

嘉实超短债证券投资基金 2008年年度报告摘要

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3月26日核对了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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代表其未来表现。投资有风险，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及其更新。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

Table with 2 columns: Item and Description. Contains fund details like name, code, type, and management info.

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial indicators like net assets and performance.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics like return and risk for various periods.

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...

注：(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance comparison with benchmarks.

§3.2 自基金合同生效以来基金业绩表现及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

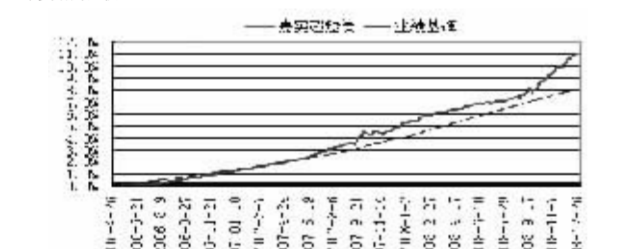


图1: 嘉实超短债基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,报告期内本基金的资产配置比例符合基金合同十三(八)项投资限制的有关规定...

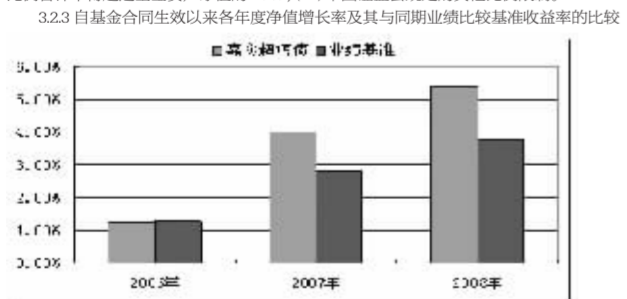


图2: 嘉实超短债基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

注:2006年实际存续期为2006年4月26日至2006年12月31日。

Table with 2 columns: Item and Value. Shows profit distribution for the last three years.

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金情况简介
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
本基金经理为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月26日,是经中国证监会批准设立的...

Table with 2 columns: Name and Position. Lists key management personnel.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他各项法律法规...

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 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本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...

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金投资组合净值增长率为5.41%,投资风格相似的嘉实货币型基金净值收益率为4.3646%...

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
截至本报告期末本基金份额净值为1.0183元,本报告期基金份额净值增长率为5.41%,同期业绩比较基准收益率为3.77%...

报告期内,伴随宏观经济环境变化和货币政策调整,债券市场走出一波先抑后扬的上升行情。年初债市短暂企稳后,因通胀预期高涨、经济过热迹象明显,上半年央行继续实施紧缩性货币政策...

报告期内,我们坚持稳健的防御型投资风格,准确判断市场走势,及时调整投资策略。抓住市场上行机遇,较为迅速地提升了组合久期和债券仓位...

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2009年,债市在承接高位之后面临诸多不确定因素。国内经济稳增长任务依然艰巨,预计央行将继续保持宽松的货币政策...

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的约定...

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金基金合同(十八、(二)收益分配原则6)的约定:“在符合有关基金分红条件且基金份额可分配收益超过0.001元的前提下...”

§4.8 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实超短债证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中...

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对本基金的投资运作进行了必要的监督...

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分不在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告
嘉实超短债证券投资基金2008年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师康玮、陈宇签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天字[2009]第20203号)。

§7 年度财务报表
7.1 资产负债表
会计主体:嘉实超短债证券投资基金
报告截止日:2008年12月31日

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2008.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the income statement for 2008.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the profit distribution for 2008.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2007.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2006.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2005.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2004.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2003.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2002.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2001.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet as of Dec 31, 2000.

7.2 利润表
会计主体:嘉实超短债证券投资基金
本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the profit statement for 2008.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:嘉实超短债证券投资基金
本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the equity statement for 2008.

7.4 报表附注
7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
7.4.2 差错更正的说明
7.4.3 关联方关系

Table with 2 columns: Name and Relationship. Lists related parties.

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2008.

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2007.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2006.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2005.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2004.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2003.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2002.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2001.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 2000.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 1999.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fee schedule for 1998.

7.4.4.2 报告期未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

Table with 2 columns: Name and Value. Shows other related party investments.

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 2 columns: Name and Value. Shows interest income from related parties.

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities underwritten by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities held by related parties.

Table with 2 columns: Name and Value. Shows securities sold to related parties.