

## 信息披露 Disclosure

## 嘉实多利分级债券型证券投资基金

## [2011] 第二季度报告

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:2011年7月20日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员所做声明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2011年7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信息，确认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本基金，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、基金合同和基金产品概要。

本报告期自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 嘉实多利分级债(场内简称:嘉实多利)

基金主代码 160718

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年3月23日

报告期末基金份额总额 1,933,086,210.64份

投资目标 本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，力争持续稳定增值。

投资策略 为持续稳定地获取高于存款利率的收益，本基金首先运用“嘉实下行风险波动模型”，控制基金组合的年下行风险波动。在此前提下，本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券收益率和信用利差、市场估值水平及预期收益率等，挖掘风险收益优化策略，通过深入分析股票市场阶段机会来实现更高的收益率。同时，我们对债券类资产配置进行动态调整，以期在不同的市场环境下获得更好的收益。

业绩比较基准 中国国债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

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型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

下属分级基金简称 嘉实多利分级债券 多利优先 多利进取

下属分级基金交易代码 160718 150032 150033

下属分级基金报告期末 1,905,929,255.64份 21,725,564.00份 5,431,391.00份

基金份额总额

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 141,912.01

2.本期利润 -6,066,934.62

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0028

4.期末基金资产净值 1,926,996,702.51

5.期末基金份额净值 0.9968

注:①本期利润为报告期利息收入、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期末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 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(%) 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

过去三个月 -0.33% 0.07% 0.13% -0.11% -0.66%

3.2.2 基金合同生效以来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:嘉实多利分级债券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3月23日至2011年6月30日

注:本基金基金合同生效日2011年3月23日至报告期末未满一年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金基金合同生效之日起一年内为建仓期，截至报告期末本基金已进入建仓期。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

王勇 本基金基金经理,公司总经理 2011年3月23日 - 8年 曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理,中行证券基金部经理,长盛货币基金经理。2008年任嘉实基金管理有限公司固定收益总监。

5.6 本期期初至报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例最大的前五名债券投资明细

5.7 报告期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 报告期内买入金额前五名的证券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未受到公开谴责、处罚的发行主体未被监管部门立案调查，且不存在公开承诺被处罚的说明。

5.9 本报告期内基金的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 250,000.00

2 应收证券清算款 60,847,838.45

3 应收股利 -

4 应收利息 13,211,804.65

5 应收申购款 -

6 其他应收款 54,345.92

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 74,363,989.02

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 112005 11.70% 1,800,000 9.92%

2 110235 11.00% 1,500,000 7.71

3 110217 11.00% 1,300,000 6.72

4 019109 11.00% 1,000,000 5.20

5 110238 11.00% 1,000,000 5.19

注:①任职日期是指基金合同生效之日;②证券从业从行业协会、证券从业从人员资格管理协会的有关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内，本基金运作严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实多利分级债券型证券投资基金招募说明书》、《基金合同》及《托管协议》，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行情况

报告期内，不存在不公平交易行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，不存在不公平交易行为。

4.3.3 公平交易制度的专项说明

报告期内，不存在不公平交易行为。

4.4.1 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

报告期内，不存在异常交易行为。

4.4.2 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.3 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.4 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.5 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.6 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.7 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.8 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.9 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.10 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.11 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.12 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.13 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.14 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.15 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.16 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.17 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.18 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.19 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.20 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.21 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.22 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.23 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.24 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.25 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.26 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.27 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.28 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.29 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.30 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.31 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.32 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.33 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.34 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.35 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.36 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.37 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

4.4.38 报告期内基金的异常交易情形的说明

报告期内，不存在异常交易情形。

&lt;p