

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

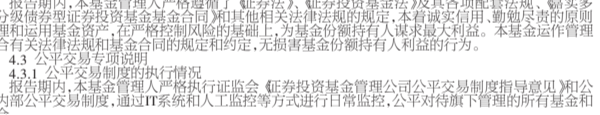
重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人: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

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, 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, 基金经理, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金销售机构, 基金销售机构, 基金销售机构.

3.1 主要财务指标
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.期末基金份额净值 1,926,996,702.51

3.2 本基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
嘉实多利分级债券型证券投资基金业绩比较基准的历史走势图



4.1 基金管理人
姓名:王蔚
职务:基金经理
任职日期:2011年3月23日
离任日期:8年

4.2 基金管理人
4.3 基金管理人
4.4 基金管理人
4.5 基金管理人

4.6 基金管理人
4.7 基金管理人
4.8 基金管理人

4.9 基金管理人
4.10 基金管理人

4.11 基金管理人
4.12 基金管理人

4.13 基金管理人
4.14 基金管理人

4.15 基金管理人
4.16 基金管理人

4.17 基金管理人
4.18 基金管理人

4.19 基金管理人
4.20 基金管理人

4.21 基金管理人
4.22 基金管理人

4.23 基金管理人
4.24 基金管理人

4.25 基金管理人
4.26 基金管理人

4.27 基金管理人
4.28 基金管理人

基金收益率为-0.22%
4.5 管理人认为,二季度以来,经济复苏,证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年三季度,我们认为GDP的环比增速有望在三季度显著回升,而CPI的同比增速有望在三季度有所回落,因此宏观经济在下半段有所企稳,理由一是二季度以来,随着稳增长政策的逐步落实,经济下行压力有所缓解,二是二季度以来,随着稳增长政策的逐步落实,经济下行压力有所缓解,三是二季度以来,随着稳增长政策的逐步落实,经济下行压力有所缓解。

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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细
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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.8 其他资产
5.9 其他资产

5.10 其他资产
5.11 其他资产

5.12 其他资产
5.13 其他资产

5.14 其他资产
5.15 其他资产

5.16 其他资产
5.17 其他资产

5.18 其他资产
5.19 其他资产

5.20 其他资产
5.21 其他资产

5.22 其他资产
5.23 其他资产

5.24 其他资产
5.25 其他资产

5.26 其他资产
5.27 其他资产

5.28 其他资产
5.29 其他资产

5.30 其他资产
5.31 其他资产

5.32 其他资产
5.33 其他资产

5.34 其他资产
5.35 其他资产

嘉实超短债证券投资基金

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

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: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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 5,451,320.90
2.本期利润 3,680,368.99
3.加权平均基金份额本期利润 0.0042
4.期末基金份额净值 561,681,449.18
5.期末基金资产净值 9,994

3.2 本基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
嘉实超短债证券投资基金业绩比较基准的历史走势图



4.1 基金管理人
姓名:魏蔚
职务:基金经理
任职日期:2009年1月16日
离任日期:8年

4.2 基金管理人
4.3 基金管理人
4.4 基金管理人

4.5 基金管理人
4.6 基金管理人

4.7 基金管理人
4.8 基金管理人

4.9 基金管理人
4.10 基金管理人

4.11 基金管理人
4.12 基金管理人

4.13 基金管理人
4.14 基金管理人

4.15 基金管理人
4.16 基金管理人

4.17 基金管理人
4.18 基金管理人

4.19 基金管理人
4.20 基金管理人

4.21 基金管理人
4.22 基金管理人

4.23 基金管理人
4.24 基金管理人

4.25 基金管理人
4.26 基金管理人

4.27 基金管理人
4.28 基金管理人

4.29 基金管理人
4.30 基金管理人

4.31 基金管理人
4.32 基金管理人

4.33 基金管理人
4.34 基金管理人

4.35 基金管理人
4.36 基金管理人

4.37 基金管理人
4.38 基金管理人

4.39 基金管理人
4.40 基金管理人

基金收益率为0.80%
4.5 管理人认为,二季度以来,经济复苏,证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年三季度,我们认为,二季度以来,经济复苏,证券市场及行业走势的简要展望

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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细
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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.8 其他资产
5.9 其他资产

5.10 其他资产
5.11 其他资产

5.12 其他资产
5.13 其他资产

5.14 其他资产
5.15 其他资产

5.16 其他资产
5.17 其他资产

5.18 其他资产
5.19 其他资产

5.20 其他资产
5.21 其他资产

5.22 其他资产
5.23 其他资产

5.24 其他资产
5.25 其他资产

5.26 其他资产
5.27 其他资产

5.28 其他资产
5.29 其他资产

5.30 其他资产
5.31 其他资产

5.32 其他资产
5.33 其他资产

5.34 其他资产
5.35 其他资产