

嘉实债券开放式证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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)	702,685,146.58	292,930,258.17	995,615,404.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,254,616.73	27,254,616.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,407,676.02	-1,587,077.94	-2,994,753.96
其中:1.基金申购款	251,492,053.99	101,077,619.88	352,569,673.87
2.基金赎回款	-252,899,730.01	-102,664,697.82	-355,564,427.83
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-34,149,609.02	-34,149,609.02
五、期末所有者权益(基金净值)	701,277,470.56	284,448,187.94	985,725,658.50

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)	825,417,204.08	277,320,633.64	1,102,737,837.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,633,971.95	41,633,971.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-85,059,850.41	-29,625,834.25	-114,685,684.66
其中:1.基金申购款	185,346,409.99	67,515,406.98	252,861,816.97
2.基金赎回款	-270,406,260.40	-97,141,241.23	-367,547,501.63
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	740,357,353.67	289,328,771.34	1,029,686,125.01

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 王虹

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保持一致的说明

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保持一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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关系的各关联方

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、基金注册登记人、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

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	3,083,732.58	3,107,996.32
其中:支付销售机构的客户维护费	182,544.47	181,715.62

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0.6%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x0.6%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

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	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/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

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交易费	1,027,910.86	1,035,998.74

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0.2%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x0.2%/当年天数。

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	1,260,647,169.78	94.92
	其中:债券	1,240,647,169.78	93.42
	资产支持证券	20,000,000.00	1.51
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	20,429,693.81	1.54
6	其他各项资产	47,009,981.19	3.54
合计		1,328,086,844.78	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

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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	166,818,197.20	16.92
2	央行票据	-	-
3	金融债	39,664,000.00	4.02
	其中:政策性金融债	39,664,000.00	4.02
4	企业债	512,559,357.28	52.00
5	企业短期融资券	200,167,000.00	20.31
6	中期票据	303,011,000.00	30.74
7	可转债	18,427,615.30	1.87
8	其他	-	-
合计		1,240,647,169.78	125.86

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1019219	12国债19	550,000	54,945,000.00	5.57
2	120015	12财国债15	500,000	49,445,000.00	5.02
3	010107	21国债(7)	442,580	46,488,603.20	4.72
4	1182402	11国债(TN71)	400,000	41,200,000.00	4.18
5	090209	09国债09	400,000	39,664,000.00	4.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1119029	鹏华广汇	200,000	20,000,000.00	2.03

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	41,908.86
2	应收证券清算款	19,959,274.39
3	应收股利	-
4	应收利息	26,168,244.78
5	应收申购款	840,553.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		47,009,981.19

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1110022	同仁转债	6,796,500.90	0.69
2	110018	国电转债	6,640,114.40	0.67
3	110015	石化转债	4,991,000.00	0.51

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者持有份额	个人投资者持有份额
35,997	19,481.55	220,206,841.57	31,404,081,628.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

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

项目	持有份额总额(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	271,469.72	0.04%

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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确认,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