资产品种的期限结构、流动性及估值等因素配置,做出投资组合决策,并定期对投资组合资产配置进行优化再平衡调整,力求基金投资组合的相对超额收益最大化。
业绩比较基准	中证中债综合财富指数收益率+0.25%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)
1.本期已实现收益	17,823,940.67
2.本期利润	54,566,125.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179
4.期末基金资产净值	3,077,213,515.81
5.期末基金份额净值	1.009

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) 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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

期间	净值增长率①	净值增长率与基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.80%	0.05%	0.57%	0.01%	0.93%
①-③				0.93%	0.04%

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

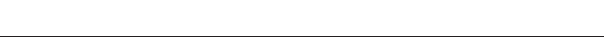


图:嘉实丰益纯债定期债券基金基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同生效日2013年8月21日至报告期末未满一年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6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“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
陈旻	本基金基金经理 固定收益部副总监兼定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年5月21日	-	9年	曾任中国基金证券研究员和研究员,2006年加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2009年加入嘉实基金固定收益部,担任固定收益研究员、基金经理助理、基金经理,具有基金从业资格,证券投资管理经验。

注: (1) 任职日期是指基金基金合同生效之日; (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 管理人对外报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《嘉实丰益纯债定期开放债券型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