

信息披露 Disclosure

嘉实债券开放式证券投资基金

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

基金管理人的董事会及其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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金为嘉实理财产品系之证券投资基金之一，嘉实理财产品系列证券投资基金具有不同市场级别的两只基金构成，包括但不限于嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期的财务数据未经审计。

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:嘉实债券
基金主代码:070005
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2003年7月9日
报告期末基金份额总额:931,256,897.16份

投资目标:以本基金为前提，追求较高的组合回报。

投资策略:采取主动的久期策略，通过对比投资组合的相对价值分析，充分挖掘收益率变化带来的潜在的投资机会，应用久期调整、凸度调整、息差等策略构建组合，实现基金的净值增值。

业绩比较基准:中央国债登记结算公司发布的中国债券指数。

风险收益特征:本基金属于风险较低的股票基金，长期平均的风险和预期收益率低于股票基金，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:中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -7,731,482.09

2.本期利润 -10,508,728.82

3.期初平均基金份额利润 -0.0100

4.期末基金份额净值 1,237,239,401.47

5.期末基金份额净值 1,329

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交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 本报告期内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 0.75% 0.12% 0.36% 0.07% -1.11% 0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

日期 份额净值 份额累计净值

2003-07-09 1.237,239,401.47

2011-06-30 1,329

注:①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各项资产配置比例符合基金合同第三部分“四、(一)投资范围”及“各基金投资组合比例限制”的规定;②本基金因借壳及以任何形式高估信用评级机构或当优质资产担保的金融债、企业公司债、包括可转债等债券的比例不低于基金非现金资产的90%;前述信用等级是指由国家有权机构批露的信用评级机构进行的信用评级报告。③本基金所投资的新股上市后持有期限不超过六个月;④新股投资比例不超过基金资产的20%;⑤现金比例

5.6 新股投资比例不超过基金资产的20%;⑥现金比例

5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券支持证券投资基金明细

5.8 报告期内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

5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券品种的债券投资基金组合

5.10 报告期内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基金组合

5.11 报告期内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基金组合

5.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.13 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券支持证券投资基金组合

5.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.15 报告期内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基金组合

5.16 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.17 报告期内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基金组合

5.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.19 报告期内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基金组合

5.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.21 报告期内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基金组合

5.22 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.23 报告期内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基金组合

5.24 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.25 报告期内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基金组合

5.26 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.27 报告期内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基金组合

5.28 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.29 报告期内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基金组合

5.30 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.31 报告期内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基金组合

5.32 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.33 报告期内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基金组合

5.34 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.35 报告期内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基金组合

5.36 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.37 报告期内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基金组合

5.38 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.39 报告期内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基金组合

5.40 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.41 报告期内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基金组合

5.42 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.43 报告期内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基金组合

5.44 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.45 报告期内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基金组合

5.46 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.47 报告期内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基金组合

5.48 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.49 报告期内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基金组合

5.50 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.51 报告期内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基金组合

5.52 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.53 报告期内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基金组合

5.54 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.55 报告期内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基金组合

5.56 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.57 报告期内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基金组合

5.58 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.59 报告期内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基金组合

5.60 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.61 报告期内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基金组合

5.62 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.63 报告期内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基金组合

5.64 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.65 报告期内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基金组合

5.66 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.67 报告期内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基金组合

5.68 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.69 报告期内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基金组合

5.70 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.71 报告期内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基金组合

5.72 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.73 报告期内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基金组合

5.74 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.75 报告期内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基金组合

5.76 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.77 报告期内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基金组合

5.78 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.79 报告期内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基金组合

5.80 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.81 报告期内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基金组合

5.82 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.83 报告期内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基金组合

5.84 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.85 报告期内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基金组合

5.86 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.87 报告期内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基金组合

5.88 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.89 报告期内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基金组合

5.90 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.91 报告期内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基金组合

5.92 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.93 报告期内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基金组合

5.94 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资基金组合

5.95 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名