嘉实超短债证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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
送出日期：2013年8月26日

§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。本半年度报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2013年8月20日核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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实超短债证券投资基金
基金简称	嘉实超短债债券
基金主代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月26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
报告期末基金份额总额	592,781,872.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳妥，保持资产较高的流动性，降低基金净值波动风险，取得超过比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面，将基金的大部分资产投资于货币市场工具，保持基金资产的高流动性，同时提供稳定的收益；另一方面，通过价值挖掘，将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具，为基金资产提供超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率
风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金，低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层 嘉实基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	15,591,084.30
本期利润	15,083,086.45
加权平均基金份额本期利润	0.0159
本期加权平均净值利润率	1.57%
本期基金份额净值增长率	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	531,209.04
期末可供分配基金份额利润	0.0009
期末基金资产净值	597,052,521.25
期末基金份额净值	1.0072
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.58%

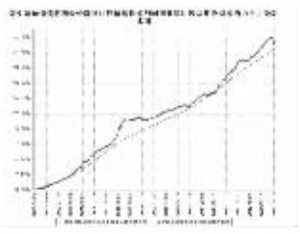
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.44%	0.13%	0.24%	0.01%	-0.68%	0.12%
过去三个月	0.27%	0.08%	0.74%	0.01%	-0.47%	0.07%
过去六个月	1.52%	0.06%	1.48%	0.01%	0.04%	0.05%
过去一年	2.65%	0.05%	3.00%	0.01%	-0.35%	0.04%
过去三年	9.66%	0.04%	9.48%	0.01%	0.18%	0.03%
自基金合同生效起至今	23.58%	0.03%	22.31%	0.01%	1.27%	0.02%

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



图：嘉实超短债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
(2006年4月26日至2013年6月30日)

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起3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十三、(八)投资组合限制的约定：(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年；(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%；(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%，投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%；(7)中国证监会规定的其他比例限制。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2013年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏莉	本基金基金经理、嘉实货币基金经理	2009年1月16日	-	10年	曾任职于国家开发银行国际金融局，中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士，CFA，CPA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期指公司作出决定后公告之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实超短债证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年，市场流动性先松后紧，资金利率大幅波动，债券市场在资金面的主导下先涨后跌。5月下旬之前，整体资金面一直维持宽松局面，外汇占款持续增长，社会融资总量和银行信贷相对超预期，期间银行间1天和7天回购利率均值分别在2.4%和3.2%左右。上半年央行的货币政策有所调整，公开市场2月重启正回购操作，5月重启央票发行，反映其不希望资金面总量继续宽松的态度，货币政策由宽松转为中性；但央行每周正回购量维持少量的数百亿，回笼力度相对偏弱，对市场影响不大，资金面整体仍偏宽松。上半年宏观经济数据弱于预期，显示经济仍处于弱复苏态势，通胀压力也不大，对债市构成支撑。在资金面和宏观经济数据的配合下，各机构配置需求旺盛，债券收益率整体下行，部分投资者更增加杠杆运作。信用债券、尤其是高票息信用债受市场青睐，信用利差持续收窄。但是5月20日开始，企业所得税年度集中清缴、端午节假期现金需求、外汇市场变化、银行补缴法定准备金、理财产品集中到期、季末银行争夺存款等多种因素的影响持续并叠加，市场资金面迅速逆转，由前期的宽松转入紧张并不断升级，6月20日达到顶点，银行间1天和7天回购利率均值分别升至2.6%和3.3%。之后央行出面稳定市场情绪，并对部分银行提供流动性支持，季末最后一周市场信心才有所恢复，资金成本逐步下行。但5月20日至6月末，银行间1天和7天回购利率均值仍高达5.95%和6.26%。资金成本的持续高企导致整体债市下跌，部分投资者出于流动性需要被迫抛售，短期债券受到的冲击尤为剧烈。代表券种 1年期国开金融债年初收益率3.4%，1季末下降为3.29%，2季末则升至4.08%。同时，2季末债券收益率曲线整体平坦化甚至倒挂，3年期和5年期国开金融债收益率则分别为4.10%和4.05%。信用产品方面，信用债收益率跟随基准利率波动的同时，债市上行时信用利差收窄，而债市下跌时信用利差则扩宽。上半年高评级的AAA级短融收益率先由年初的4.46%降至1季末的4.0%左右，然后2季末又飙升超过5%，中等评级的AA级短融收益率则由年初的4.86%降至1季末的4.3%左右，2季末则升至5.43%，波幅均超过100基点。中票和企业债收益率波动幅度则小于短融，曲线相对平坦化。

上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎把握政策方向，深入分析宏观经济走势和资金面变化，灵活调整投资策略，在确保组合安全性和流动性的前提下，谨慎操作，努力创造相对稳定的投资收益。1季度组合基础配置整体保持较长久期，在提高组合静态收益的同时也享受到市场上涨带来的资本利得收入。而2季度则随组合规模缩减降低债券持仓，基础配置调降为中性久期，在控制信用风险的前提下，选择交易所债券、高流动性短融和高收益短融进行平衡配置，并搭配不同期限的同业存款和银行间回购来进行现金流管理，在获取稳定票息收入的同时为组合提供流动性储备。上半年组合规模大幅波动，前期规模平稳增长，但2季度末市场资金面紧张叠加季末因素，赎回较为集中，组合被动杠杆增加，资金成本上升叠加持仓债券估值下跌，特别是组合持仓中的短期交易所债券价格非正常波动，导致6月份组合净值波动较大，对投资者非常抱歉。整体看，上半年本基金成功应对了市场冲击和规模波动，实现了正收益。并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，静态收益仍比较高，且整体久期短，利率风险低，6月下跌也增加了组合未来估值上涨的空间。为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为1.0072元；本报告期基金份额净值增长率为1.52%，业绩比较基准收益率为1.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年下半年，宏观经济基本面、通胀走势和资金面仍将是影响债市的主要因素。整体看，海外量化宽松政策的退出已渐趋明朗，国内通胀较大概率仍然在3%以下，经济处于弱复苏状况，综合当前国内外整体经济和货币环境，预计央行将持续稳健的货币政策，并着力增强政策的前瞻性、针对性和灵活性，适时适度进行预调微调。6月份资金面最紧张的阶段已经过去，但预期未来资金面难以回到前期宽松状况，利率中枢将有所抬升。周小川行长讲话中提到，未来央行工作关注重点是，一方面引导金融机构保持合理信贷投放，合理安排资产负债总量和期限结构，支持实体经济的结构调整和转型升级；另一方面，也将综合运用各种工具和手段，适时调节市场流动性，保持市场总体稳定，为金融市场平稳运行和经济发展创造良好的货币条件。央行公开市场操作和正回购利率将是影响资金面、资金利率和投资者政策预期的关键指标。同时，3季度是传统的债市供给增加、资金相对紧张时期，同时重启股票IPO也已经纳入日程，4季度之前资金面和债市状况需要谨慎。近期评级机构较为密集对某些行业或个券采取评级下调或展望负面的调整，表明经济不景气带来的信用风险真实存在，下半年信用事件爆发概率增加。此外，目前监管层在讨论的同业业务规范、抑制银行同业业务规模的增长，推动金融去杠杆，以及不断完善、日趋严格的债券监管规定，这都将对债券和资金市场带来复杂和深远影响，下半年要重点关注这方面的政策。鉴于此，针对上述复杂的市场环境，本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，密切关注宏观经济面及市场资金面情况，合理配置资产类属和期限结构，控制信用持仓比例和久期，保持较大的组合弹性应对未来可能的流动性风险、利率风险等市场风险。在波动的市场中力求为基金份额持有人创造安全稳定的收益。

4.6 管理人对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，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1)报告期内实施了2012年第11次基金利润分配，具体参见本报告《6.4.11 利润分配情况》。

(2)根据本基金基金合同《十八、(二)收益分配原则》的约定：《在符合有关基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过0.001元的前提下，本基金每个月应将至少90%的可分配收益进行分红。每年分红次数不超过20次》。本基金报告期内共实施了5次分配利润合计14,658,246.80元，报告期内利润分配具体参见本报告《6.4.11 利润分配情况》。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

§5 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

本报告期内，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，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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》部分未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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,092,986.22	317,848,631.09
结算备付金		6,642,475.94	11,892,062.98
存出保证金		59,682.72	45,212.23
交易性金融资产	6.4.7.2	965,503,845.68	927,587,040.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		933,503,845.68	895,587,040.60
资产支持证券投资		32,000,000.00	32,000,000.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,025,652.05	-
应收利息	6.4.7.5	20,069,509.84	17,587,586.17
应收股利		-	-
应收申购款		5,127,222.19	1,159,198.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,010,521,374.64	1,276,119,731.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		411,199,213.90	246,099,054.85
应付证券清算款		833,438.06	254,399,446.33
应付赎回款		115,977.48	30,722.04
应付管理人报酬		270,026.34	395,936.57
应付托管费		92,204.12	135,197.89
应付销售服务费		164,650.26	241,424.73
应付交易费用	6.4.7.7	32,212.82	39,205.94
应交税费		86,681.11	86,681.11
应付利息		220,839.61	66,916.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	453,609.69	549,088.08
负债合计		413,468,853.39	502,043,674.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	592,781,872.25	767,544,173.27
未分配利润	6.4.7.10	4,270,649.00	6,531,884.26
所有者权益合计		597,052,521.25	774,076,057.53
负债和所有者权益总计		1,010,521,374.64	1,276,119,731.74

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0072元，基金份额总额592,781,872.25份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实超短债证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		26,041,088.99	45,608,465.49
1.利息收入		25,500,495.85	35,056,065.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,309,396.69	4,715,044.93
债券利息收入		22,386,969.99	25,983,851.66
资产支持证券利息收入		733,124.39	-
买入返售金融资产收入		71,004.78	4,357,169.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益		1,048,590.99	4,006,169.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,048,590.99	4,006,169.26
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-507,997.85	6,546,230.64
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		10,958,002.54	9,096,319.61
1.管理人报酬		1,947,533.13	3,402,163.18
2.托管费		665,011.37	1,161,714.33
3.销售服务费		1,187,520.21	2,074,489.77
4.交易费用	6.4.7.18	21,133.87	19,879.51
5.利息支出		6,873,371.91	2,238,453.12
其中：卖出回购金融资产支出		6,873,371.91	2,238,453.12
6.其他费用	6.4.7.19	263,432.05	199,619.70
三、利润总额		15,083,086.45	36,512,145.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润		15,083,086.45	36,512,145.88

6.3 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：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	767,544,173.27	6,531,884.26	774,076,057.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,083,086.45	15,083,086.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-174,762,301.02	-1,300,998.05	-176,063,299.07
其中：1.基金申购款	4,970,232,006.32	70,139,412.14	5,040,371,418.46
2.基金赎回款	-5,144,994,307.34	-71,440,410.19	-5,216,434,717.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-16,043,323.66	-16,043,323.66
五、期末所有者权益(基金净值)	592,781,872.25	4,270,649.00	597,052,521.25
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	842,783,681.72	6,117,950.50	848,901,632.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,512,145.88	36,512,145.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,227,905,822.78	17,055,971.38	1,244,961,794.16
其中：1.基金申购款	19,344,576,089.48	223,351,060.41	19,567,927,149.89
2.基金赎回款	-18,116,670,266.70	-206,295,089.03	-18,322,965,355.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-28,961,529.19	-28,961,529.19
五、期末所有者权益(基金净值)	2,070,689,504.50	30,724,538.57	2,101,414,043.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告《6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____赵学军_____ _____李松林_____ _____王红_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,947,533.13	3,402,163.18
其中：支付销售机构的客户维护费	601,351.38	1,201,740.26

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。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.41%／当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	665,011.37	1,161,714.33

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.14%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.14%／当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
嘉实基金管理有限公司	49,875.27
中国银行	191,556.15
合计	241,431.42
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
嘉实基金管理有限公司	57,927.74
中国银行	426,458.20
合计	484,385.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%／当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	50,238,973.54	10,240,421.23	-	-	999,910,000.00	128,493.34
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	70,154,799.15	41,511,524.16	-	-	1,793,830,000.00	265,002.44

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2013年6月30日)及上年度末(2012年12月31日)，其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,092,986.22	36,437.74	108,558,326.56	2,852,922.54

注：(1)本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，活期银行存款按银行同业利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。(2)本期末(2013年6月30日)，本基金无存于中国银行的定期存款，本期(2013年1月1日至2013年6月30日)，由中国银行保管的银行存款产生的利息收入无定期存款利息收入；上期末(2012年6月30日)由中国银行保管的银行存款余额含定期存款100,000,000.00元，上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，由中国银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入2,811,041.60元。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2013年6月30日)，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额184,599,430.90元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
100236	10国开36	2013年7月1日	99.65	1,000,000	99,650,000.00
110206	11国开06	2013年7月1日	100.35	100,000	10,035,000.00
071311002	13国信CP002	2013年7月1日	99.83	300,000	29,949,000.00
041260052	12苏龙CP001	2013年7月1日	100.59	300,000	30,177,000.00
041269032	12顺鑫股份CP002	2013年7月1日	100.42	200,000	20,084,000.00
合计				1,900,000	189,895,000.00

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额226,599,783.00元，于2013年7月5日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	965,503,845.68	95.55
	其中：债券	933,503,845.68	92.38
	资产支持证券	32,000,000.00	3.17
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	9,735,462.16	0.96
6	其他各项资产	35,282,066.80	3.49
	合计	1,010,521,374.64	100.00

7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,790,000.00	23.41
	其中：政策性金融债	139,790,000.00	23.41
4	企业债券	312,613,845.68	52.36
5	企业短期融资券	340,442,000.00	57.02
6	中期票据	140,658,000.00	23.56
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	933,503,845.68	156.35

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	1,000,000	99,650,000.00	16.69
2	110206	11国开06	400,000	40,140,000.00	6.72
3	122013	08北辰债	400,000	40,000,000.00	6.70
4	122238	13宁港01	300,000	30,330,000.00	5.08
5	1382028	13山水MTN1	300,000	30,237,000.00	5.06

7.4 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119024	侨城02	110,000	11,000,000.00	1.84
1	119025	侨城03	110,000	11,000,000.00	1.84
2	119023	侨城01	100,000	10,000,000.00	1.67

7.5 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