基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2013年8月26日

嘉实纯债债券型发起式证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月20日复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	嘉实纯债债券型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实纯债债券	
基金主代码	070037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月11日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	455,215,217.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
下属分级基金的交易代码:	070037	070038
报告期末下属分级基金的份额总额	150,725,794.75份	304,489,422.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求长期稳定增值。
投资策略	本基金在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上,以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心,自上而下地决定债券组合久期、动态调整各类金融资产比例,结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)65182266	(010)66275853

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

基金级别	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
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)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	4,852,963.38	20,269,223.32
本期利润	4,221,978.61	22,053,757.39
加权平均基金份额本期利润	0.0244	0.0286
本期加权平均净值利润率	2.40%	2.82%
本期基金份额净值增长率	2.59%	2.70%
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	4,185,173.40	8,430,483.13
期末可供分配基金份额利润	0.0278	0.0277
期末基金资产净值	154,910,968.15	312,919,905.46
期末基金份额净值	1.028	1.028
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	2.80%	2.80%

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)嘉实纯债债券A收取认购/申购费用、赎回费;嘉实纯债债券C从本类别基金资产中计提销售服务费,不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。(3)所述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。(4)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

嘉实纯债债券A

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	-0.29%	0.17%	-0.33%	0.22%	0.04%	-0.05%
过去三个月	0.88%	0.12%	0.91%	0.13%	-0.03%	-0.01%
过去六个月	2.59%	0.09%	2.15%	0.10%	0.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.08%	2.42%	0.09%	0.38%	-0.01%

嘉实纯债债券C

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	-0.29%	0.17%	-0.33%	0.22%	0.04%	-0.05%
过去三个月	1.08%	0.12%	0.91%	0.13%	0.17%	-0.01%
过去六个月	2.70%	0.09%	2.15%	0.10%	0.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.09%	2.42%	0.09%	0.38%	0.00%

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1:嘉实纯债债券A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(2012年12月11日至2013年6月30日)

图2:嘉实纯债债券C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(2012年12月11日至2013年6月30日)

注:本基金基金合同生效日2012年12月11日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,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的各项投资比例符合基金合同"第十二部分(二)投资范围和(六)投资限制"的有关约定。

§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、嘉实债券型证券投资基金募集的批复)核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,383,944,355.83元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第487号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2012年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,384,447,802.49份基金份额,其中认购资金利息折合503,446.66份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购费、申购费、赎回费以及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,嘉实纯债债券型发起式证券投资基金A类基金份额(简称:嘉实纯债债券A")在投资者认购或申购时收取认购费或申购费,不收取销售服务费;嘉实纯债债券型发起式证券投资基金C类基金份额(简称:嘉实纯债债券C")不收取认购费或申购费,收取销售服务费。同时,嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C基金份额适用不同的赎回费率。本基金嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C基金份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金嘉实纯债债券A基金份额和嘉实纯债债券C基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行及/或上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超级短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)等固定收益类金融工具以及现金,法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等,也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。

4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

4.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4.4.4 重要会计政策和会计估计

4.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

4.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

4.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

4.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

4.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

4.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

4.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除报益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

4.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

4.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

4.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

4.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

4.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况,经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

4.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的债券,若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

4.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

4.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

4.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

4.4.5.3 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。

4.4.6 关联方关系

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、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

4.4.6.1 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。

4.4.6.2 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、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构

4.4.7 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。

4.4.7.1 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),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

4.4.7.2 关联方报酬

4.4.7.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,117,618.92
其中:支付销售机构的客户维护费	1,761,948.37

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0.65%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×0.65%/当年天数。

4.4.7.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	959,267.35

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%/当年天数。

4.4.7.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	120,100.62	120,100.62
中国建设银行	-	1,372,843.75	1,372,843.75
合计	-	1,492,944.37	1,492,944.37

注:(1)支付基金销售机构的销售服务费按嘉实纯债债券C类基金份额前一日基金资产净值0.40%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C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.40%/当年天数。(2)嘉实纯债债券A类基金份额不收取销售服务费。

4.4.7.3 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
中国建设银行	50,434,361.65	10,031,054.79	-	-	323,455,000.00	30,355.44

4.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

4.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
基金合同生效日(2012年12月11日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,001,981.79	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,981.79	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.64%	-

注:基金管理人于本基金2012年发售期内通过代销机构认购本基金基金份额总额10,001,981.79份,认购费为1,006.02元。

4.4.7.4.2 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。

4.4.7.5 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	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	512,757.97	67,699.17

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。

4.4.7.6 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),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

4.4.8 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

4.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

4.4.8.1.1 受限证券类别:股票

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股票。

4.4.8.1.2 受限证券类别:债券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112178	12墨龙01	2013年6月13日	2013年7月23日	新债未上市	100.00	100.00	20,000	2,000,000.00	2,000,000.00	-
112180	12奥飞债	2013年6月14日	2013年7月23日	新债未上市	100.00	100.00	60,000	6,000,000.00	6,000,000.00	-

4.4.8.1.3 受限证券类别:其他

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其他证券。

4.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2013年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

4.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

4.4.8.3.3 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39,059,860.47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
090209	09国开09	2013年7月1日	99.16	420,000	41,647,200.00
合计				420,000	41,647,200.00

4.4.8.3.4 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229,658,903.20元,于2013年7月10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	705,111,413.87	92.98
	其中:债券	695,111,413.87	91.66
	资产支持证券	10,000,000.00	1.32
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	18,418,388.02	2.43
6	其他各项资产	34,801,284.92	4.59
	合计	758,331,086.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.8 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

7.4.9 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

7.4.10 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

7.5 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	59,707,062.10	12.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,368,000.00	19.10
	其中:政策性金融债	89,368,000.00	19.10
4	企业债券	375,329,351.77	80.23
5	企业短期融资券	49,654,000.00	10.61
6	中期票据	121,053,000.00	25.88
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	695,111,413.87	148.58

7.6 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	090209	09国开09	500,000	49,580,000.00	10.60
2	120245	12国开45	400,000	39,788,000.00	8.50
3	1282535	12正泰MTN1	300,000	30,366,000.00	6.49
4	1282556	12德泰MTN1	300,000	30,246,000.00	6.47
5	010107	21国债(7)	262,880	27,612,915.20	5.90

7.7 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	119029	澜沧江1	100,000	10,000,000.00	2.14

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资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本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	83,212.03
2	应收证券清算款	20,107,876.61
3	应收股利	-
4	应收利息	14,155,660.69
5	应收申购款	454,535.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	34,801,284.92

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉实纯债债券A	2,750	54,809.38	75,977,004.03	50.41%	74,748,790.72	49.59%
嘉实纯债债券C	2,264	134,491.79	71,486,552.71	23.48%	233,002,869.62	76.52%
合计	4,932	92,298.30	147,463,556.74	32.39%	307,751,660.34	67.61%

注:(1)嘉实纯债债券A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例,分别为机构投资者持有嘉实纯债债券A份额占嘉实纯债债券A总份额比例、个人投资者持有嘉实纯债债券A份额占嘉实纯债债券A总份额比例;

(2)嘉实纯债债券C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例,分别为机构投资者持有嘉实纯债债券C份额占嘉实纯债债券C总份额比例、个人投资者持有嘉实纯债债券C份额占嘉实纯债债券C总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实纯债债券A	-	0.00%
	嘉实纯债债券C	67,829.45	0.02%
	合计	67,829.45	0.01%

8.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理持有本基金情况

本期末,基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

8.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,981.79	2.20	10,001,981.79	2.20	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,001,981.79	2.20	10,001,981.79	2.20	3年

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
基金合同生效日(2012年12月11日)基金份额总额	170,370,073.73	1,214,077,728.76
本报告期期初基金份额总额	170,370,073.73	1,214,077,728.76
本报告期基金总申购份额	144,412,110.38	420,603,399.01
减:本报告期基金总赎回份额	164,056,389.36	1,330,191,705.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	150,725,794.75	304,489,422.33

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)基金管理人的重大人事变动情况

报告期内,基金管理人无重大人事变动。

(2)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况