

嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015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
基金管理人及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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,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内容,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,也不保证基金资产净值不受损失。
基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。
本报告期内无基金份额持有人诉讼。
本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

基金名称	嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金
基金代码	000177
基金运作方式	定期开放方式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	83,745,276.65份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下,力争当期总回报最大化,以谋求长期增值。
投资策略	本基金采用宏观经济分析、利率分析、信用分析、行业分析、公司分析等多种方法,对利率、信用、行业、公司等因素进行综合分析,在严格控制风险的前提下,力争当期总回报最大化,以谋求长期增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率+1.1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金、高收益基金。
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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日至2015年3月31日)
1.本期已实现收益	713,460.22
2.本期利润	1,763,209.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.021
4.期末基金资产净值	83,356,091.59
5.期末基金份额净值	1.019

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,本期利润为本基金本期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指标和净值。

§3.2 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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	0.32%	0.09%	0.01%	1.12%	0.31%

§3.3 自基金合同生效以来(或基金资产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)

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

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,也不保证基金资产净值不受损失。

注:本基金合同生效以来(或基金资产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)的业绩表现如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,772,172.91	3.97
2	其中:股票	5,772,172.91	3.97
3	固定收益投资	127,641,929.72	87.82
4	其中:债券	127,641,929.72	87.82
5	货币资金	127,641,929.72	87.82
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	6,752,633.59	4.65
9	其他资产	5,181,813.33	3.57
10	合计	145,348,550.05	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,772,172.91	6.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育、健康和休闲服务业	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	5,772,172.91	6.76

§3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600875	东方电气	183,775	3,982,404.25	4.67
2	600129	利源铝业	165,413	1,789,768.66	2.10

§3.5 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债券投资明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	企业债	-	-	-
3	中期债	-	-	-
4	可转债	-	-	-
5	其他	-	-	-
合计	-	-	-	-

§3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.7 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.8 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.9 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.10 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.11 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.12 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.13 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.14 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

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09880104	100,000	10,150,000.00	11.89
2	140224	140,000	10,150,000.00	11.89
3	101472005	14,000,000	8,000,000.00	9.50
4	1282130	12,000,000	8,000,000.00	9.50
5	122200	12,000,000	7,800,000.00	9.16

§3.15 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

5.11.5 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,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。	
5.6 开放式基金份额变动	