

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:2011年8月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监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由独立董事签字同意,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约定,于2011年8月19日,复核了本报告期内基金净值、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,保证其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预示其未来表现。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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实货币证券投资基金。每只基金均为契约制开放式,适用一个基金合同和招募说明书。
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。
本报告日期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称:嘉实债券开放式证券投资基金
基金简称:嘉实债券
基金代码:070005
基金运作方式:契约开放式

2.2 基金产品说明
投资目标:以本基金为限,追求较高的组合回报。
投资策略:采取主动的自上而下的投资策略,通过对投资组合的相对价值分析,充分挖掘利率和债市变化带来的投资机会,运用久期调整、凸性控制、息差比较等策略构建组合,实现基金的投资目标。

2.3 基金管理人及基金托管人
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
法定代表人 魏尚贤 魏尚贤

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
3.1.2 期末数据和指标, 报告期末(2011年6月30日)

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
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

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
图:嘉实债券型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
0033年7月9日至2011年6月30日

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:嘉实债券型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
0033年7月9日至2011年6月30日

4.1 基金管理人及基金情况
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国内首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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验
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国内首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。

4.1.2 基金经理/基金经理小组及基金经理助理简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理(或联席基金经理)的时间, 证券从业年限, 说明

3.3 期末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组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值

3.4 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组合

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值

3.5 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(元), 公允价值

3.6 投资组合报告附注

3.6.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
3.6.2 本基金投资的前十名证券中,没有投资于流通受限的证券。

嘉实债券开放式证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末本基金基金份额净值为1.329元;本报告期基金份额净值增长率为-0.96%,同期业绩比较基准收益率为1.03%。
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2011年下半年,保持经济稳增长和控制通胀预期将是下半年的政策基调,随保障房、水利、区域经济建设提速,经济增长整体出现大幅回落的概率较低,经济低点已过,同比基本稳定;世界经济继续缓慢复苏,但面临的风险因素仍然较多。

6.4.1.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2 关联方关系
6.4.2.1 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。
6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.3 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.4 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.5 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.6 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.7 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.8 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.9 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.10 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.11 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.12 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.13 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.14 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.15 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.16 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.17 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.18 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.19 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.20 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

6.4.2.21 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方
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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元
买入股票成本(成交)总额 232,009,326.96
卖出股票收入(成交)总额 258,439,246.18

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值

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
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
7.9 投资组合报告附注

Table with 5 columns: 序号, 存出保证金, 金额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值