嘉实理财宝7天债券型证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业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	嘉实理财宝7天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝7天债券	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月29日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,636,858,562.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
下属分级基金的交易代码:	070035	070036
报告期末下属分基基金的份额总额	729,684,937.44份	907,173,624.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据宏观经济指标决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布,根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例,根据各类资产的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别;根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标以及个别债券的收益率与剩余期限的配比等指标进行投资。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	李芳菲
	联系电话	(010)65215588	(010)66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65182266	(010)63201816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告报告备置地点	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	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
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	22,223,352.88	29,388,209.76
本期利润	22,223,352.88	29,388,209.76
本期净值收益率	1.7428%	1.8895%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末基金资产净值	729,684,937.44	907,173,624.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)	
累计净值收益率	2.7204%	2.9714%

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 (2)嘉实理财宝7天债券A与嘉实理财宝7天债券B适用不同的销售服务费率。 (3)本基金无持有人认购申购或交易基金的各项费用; (4)本基金收益在基金份额"7天持有周期到期日"集中结转为基金份额。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实理财宝7天债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1899%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.0789%	0.0020%
过去三个月	0.7719%	0.0046%	0.3366%	0.0000%	0.4353%	0.0046%
过去六个月	1.7428%	0.0065%	0.6695%	0.0000%	1.0733%	0.0065%
自基金合同生效起至今	2.7204%	0.0054%	1.1318%	0.0000%	1.5886%	0.0054%

嘉实理财宝7天债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2143%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.1033%	0.0020%
过去三个月	0.8451%	0.0046%	0.3366%	0.0000%	0.5085%	0.0046%
过去六个月	1.8895%	0.0065%	0.6695%	0.0000%	1.2200%	0.0065%
自基金合同生效起至今	2.9714%	0.0054%	1.1318%	0.0000%	1.8396%	0.0054%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

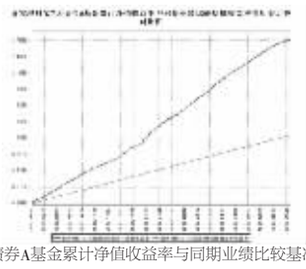

图1:嘉实理财宝7天债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年6月30日)

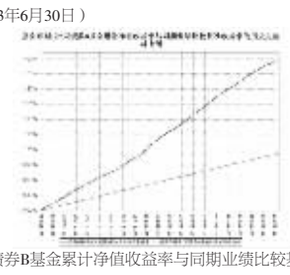

图2:嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年6月30日)

注:本基金基金合同生效日2012年8月29日至报告期末未满1年。报告期内本基金各项资产配置比例符合基金合同第十二部分(二、投资范围和四、投资限制)的规定。

§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		
桑迎	本基金基金经理、嘉实安心货币基金经理	2012年8月29日	-	8年	曾任交通银行外汇交易员,华夏银行总行交易员。2008年1月加入嘉实基金管理有限公司,历任交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。银行与金融专业硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日; (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

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、《嘉实理财宝7天债券型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年上半年货币市场收益率呈现前低后高的走势,一季度银行间市场隔夜回购利率均值仅为2.35%,二季度隔夜回购利率均值骤然升至3.92%,期间最高曾一度冲击10%以上的历史最高水平。我们认为新一届政府的宏观经济政策方向出现较大变化是市场巨大波动的主要原因。在上届政府时期,如果GDP增速在8%以下运行,货币政策上将出现明显放松,流动性宽松,资金利率低于历史均值,债券收益率下行。2013年宏观政策出现截然相反的变化,尽管GDP增速、CPI、工业增加值等数据不断回落,但央行货币政策操作在上半年出现逐步收紧的走势。新的政策取向显示出央行对于金融降杠杆,金融机构流动性风险以及未来潜在资本流出等方面的担忧。央行存在利用较高货币市场利率督促金融机构关注各项风险,同时帮助人民币处于利差优势以维护汇率稳定的意图。在新的货币政策取向下,市场的预期出现大幅转变,货币市场出现巨大波动。1年期AAA级别短期融资券收益率一季度一度跌至3.9%附近,随着6月"钱荒"的到来,同期限同评级的短期融资券二级市场收益率一度冲击到5%附近,收益上行幅度达到100基点以上。其它不同评级的债券收益率也出现大幅度的上行。总体而言,2013年上半年是宏观政策出现较大转变,市场心态逆转,货币市场巨幅波动的半年。

2013年上半年,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务。一方面谨慎应对组合规模的大幅波动,另一方面要应对市场收益的波动。在市场宽松时适度增加组合杠杆,在市场紧缩时及时调仓,合理分配不同的资产。通过上述操作,本基金上半年顺利应对了市场的巨大波动,保证了组合安全。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝7天债券A的基金份额净值收益率为1.7428%,嘉实理财宝7天债券B的基金份额净值收益率为1.8895%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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13年下半年,海外量化宽松政策的退出已渐趋明朗,全球资本流动趋势可能出现逆转,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,主基调以稳为主。全年资金面最紧张的阶段已经过去,但预期未来资金利率难以回落到上半年的低位,利率中枢将有所抬升。央行公开市场操作和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。未来我们仍要重点关注货币政策的变化。此外,随着宏观经济走势的变化,以及政府各项经济政策出台,不排除爆发债券违约的可能性。特别是一些小型民营企业需要更加谨慎对待。针对上述复杂市场环境,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,以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,继续保持较高的流动性资产配置,谨慎控制组合的信用配置,以应对利率上行风险和信用风险,努力为投资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

根据本基金基金合同第十六部分二、收益分配原则的约定:3.本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,在基金份额"7天持有周期到期日"集中支付。", 5.本基金每日进行收益计算并分配时,在基金份额"7天持有周期到期日"累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式",本期A类份额已实现收益为22,223,352.88元,每日分配,到期支付,合计分配22,223,352.88元,B类份额已实现收益为29,388,209.76元,每日分配,到期支付,合计分配29,388,209.76元,符合本基金基金合同的约定。

§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

在托管嘉实理财宝7天债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金托管协议》的约定,对嘉实理财宝7天债券型证券投资基金管理人—嘉实基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司在嘉实理财宝7天债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的嘉实理财宝7天债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:嘉实理财宝7天债券型证券投资基金
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	7,189,239.65	485,856,474.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,500,910,631.30	961,065,788.32
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,500,910,631.30	961,065,788.32
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,250.00	359,500,979.25
应收证券清算款		10,020,289.32	-
应收利息	6.4.7.5	14,181,056.82	18,497,041.87
应收股利		-	-
应收申购款		6,306,827.27	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,638,608,294.36	1,824,920,283.97
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		-	58,559,850.72
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		547,348.78	266,080.21
应付托管费		162,177.44	78,838.59
应付销售服务费		303,604.73	187,756.92
应付交易费用	6.4.7.7	75,473.10	36,941.03
应交税费		-	-
应付利息		-	6,230.24
应付利润		472,756.33	566,244.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,371.67	140,000.00
负债合计		1,749,732.05	59,841,942.48
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,636,858,562.31	1,765,078,341.49
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,636,858,562.31	1,765,078,341.49
负债和所有者权益总计		1,638,608,294.36	1,824,920,283.97

注:报告截止日2013年6月30日,嘉实理财宝7天债券A基金份额净值1.0000元,基金份额总额729,684,937.44份;嘉实理财宝7天债券B基金份额净值1.0000元,基金份额总额907,173,624.87份。嘉实理财宝7天债券基金份额总额合计为1,636,858,562.31份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实理财宝7天债券型证券投资基金
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
一、收入		65,961,626.49
1.利息收入		54,184,540.39
其中:存款利息收入	6.4.7.11	26,042,210.60
债券利息收入		25,990,696.26
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,151,633.53
其他利息收入		-
2.投资收益		11,777,086.10
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	11,777,086.10
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益		-
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.13	-
减:二、费用		14,350,063.85
1.管理人报酬		3,887,299.45
2.托管费		1,151,792.45
3.销售服务费		2,012,555.46
4.交易费用	6.4.7.14	-
5.利息支出		7,012,244.11
其中:卖出回购金融资产支出		7,012,244.11
6.其他费用	6.4.7.15	286,172.38
三、利润总额		51,611,562.64
减:所得税费用		-
四、净利润		51,611,562.64

注:本基金合同生效日为2012年8月29日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实理财宝7天债券型证券投资基金
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)	1,765,078,341.49	-	1,765,078,341.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,611,562.64	51,611,562.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-128,219,779.18	-	-128,219,779.18
其中:1.基金申购款	18,445,100,560.53	-	18,445,100,560.53
2.基金赎回款	-18,573,320,339.71	-	-18,573,320,339.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-51,611,562.64	-51,611,562.64
五、期末所有者权益(基金净值)	1,636,858,562.31	-	1,636,858,562.31

注:本基金合同生效日为2012年8月29日,无上年度可比期间数据。

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
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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),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
当期发生的基金应支付的管理费	3,887,299.45
其中:支付销售机构的客户维护费	824,982.21

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0.27%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×0.27%/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
当期发生的基金应支付的托管费	1,151,792.45

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%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×0.08%/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		
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B	合计
嘉实基金管理有限公司	93,823.06	44,171.74	137,994.80
中国农业银行股份有限公司	939,988.01	15,214.25	955,202.26
合计	1,033,811.07	59,385.99	1,093,197.06

注:(1)嘉实理财宝7天债券A类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.30%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。对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。其计算公式为:日A类基金份额销售服务费=前一日A类基金份额资产净值×0.30%/当年天数。

(2)嘉实理财宝7天债券B类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%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。对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其达到B类条件的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。其计算公式为:日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额资产净值×0.01%/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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	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
中国农业银行	60,577,331.50	20,894,276.44	-	-	432,000,000.00	25,181.48

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

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
基金合同生效日(2012年8月29日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	200,000,000.00
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	-	200,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	22.05%

注:2013年6月24日及2013年6月26日,基金管理人分别申购本基金1亿元,合计2亿元,无申购费用。

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	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,189,239.65	37,086.37

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

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),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

本期末(2013年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末(2013年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	固定收益投资	1,500,910,631.30	91.60
	其中:债券	1,500,910,631.30	91.60
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	100,000,250.00	6.10
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,189,239.65	0.44
4	其他各项资产	30,508,173.41	1.86
	合计	1,638,608,294.36	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		15.57
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1)报告期末,本基金无债券回购融资余额。 (2)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。 (3)本基金基金合同第十二部分约定:本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的40%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过127天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	31.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	3.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.06	-
4	90天(含)—180天	4.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	34.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.86	-

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,509,113.32	13.47
	其中:政策性金融债	220,509,113.32	13.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,280,401,517.98	78.22
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
	合计	1,500,910,631.30	91.69
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,162,895.78	3.06

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	071303005	13中信CP005	1,600,000	159,984,697.82	9.77
2	110206	11国开06	1,500,000	150,360,937.28	9.19
3	071314001	13银河CP001	700,000	69,998,494.71	4.28
4	071315001	13申万CP001	600,000	59,998,018.17	3.67
5	071311002	13国信CP002	600,000	59,993,403.71	3.67
6	071310003	13光大证券CP003	600,000	59,992,438.06	3.67
7	041252050	12海化CP002	500,000	50,197,375.90	3.07
8	100236	10国开36	500,000	50,162,895.78	3.06
9	011214004	12中粮SCP004	500,000	50,063,435.60	3.06
10	041364008	13甘公投CP001	500,000	50,000,073.02	3.05

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	6
报告期内偏离度的最高值	0.2259%
报告期内偏离度的最低值	-0.4490%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1197%

注:表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

7.8.2 报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

7.8.3 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。

7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	10,020,289.32
3	应收利息	14,181,056.82
4	应收申购款	6,306,827.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	30,508,173.41

§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