

嘉实多利分级债券型证券投资基金

2012 年年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 22 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多利分级债券型证券投资基金		
基金简称	嘉实多利分级债券		
基金主代码	160718		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	837,186,126.02 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 5 月 6 日		
下属分级基金的基金简称	嘉实多利分级债券	多利优先	多利进取
下属分级基金的交易代码	160718	150032	150033
报告期末下属分级基金份额总额	498,851,041.02 份	270,668,068.00 份	67,667,017.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，力争持续稳定增值。
投资策略	为持续稳妥地获得高于存款利率的收益，本基金首先运用“嘉实下行风险波动模型”，控制基金组合的年下行波动风险。在此前提下，本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率 × 90% + 沪深 300 指数收益率 × 10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010) 65215588	(0755) 83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010) 65182266	(0755) 83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2012 年	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	20,941,467.00	-10,962,206.21
本期利润	17,061,406.25	-1,531,629.85
加权平均基金份额本期利润	0.0164	-0.0008
本期加权平均净值利润率	1.67%	-0.08%
本期基金份额净值增长率	1.29%	0.17%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	3,383,373.06	-12,189,327.70
期末可供分配基金份额利润	0.0040	-0.0087
期末基金资产净值	815,189,253.63	1,399,229,816.56
期末基金份额净值	0.9737	1.0017
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	1.47%	0.17%

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) 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；(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
过去三个月	-0.67%	0.23%	1.51%	0.13%	-2.18%	0.10%
过去六个月	-1.20%	0.30%	0.47%	0.13%	-1.67%	0.17%
过去一年	1.29%	0.26%	3.19%	0.13%	-1.90%	0.13%

自基金合同 生效起至今	1.47%	0.23%	4.70%	0.14%	-3.23%	0.09%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

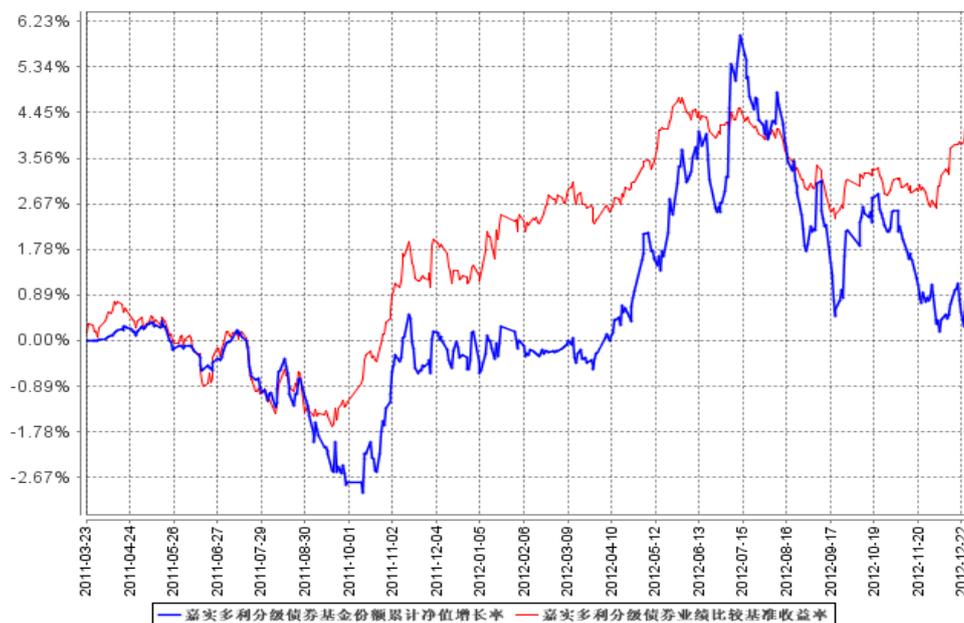
Return(t)=90%×(中国债券总指数(t)/中国债券总指数(t-1)-1) + 10%×(沪深 300 指数(t)/沪深 300 指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,...。

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

嘉实多利分级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



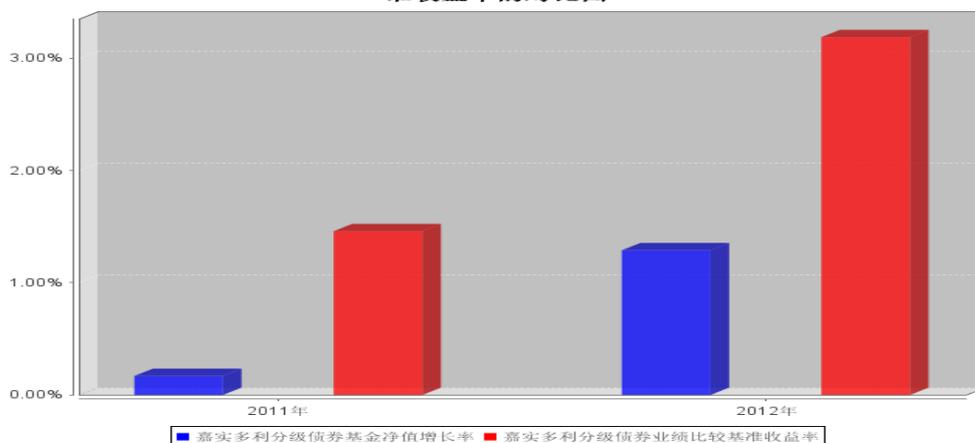
图：嘉实多利分级债券累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年3月23日至2012年12月31日)

注：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（十六（二）投资范围和（五）投资限制 2.基金投资组合限制）的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实多利分级债券自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2011 年 3 月 23 日，2011 年度的相关数据根据当年实际存续期（2011 年 3 月 23 日至 2011 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金基金合同二十（三）收益分配原则，本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。

§ 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。公司注册地在上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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 2012 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、37 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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王茜	本基金基金经理、嘉实多元债券基金经理、公司固定收益部总监	2011 年 3 月 23 日	-	10 年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理，中信证券固定收益部，长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008 年 11 月加盟嘉实基金。工商管理硕士，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合规守信情况的说明

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、《嘉实多利分级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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

公司采用基金业通用的公平交易模块，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，统计数据显示，正、负溢价次数和零溢价次数符合随机分布的特征，平均溢价率趋近于 0。

报告期内，公司旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3 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

2012 年中国经济成功实现了软着陆，工业增加值增速、国内生产总值增速等宏观经济指标从年初开始一路下行，在三季度才见底回升，CPI 则在 10 月降至 2010 年以来的低点后微幅反弹。但此轮经济见底的时点显著晚于市场在年初时的普遍预期。主要原因在于：1) 欧债危机的反复、美国经济弱复苏过程中的波折影响了中国的出口，全年出口增速低于年初 10% 的政府目标；2) 国内房地产市场受调控政策影响，销售同比大幅下滑导致房地产投资增速也出现了 08 年金融危机后最迅猛的下降；3) 央行出于对通胀的担心，在放松货币的政策选择上表现谨慎，仅在二季度下调

一次存款准备金率、两次基准利率，同时政府类项目大规模融资的挤出效应使得实体经济的融资成本一直维持在高位；4) 经历 09 年大规模刺激以来，社会的产能过剩、企业负债偏高的情况更为突出。多种因素叠加，在融资成本高企、需求疲弱、产能过剩的情况下，企业去库存的进程缓慢、加杠杆的热情骤减，导致经济的增速下降超过了市场乃至政府的预期。三季度后政府基建类投资开始大幅增加，美国经济的复苏趋势也基本确立，降准、降息的政策效应也逐步发挥作用，国内经济才显现出触底企稳的迹象。

在这样的宏观经济和政策背景下，2012 年股债市场走出了股熊债牛的走势。市场预期与实体经济状况、政策出台时机之间的偏差以及资金面因素是导致市场在此期间反复的主要因素。一季度基于对两会政策预期的背景下，股票市场有较大涨幅，利率债市场仅在 1 月延续了 2011 年四季度的牛市后就进入调整期，而中低评级信用债因乐观的经济预期收益率下降明显。二季度后随着政策预期落空和不断低于预期的经济数据的发布，股市一路走低，创出 09 年以来的新低，债市再掀一波牛市。三季度资金面的紧张导致股债齐跌。随着政府换届的顺利完成和经济数据的企稳回升，股票市场在 12 月大幅上扬；同时债券市场在央行大量逆回购支持下收益率仅小幅波动，静态收益更高的信用债更受市场追捧。转债市场走势与股市趋同，全年收益主要来源是债底抬升。

本基金在过去一年的操作中在大类资产配置和类属资产配置上存在一定的失误，业绩并不理想。一季度尽管我们规避了利率债的风险，却因对长期信用风险的慎重而错失了本年度低等级信用债野蛮生长的行情；二季度由于我们对政策和经济相对乐观的预判，错过了债券市场一波小牛市的机会；下半年我们及时抓住了三季度债券市场调整的机会，增配优质的中低信用等级信用债，波段操作了利率品种，把握了四季度以来的债市行情。权益类资产方面，上半年精选个券的策略获得了较好的收益，但下半年市场风格变化后，我们没有及时调仓以及塑化剂事件对组合重仓股的冲击，给组合收益带来了较大负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9737 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.29%，业绩比较基准收益率为 3.19%。

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，欧元区经济预计仍将在底部徘徊，美国在经历一季度财政悬崖冲击后经济将重回缓慢复苏的轨道。国内经济在新一轮库存周期带动下有望延续小幅回暖的趋势，但考虑到生产与库存的结构性矛盾，以及经济增长的源头——信贷、货币供应量增速已开始放缓，未来经济增速继续上升的空间和时间均有限。中国中长期的经济增长仍需要等待进一步改革的推动。

基于以上判断，我们认为在经济处于寻找新一轮增长引擎的起点、市场估值已经充分反映悲观预期的情况下，大类资产配置切换已经开始，但这一时段可能需要一段比较长的时间。我们预计全年权益类资产收益有望好于纯债资产，其中权益类资产受国内外经济、政策的影响在期间内可能出现较大幅度的波动，纯债资产中利率品种与信用品种之间的收益差异将较 2012 年显著收窄。组合资产配置上需要更加均衡。2013 年一季度，在经济数据、财报真空期和两会前夕，股票市场积极乐观的情绪预计仍会延续。债市在资金面宽松、融资成本下降的政策背景下在一季度也将有收益率下行的动力，但经济的逐步复苏、CPI 的上行压力将制约债市表现的空间。同时需要注意的是，资产质量问题的后周期特征、上层对影子银行的态度以及对政府融资平台的监管收紧等因素都可能影响到信用债市场。在后续的操作中，我们将平衡固定收益和权益资产的配置，适当提高权益类资产的比例中枢，积极把握阶段性和结构性的机会，择优遴选个股；纯债资产方面，我们将控制好组合久期，类属资产上仍以信用产品为主，并适时把握利率产品的波段操作机会；对于信用债，我们将加大风险排查力度，警惕可能的信用风险，在关注信用长期风险的同时积极参与市场博弈机会。

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验。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二十（三）收益分配原则“本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。”因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

嘉实多利分级债券型证券投资基金 2012 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师许康玮、金毅签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2013)第 20210 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实多利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	11,799,178.68	2,348,798.27
结算备付金		19,912,239.17	39,572,288.09
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,229,152,031.76	1,697,164,876.72
其中：股票投资		141,512,938.67	149,162,840.38
基金投资		-	-
债券投资		1,087,639,093.09	1,548,002,036.34
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	147,100,420.65
应收证券清算款		16,536,274.25	2,904,547.83
应收利息	7.4.7.5	14,557,187.81	29,798,196.39
应收股利		-	-
应收申购款		2,281.75	32,988.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,292,209,193.42	1,919,172,116.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		472,149,086.67	513,199,327.00
应付证券清算款		982,000.99	21,961.47
应付赎回款		2,024,411.27	4,784,915.34
应付管理人报酬		485,743.94	856,884.25
应付托管费		138,783.97	244,824.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	397,628.88	424,073.68
应交税费		210,245.89	-
应付利息		91,271.08	68,518.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	540,767.10	341,795.76
负债合计		477,019,939.79	519,942,299.94
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	803,347,477.73	1,396,806,430.22
未分配利润	7.4.7.10	11,841,775.90	2,423,386.34
所有者权益合计		815,189,253.63	1,399,229,816.56
负债和所有者权益总计		1,292,209,193.42	1,919,172,116.50

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，嘉实多利分级债券基金份额净值 0.9737 元，基金份额总额

498,851,041.02 份；多利优先份额净值 1.0388 元，基金份额总额 270,668,068.00 份；多利进取份额净值 0.7133 元，基金份额总额 67,667,017.00 份。本基金基金份额总额合计 837,186,126.02 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实多利分级债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 3 月 23 日(基 金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		39,701,247.28	22,542,094.07
1. 利息收入		48,039,938.76	61,815,127.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,233,372.39	916,220.47
债券利息收入		41,916,846.08	47,996,796.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,889,720.29	12,902,110.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-4,801,495.97	-48,882,927.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-31,283,536.07	-45,427,555.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,103,283.87	-3,615,051.13
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,378,756.23	159,679.04
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-3,880,060.75	9,430,576.36
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	342,865.24	179,318.17
减：二、费用		22,639,841.03	24,073,723.92
1. 管理人报酬		7,200,170.44	9,875,291.69
2. 托管费		2,057,191.55	2,821,512.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,388,599.65	2,282,215.94
5. 利息支出		10,461,819.21	8,658,498.72
其中：卖出回购金融资产支出		10,461,819.21	8,658,498.72
6. 其他费用	7.4.7.19	532,060.18	436,205.56
三、利润总额		17,061,406.25	-1,531,629.85
减：所得税费用		-	-

四、净利润		17,061,406.25	-1,531,629.85
-------	--	---------------	---------------

注：本基金合同生效日为 2011 年 3 月 23 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2011 年 3 月 23 日至 2011 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实多利分级债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	1,396,806,430.22	2,423,386.34	1,399,229,816.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,061,406.25	17,061,406.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-593,458,952.49	-7,643,016.69	-601,101,969.18
其中：1. 基金申购款	608,022,538.40	15,277,380.31	623,299,918.71
2. 基金赎回款	-1,201,481,490.89	-22,920,397.00	-1,224,401,887.89
四、本期向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）	803,347,477.73	11,841,775.90	815,189,253.63
项目	上年度可比期间 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 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）	2,340,210,108.68	-	2,340,210,108.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,531,629.85	-1,531,629.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-943,403,678.46	3,955,016.19	-939,448,662.27
其中：1. 基金申购款	6,148,027.25	-25,048.81	6,122,978.44

2. 基金赎回款	-949,551,705.71	3,980,065.00	-945,571,640.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,396,806,430.22	2,423,386.34	1,399,229,816.56

注：本基金合同生效日为 2011 年 3 月 23 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2011 年 3 月 23 日至 2011 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>李松林</u>	<u>王红</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,200,170.44	9,875,291.69
其中:支付销售机构的客户维护费	1,588,979.92	2,334,614.14

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 0.7%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×0.7%/当年天数。

7.4.4.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,057,191.55	2,821,512.01

注:支付基金托管人招商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。

7.4.4.3 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						
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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
招商银行	10,047,179.45	144,825,365.02	-	-	190,700,000.00	19,626.58
上年度可比期间						
2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 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
招商银行	-	-	-	-	440,200,000.00	39,342.34

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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（2012 年 12 月 31 日）及上年度末（2011 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	招商银行	11,799,178.68	234,667.09	2,348,798.27

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2012 年 12 月 31 日），本基金未持有流通受限的股票。

7.4.12.1.2 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
127001	海直转债	2012 年 12 月 24 日	2013 年 1 月 7 日	新债未上市	100.00	100.00	32,120	3,212,000.00	3,212,000.00	-

7.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2012 年 12 月 31 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2012 年 12 月 31 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 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 118,149,422.77 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
1282388	12 电网 MTN3	2013 年 1 月 7 日	99.85	300,000	29,955,000.00
1282450	12 洛矿 MTN2	2013 年 1 月 7 日	100.19	300,000	30,057,000.00
120238	12 国开 38	2013 年 1 月 7 日	99.86	170,000	16,976,200.00
041252048	12 联合水泥 CP003	2013 年 1 月 14 日	100.15	100,000	10,015,000.00
041253070	12 雅砻江 CP003	2013 年 1 月 14 日	100.30	200,000	20,060,000.00
041256040	12 大唐托电 CP001	2013 年 1 月 14 日	100.29	100,000	10,029,000.00
041260082	12 山煤 CP002	2013 年 1 月 14 日	100.21	100,000	10,021,000.00
合计				1,270,000	127,113,200.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 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 353,999,663.90 元，于 2013 年 1 月 4 日到期。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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	141,512,938.67	10.95
	其中：股票	141,512,938.67	10.95
2	固定收益投资	1,087,639,093.09	84.17

	其中：债券	1,087,639,093.09	84.17
	资产支持证券	-	-
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	31,711,417.85	2.45
6	其他各项资产	31,345,743.81	2.43
	合计	1,292,209,193.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	7,785,238.50	0.96
C	制造业	81,756,982.04	10.03
C0	食品、饮料	23,886,397.24	2.93
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,775,968.00	0.46
C5	电子	10,157,459.08	1.25
C6	金属、非金属	20,225,529.76	2.48
C7	机械、设备、仪表	22,758,107.96	2.79
C8	医药、生物制品	953,520.00	0.12
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,705,104.00	0.70
E	建筑业	5,550,601.63	0.68
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	8,720,574.50	1.07
H	批发和零售贸易	3,497,485.00	0.43
I	金融、保险业	26,353,508.00	3.23
J	房地产业	2,143,445.00	0.26
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	141,512,938.67	17.36

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	600585	海螺水泥	853,048	15,738,735.60	1.93
2	600887	伊利股份	661,938	14,549,397.24	1.78
3	600563	法拉电子	683,084	10,157,459.08	1.25
4	600016	民生银行	1,256,800	9,878,448.00	1.21
5	002304	洋河股份	100,000	9,337,000.00	1.15
6	601166	兴业银行	500,000	8,345,000.00	1.02
7	000063	中兴通讯	844,634	8,235,181.50	1.01
8	601169	北京银行	874,200	8,130,060.00	1.00
9	601088	中国神华	307,110	7,785,238.50	0.96
10	601766	中国南车	1,484,576	7,363,496.96	0.90

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.jsfund.cn>) 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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 (%)
1	002304	洋河股份	98,020,616.61	7.01
2	600519	贵州茅台	31,564,761.67	2.26
3	600256	广汇能源	27,252,505.13	1.95
4	000024	招商地产	27,162,506.28	1.94
5	000157	中联重科	25,680,980.87	1.84
6	002689	博林特	24,000,000.00	1.72
7	000002	万科A	23,942,871.85	1.71
8	000651	格力电器	22,091,046.18	1.58
9	002682	龙洲股份	21,200,000.00	1.52
10	002701	奥瑞金	20,736,000.00	1.48
11	600585	海螺水泥	20,224,304.53	1.45
12	300334	津膜科技	17,619,000.00	1.26
13	600887	伊利股份	17,497,067.14	1.25
14	601006	大秦铁路	16,889,285.44	1.21
15	600030	中信证券	14,994,441.47	1.07
16	601601	中国太保	12,803,132.72	0.92
17	600383	金地集团	12,681,467.82	0.91
18	603077	和邦股份	12,650,592.50	0.90

19	000527	美的电器	12,578,286.04	0.90
20	601166	兴业银行	12,035,096.21	0.86

8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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 (%)
1	002304	洋河股份	68,352,864.34	4.89
2	601006	大秦铁路	47,122,019.16	3.37
3	600519	贵州茅台	34,386,431.95	2.46
4	300334	津膜科技	32,784,120.59	2.34
5	000024	招商地产	31,534,827.48	2.25
6	600256	广汇能源	26,298,592.20	1.88
7	002689	博林特	24,446,654.03	1.75
8	000002	万科A	23,220,333.32	1.66
9	000651	格力电器	21,189,633.69	1.51
10	002701	奥瑞金	19,952,570.99	1.43
11	002682	龙洲股份	19,878,389.51	1.42
12	000157	中联重科	17,973,119.83	1.28
13	600048	保利地产	16,407,701.26	1.17
14	601668	中国建筑	15,920,000.00	1.14
15	000527	美的电器	15,860,728.13	1.13
16	600030	中信证券	14,054,275.82	1.00
17	600383	金地集团	12,977,115.47	0.93
18	601601	中国太保	12,507,529.27	0.89
19	600570	恒生电子	11,802,018.90	0.84
20	600340	华夏幸福	10,906,423.94	0.78

8.4.3 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	803,729,823.62
卖出股票收入（成交）总额	799,930,808.33

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,813,000.00	9.79
	其中：政策性金融债	79,813,000.00	9.79
4	企业债券	586,186,379.03	71.91
5	企业短期融资券	130,284,000.00	15.98
6	中期票据	150,599,000.00	18.47
7	可转债	140,756,714.06	17.27
8	其他	-	-
	合计	1,087,639,093.09	133.42

8.6 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	122080	11 康美债	450,000	45,184,500.00	5.54
2	1180087	11 彬煤债	400,000	40,528,000.00	4.97
3	041270006	12 光明 CP002	400,000	40,064,000.00	4.91
4	112093	11 亚迪 01	350,000	34,121,500.00	4.19
5	110018	国电转债	300,000	33,792,000.00	4.15

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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，在本报告编制日以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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	16,536,274.25
3	应收股利	-
4	应收利息	14,557,187.81

5	应收申购款	2,281.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	31,345,743.81

8.9.4 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	110018	国电转债	33,792,000.00	4.15
2	110015	石化转债	31,999,864.50	3.93
3	113002	工行转债	30,682,400.00	3.76
4	110019	恒丰转债	17,475,361.60	2.14
5	129031	巨轮转 2	5,719,246.26	0.70
6	110016	川投转债	5,032,325.20	0.62
7	110013	国投转债	2,238,516.50	0.27

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
嘉实多利分级债券	5,820	85,713.24	26,535,449.52	5.32%	472,315,591.50	94.68%
多利优先	1,282	211,129.54	195,019,904.00	72.05%	75,648,164.00	27.95%
多利进取	2,897	23,357.62	17,200.00	0.03%	67,649,817.00	99.97%
合计	9,624	86,989.41	221,572,553.52	26.47%	615,613,572.50	73.53%

注：(1)嘉实多利分级债券：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多利分级债券份额占嘉实多利分级债券总份额比例、个人投资者持有

嘉实多利分级债券份额占嘉实多利分级债券总份额比例 ;(2)多利优先: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多利优先份额占多利优先总份额比例、个人投资者持有多利优先份额占多利优先总份额比例 ;(3)多利进取: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多利进取份额占多利进取总份额比例、个人投资者持有多利进取份额占多利进取总份额比例。

9.2 期末上市基金前十名持有人

9.2.1 期末上市基金场内前十名持有人-多利优先份额

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中意人寿保险有限公司	23,754,324.00	8.78%
2	兴业证券-兴业-兴业证券金麒麟2号集合资产管理计划	20,592,640.00	7.61%
3	红塔证券股份有限公司	12,646,136.00	4.67%
4	兴业证券-兴业-兴业证券金麒麟5号集合资产管理计划	8,910,685.00	3.29%
5	中国烟草总公司河南省公司企业年金计划-中国建设银行	8,554,455.00	3.16%
6	中国出口信用保险公司	8,502,144.00	3.14%
7	新疆电力公司企业年金计划-交通银行	6,141,600.00	2.27%
8	山西晋城无烟煤矿业集团有限责任公司企业年金计划-中国工商银行	6,000,000.00	2.22%
9	安信证券-中信-安信理财3号宏观领航集合资产管理计划	5,869,400.00	2.17%
10	中国烟草总公司陕西省公司企业年金计划-中国工商银行	5,578,100.00	2.06%

9.2.2 期末上市基金场内前十名持有人-多利进取份额

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	季楠	3,309,884.00	4.89%
2	郭素珍	1,600,382.00	2.37%
3	朱运涛	1,025,818.00	1.52%
4	赵峰	948,137.00	1.40%
5	陈青安	760,000.00	1.12%
6	钟美兰	529,500.00	0.78%
7	王彼此	500,000.00	0.74%
8	郑仕平	500,000.00	0.74%
9	石兵	493,123.00	0.73%
10	李慕贤	460,100.00	0.68%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本期末，基金管理人的所有从业人员未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实多利分级债券	多利优先	多利进取
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）基金份额总额	2,340,210,108.68	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,378,672,845.22	14,506,868.00	3,626,717.00
本报告期基金总申购份额	684,675,949.40	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,244,296,253.60	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-320,201,500.00	256,161,200.00	64,040,300.00
本报告期期末基金份额总额	498,851,041.02	270,668,068.00	67,667,017.00

注：报告期期间基金总申购份额包含定期份额折算；拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换变动份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

2012 年 4 月 11 日，本基金管理人发布《关于基金行业高级管理人员变更的公告》，李道滨先生不再担任本公司副总经理。

(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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 2 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际证券有限责任公司	1	801,045,949.93	53.32%	696,959.06	53.99%	-
中信证券股份有限公司	1	701,388,860.32	46.68%	593,855.09	46.01%	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中银国际证券有限责任公司	814,914,333.82	43.14%	42,824,000,000.00	73.77%
中信证券股份有限公司	486,206,960.00	25.74%	15,224,994,000.00	26.23%
中国国际金融有限公司	587,855,458.07	31.12%	-	-

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2013 年 3 月 28 日