(上接D2版)

92)天相投资顾问有限公司

住所	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701		
办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层		
法定代表人	林义相	联系人	潘鸿
电话	010)66045446	传真	010)66045500
客服电话	010)66045678		
网址	www.txjijin.com		

93)江海证券有限公司

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	徐世旺
电话	0451)82336863	传真	0451)82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

94)中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	010)59355941	传真	010)66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

95)厦门证券有限公司

住所、办公地址	厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	0592)5161642	传真	0592)5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	0592)5163588

96)爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市南京西路758号24楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	021)32229888-3121	传真	021)62878783
客服电话	021)63340678	网址	www.ajzq.com

97)华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦37层		
法定代表人	陈林	联系人	楼斯佳
电话	021)50122222	传真	021)50122200
客服电话	4008209898	网址	www.cnhbstock.com

98)方正证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	雷杰	联系人	彭博
电话	0731)85832343	传真	0731)85832214
客服电话	95571	网址	www.founderse.com

99)英大证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	赵文宏	联系人	王睿
电话	0755)83007069	传真	0755)83007167
客服电话	0755)26982993	网址	www.ydsc.com.cn

100)西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢		
法定代表人	王珠林	联系人	米兵
电话	023)63786922	传真	023)63810422
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.com.cn

101)日信证券有限责任公司

住所	呼和浩特市新城区锡林南路18号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	陈韦杉
电话	010)88086830-730	传真	010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	010)88086830		

102)信达证券股份有限公司

住所	北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层		
办公地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心		
法定代表人	张志刚	联系人	唐静
电话	010)63081000	传真	010)63080978
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

103)东兴证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层		
法定代表人	崔海涛	联系人	黄英
电话	010)66555835	传真	010)66555246
客服电话	400-8888-993	网址	www.dxzq.net

104)华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区月坛北街26号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号A座3、5层		
法定代表人	丁之锁	联系人	梁宇
电话	010)58568007	传真	010)58568062
客服电话	010)58568118	网址	www.hrsec.com.cn

注:基金管理人于2005年1月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》,从即日起暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的嘉实理财通系列证券投资基金(嘉嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)的申购业务。对于此前通过闽发证券、汉唐证券认购、申购的嘉实理财通系列证券投资基金(嘉嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)基金份额,基金份额持有人仍可在闽发证券、汉唐证券正常办理赎回或转托管业务。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本系列基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

嘉实基金管理有限公司(同上)

(三)律师事务所和经办律师

名称	国浩律师集团(北京)事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	010)65890661	传真	010)65176801
经办律师	黄伟民		

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称	安永华明会计师事务所		
住所	中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层		
法定代表人	葛明	联系人	杨勃
电话	010)65246688	传真	010)85188298
经办注册会计师	杨勃、王珊珊		

四、基金的名称

本系列基金名称:嘉实理财通系列开放式证券投资基金

五、基金的类型

本系列基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

1.嘉实增长混合:投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。

2.嘉实稳健混合:在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。

3.嘉实债券:以本金安全为前提,追求较高的组合回报。

七、基金的投资方向

1.嘉实增长混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的中、小市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场后50%的上市公司中寻找具有高速成长潜力的中、小市值上市公司,投资于中、小市值上市公司的比例不少于基金股票部分的80%。

2.嘉实稳健混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场前50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司,投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的80%。

3.嘉实债券:主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、回购,以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金还可择机参与新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值的20%。

八、基金的投资策略

(一)股资策略

1.嘉实增长混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票。

a.资产配置

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:40%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%,现金留存比例:5%左右。

b.股票选择

本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面的分析入手,挑选具有成长潜力的股票。本基金将重点在流通市值占市场后50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i)股本规模相对较小的中小型上市公司,主营业务突出,过去两年主营业务收入占总收入80%以上,预期未来具有较强的股本扩张能力。

(ii)公司所处的行业发展前景良好,公司在本行业内具有独特的竞争优势,能充分把握行业发展的机遇,主营业务收入的增长率高于GDP增长率,预期净利润增长率大于10%。

(iii)公司的经营模式和技术创新能力与同行相比保持相对优势,能够不断推出符合市场需求的新产品,满足市场需要。

(iv)公司管理层具有良好的应变能力,能够对外部环境变化迅速作出反应。

基金管理人建立了一套基于成长性的上市公司综合评价指标体系,通过对上市公司所处行业的持续增长潜力及其在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行评估,综合考察上市公司的成长性以及这种成长性的可靠性和持续性,结合其股价所对应的市盈率水平与其成长性相比是否合理,作出具体的投资决策。

c.债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的20%。

2.嘉实稳健混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于具有竞争优势的行业龙头、优势企业的上市公司的股票,通过基本面分析挖掘行业优势企业,获取稳定的长期回报。

a.资产配置

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,投资组合中股票投资比例浮动范围:40%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%,现金留存比例:5%左右。

b.股票选择

主要投资于那些具有竞争优势的行业龙头、优势企业。

本基金将重点在流通市值占市场前50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i)行业发展状况良好,企业已经经历了一段快速成长期,步入稳定发展阶段,企业具备较强的抗风险能力,已经或即将成为行业的龙头、优势企业,企业经营在相对稳健的同时能够保持一定的持续成长能力;

(ii)企业市场竞争能力强,盈利能力稳定,主营业务利润率大于当年行业平均水平,预期主营业务收入增长率超过行业平均水平;

(iii)良好的财务状况,财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高,剔除资产负债率大于85%的公司(金融行业上市公司除外),具备潜在的良好的分红能力;

(iv)企业在产品开发、技术进步方面具有相当的竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应。

c.债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;另一方面考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的20%。

3.嘉实债券

在有效管理风险的基础上,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,充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会;应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合,实现基金的保值增值。

a.资产配置

本基金资产配置的基本原则是:充分比较各类资产的预期风险收益状况,在满足组合流动性要求的条件下,追求尽可能高的组合收益率。本基金投资于国债及信用等级为BBB级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的80%。

(i)类属配置

整个债券组合中类属债券投资中轴配置比例为:银行间国债40%,交易所国债30%,金融债20%,企业债10%。

如果流动性改善的趋势持续,将在现有的类属债券投资中轴配置比例的基础上,考虑增持金融债与企业债。增持后,两者比例合计最多可以达到50%的上限。

(ii)期限配置

投资组合中债券的剩余期限的配置是债券投资中资产配置的另一个重要方面,与期限结构配置相关的因素主要是市场利率水平的变化方向和幅度的大小,本基金将结合收益率曲线变化的预测,采取两种策略进行期限结构配置:首先是采用主动型的策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定短、中、长期三类债券的投资比例;然后与数量化方法相结合,完成投资组合中债券的期限结构配置。

(iii)浮息债券和固息债券的配置

浮息债券具有规避利率上涨风险的功能,但是浮息债券在规避利率上涨风险的同时,还要承担收益率较低的风险。因此,将从两方面确定固息债券和浮息债券的投资比例,一是利率走势的判断,如果判断利率水平上涨,本基金将增加浮息债券的投资比例。二是比较短期债券和浮息债券的当期收益状况,用浮息债券代替短期债券,提高组合的收益水平。

b.组合构建策略与方法

在确定每类属资产配置以后,在每一类属债券内部,本产品采取一系列策略构建债券投资组合。本基金产品的组合构建策略主要包括:久期调整、凸度挖掘、波动性交易、品质互换、回购套利等。

c.债券选择标准

本基金的选券基本标准为:在符合本基金产品资产配置策略和组合构建策略的条件下,选择能够保持策略延续性和稳定性、投资组合流动性及风险控制要求的债券。

(i)符合实施前述的资产配置策略、投资策略的要求;

(ii)保持投资策略的延续性和稳定性;

(iii)符合风险管理指标,包括VaR和流动性指标的要求;

(iv)价值严重被低估且符合投资总体理念的要求;

(v)降低积极管理风险的要求;

(vi)银行间市场询价达到三家以上;

(vii)在其他条件相同时,优先选择双边报价商报价债券列表中的债券;

(viii)优先选择央行公开市场操作的品种。

(二)投资管理程序

1、研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金在其他重要投资资产类别上的具体配置计划。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定本系列基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、基金经理小组将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6、风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控,并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险分析报告。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购、赎回和转换导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。

8、在确保基金份额持有人利益的前提下,基金管理人有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

九、基金的业绩比较基准

嘉实增长混合:巨潮500(小盘)指数

嘉实稳健混合:巨潮200(大盘)指数

嘉实债券:中央国债登记结算公司的中国债券指数

十、基金的风险收益特征

1.嘉实增长混合:本基金属于中高风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。

2.嘉实稳健混合:本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。

3.嘉实债券:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

本系列基金托管人中国银行股份有限公司根据本系列基金合同规定,于2010年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2010年6月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

(1)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,786,230,561.30	64.64
	其中:股票	2,786,230,561.30	64.64
2	固定收益投资	920,178,496.70	21.35
	其中:债券	920,178,496.70	21.35
	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	577,844,008.43	13.41
6	其他资产	26,114,820.13	0.61
	合计	4,310,367,886.56	100.00

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	42,834,526.80	1.00
B	采掘业	48,429,835.04	1.13
C	制造业	1,688,372,309.10	39.40
C0	食品、饮料	397,251,872.61	9.27
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	61,761,338.90	1.44
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,196,548.51	2.85
C5	电子	24,777,862.80	0.58
C6	金属、非金属	136,671,714.13	3.19
C7	机械、设备、仪表	214,032,515.00	4.99
C8	医药、生物制品	706,158,172.93	16.48
C99	其他制造业	25,522,284.22	0.60
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,909,354.10	0.28
F	交通运输、仓储业	5,795,398.21	0.14
G	信息技术业	567,093,046.61	13.23
H	批发和零售贸易	27,850,129.16	0.65
I	金融、保险业	343,776,668.12	8.02
J	房地产业	42,622,472.20	0.99
K	社会服务业	937,158.20	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,609,663.76	0.15
	合计	2,786,230,561.30	65.01

(3)报告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明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	6,756,857	198,516,458.66	4.63
2	600406	国电南瑞	5,135,143	197,138,139.77	4.60
3	600570	恒生电子	10,534,836	158,233,236.72	3.69
4	601318	中国平安	3,234,429	151,403,621.49	3.53
5	600079	人福医药	7,238,048	115,808,768.00	2.70
6	000848	承德露露	3,114,464	112,120,704.00	2.62
7	600518	康美药业	7,690,127	94,434,759.56	2.20
8	600750	江中药业	3,019,783	93,160,305.55	2.17
9	000650	仁和药业	6,089,622	90,613,575.36	2.11
10	000423	东阿阿胶	2,440,153	84,819,718.28	1.98

(4)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	47,862,053.50	1.12
2	央行票据	781,038,000.00	18.22
3	金融债券	89,462,000.00	2.09
	其中:政策性金融债	89,462,000.00	2.09
4	企业债券	1,816,443.20	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	可转换债券	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
	合计	920,178,496.70	21.47

(5)报告期末前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801035	08央行票据35	2,400,000	243,936,000.00	5.69
2	0801038	08央行票据38	900,000	91,521,000.00	2.14
3	1001032	10央行票据32	900,000	90,135,000.00	2.10
4	090301	09进出01	800,000	79,480,000.00	1.85
5	1001019	10央行票据19	800,000	78,280,000.00	1.83

(6)报告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)报告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)投资组合报告附注

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。

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。

③报告期末其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	1,514,630.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	108,000.00
4	应收利息	7,745,594.54
5	应收申购款	16,746,594.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	26,114,820.13

④报告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。

⑤报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票简称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	151,403,621.49	3.53	筹划重大资产重组

2.嘉实稳健混合

(1)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,130,789,840.21	56.44
	其中:股票	7,130,789,840.21	56.44
2	固定收益投资	3,477,937,289.73	27.53
	其中:债券	3,477,937,289.73	27.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,768,056.63	0.01
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	1,923,197,876.67	15.22
6	其他资产	99,669,410.95	0.79
	合计	12,633,362,474.19	100.00

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	470,312,243.52	3.74
C	制造业	3,741,693,958.03	29.78
C0	食品、饮料	1,560,269,969.02	12.42
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	508,457,011.33	4.05
C5	电子	171,843,741.30	1.37
C6	金属、非金属	452,492,123.19	3.60
C7	机械、设备、仪表	444,596,142.73	3.54
C8	医药、生物制品	582,074,248.48	4.63
C99	其他制造业	21,960,721.98	0.17
D	电力、煤气及水的生产和供应业	88,932,518.16	0.71
E	建筑业	245,699,852.58	1.96
F	交通运输、仓储业	557,899,053.00	4.44
G	信息技术业	640,484,451.88	5.10
H	批发和零售贸易	405,193,935.47	3.22
I	金融、保险业	816,345,452.71	6.50
J	房地产业	67,580,825.66	0.54
K	社会服务业	64,448,483.00	0.51
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	32,199,066.20	0.26
	合计	7,130,789,840.21	56.75

(3)报告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明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	19,661,339	577,650,139.82	4.60
2	000895	双汇发展	12,270,000	534,603,900.00	4.25
3	600028	中国石化	42,998,163	336,245,634.66	2.68
4	601006	大秦铁路	40,910,988	334,242,771.96	2.66
5	000039	中集集团	27,827,725	331,149,927.50	2.64
6	600276	恒瑞医药	7,645,973	298,728,165.11	2.38
7	600050	中国联通	53,999,910	287,819,520.30	2.29
8	600688	S上石化	33,515,553	256,058,824.92	2.04
9	600015	华夏银行	22,477,506	249,949,866.72	1.99
10	601668	中国建筑	69,999,958	245,699,852.58	1.96

(4)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	35,227,500.00	0.28
2	央行票据	1,402,487,000.00	11.16
3	金融债券	1,620,043,000.00	12.89
	其中:政策性金融债	1,542,659,000.00	12.28
4	企业债券	132,280,788.10	1.05
5	企业短期融资券	-	-
6	可转换债券	287,899,001.63	2.29
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
	合计	3,477,937,289.73	27.68

(5)报告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

序号	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080225	08国开25	10,000,000	1,000,100,000.00	7.96
2	1001021	10央行票据21	3,100,000	303,304,000.00	2.41
3	090223	09国开23	2,900,000	289,478,000.00	2.30
4	110003	新钢转债	2,068,060	217,166,980.60	1.73
5	0801035	08央行票据35	1,500,000	152,460,000.00	1.21

(6)报告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)报告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

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580027	长虹CWB1	771,067	1,768,056.63	0.01

报告期末本基金仅持有“长虹CWB1”。

(8)投资组合报告附注

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。

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。

③报告期末其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	9,733,844.93
2	应收证券清算款	42,281,258.16
3	应收股利	-
4	应收利息	46,387,438.78
5	应收申购款	1,266,869.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	99,669,410.95

④报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	217,166,980.60	1.73
2	110004	厦工转债	20,245,140.50	0.16
3	110078	澄星转债	7,976,245.90	0.06
4	125709	唐钢转债	17,582,492.65	0.14
5	125960	锡业转债	24,928,141.98	0.20

⑤报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票简称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	534,603,900.00	4.25	筹划重大资产重组

3.嘉实债券

(1)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	93,000,319.29	4.45
	其中:股票	93,000,319.29	4.45
2	固定收益投资	1,815,093,337.00	86.79
	其中:债券	1,815,093,337.00	86.79
	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	55,975,156.84	2.68
6	其他资产	127,206,887.70	6.08
	合计	2,091,275,700.83	100.00

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,326,308.44	0.31
B	采掘业	5,226,277.47	0.25
C	制造业	37,722,570.45	1.84
C0	食品、饮料	1,953,866.56	0.10
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	2,416,294.90	0.12
C5	电子	11,679,594.83	0.57
C6	金属、非金属	9,394,005.11	0.46
C7	机械、设备、仪表	5,166,514.61	0.25
C8	医药、生物制品	6,434,294.44	0.31
C99	其他制造业	678,000.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,525,954.95	0.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,486,078.25	1.34
H	批发和零售贸易	11,696,729.73	0.57
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	16,400.00	0.00
	合计	93,000,319.29	4.54

(3)报告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明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002419	天虹商场	210,987	7,213,645.53	0.35
2	300094	国联水产	439,938	6,326,308.44	0.31
3	300059	东方财富	90,000	4,872,600.00	0.24
4	002431	棕榈园林	82,455	4,525,954.95	0.22
5	002441	众业达	112,358	4,483,084.20	0.22
6	002436	兴森科技	146,160	4,472,496.00	0.22
7	002439	启明星辰	114,942	4,185,038.22	0.20
8	300086	康芝药业	64,683	3,397,151.16	0.17
9	002353	杰瑞股份	40,000	3,146,000.00	0.15
10	300089	长城集团	142,045	2,809,650.10	0.14

(4)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	455,262,781.30	22.20
2	央行票据	461,042,000.00	22.48
3	金融债券	62,497,000.00	3.05
	其中:政策性金融债	62,497,000.00	3.05
4	企业债券	706,300,345.90	34.45
5	企业短期融资券	129,991,000.00	6.34
6	可转换债券	209.80	0.00
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
	合计	1,815,093,337.00	88.52

(5)报告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

序号	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001037	10央行票据37	2,000,000	200,160,000.00	9.