嘉实研究精选股票型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31日

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
报告送出日期:2011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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011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2010年1月1日起至2010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

基金简称	嘉实研究精选股票
基金主代码	070013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月27日
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
报告期末基金份额总额	1,704,681,092.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续、系统、深入的基本面研究,挖掘企业内在价值,寻找具备长期增长潜力的上市公司,以获取基金资产长期稳定增值。
投资策略	优先考虑股票类资产的配置,采用"自下而上"的精选策略,定量分析与定性分析相结合的方法,精选个股,构建股票投资组合;剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产,债券投资采取"自上而下"的策略。
业绩比较基准	沪深300指数×95%+上证国债指数×5%
风险收益特征	较高风险,较高收益

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	(010)66594855
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

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	2010 年	2009 年	2008年5月27日至2008年12月31日
本期已实现收益	259,524,870.27	1,289,889,339.72	-16,202,596.81
本期利润	357,619,411.09	1,530,342,074.46	29,596,969.59
加权平均基金份额本期利润	0.1357	0.7220	0.0180
本期加权平均净值利润率	8.81%	50.12%	1.86%
本期基金份额净值增长率	9.03%	72.71%	2.90%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	884,795,644.01	1,049,165,735.15	-9,535,816.17
期末可供分配基金份额利润	0.5190	0.3941	-0.0060
期末基金资产净值	2,901,096,875.75	4,155,070,717.51	1,646,613,250.74
期末基金份额净值	1.702	1.561	1.029
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	93.78%	77.72%	2.90%

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	6.98%	1.56%	6.26%	1.68%	0.72%	-0.12%
过去六个月	23.87%	1.32%	20.96%	1.47%	2.91%	-0.15%
过去一年	9.03%	1.28%	-11.66%	1.50%	20.69%	-0.22%
自基金合同生效起至今	93.78%	1.34%	-10.40%	2.08%	104.18%	-0.74%

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数×95%+上证国债指数×5%。沪深300指数是沪深证券交易所联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,具有良好的A股市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。由于本基金优先配置股票资产,债券、现金类资产主要作为流动性管理工具,因此本基金采用上述两个指数组成的复合指数作为业绩比较基准。

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)=95%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+5%*(上证国债指数(t)/上证国债指数(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

注1:按基金合同约定,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投资组合比例符合基金合同"十四、基金的投资(二)投资范围、(七)2.投资组合比例限制"的约定。

注2:2010年5月8日,本基金管理人发布《关于调整嘉实研究精选股票基金经理的公告》,刘红辉先生不再担任本基金基金经理职务;2010年6月8日《关于嘉实研究精选股票基金经理变更的公告》,党开宇女士不再担任本基金基金经理,聘请张弢先生担任本基金基金经理职务。

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

注:本基金基金合同生效日为2008年5月27日,2008年度的相关数据根据当年实际存续期(2008年5月27日至2008年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	
2009年	2.1000	278,958,754.95	223,412,824.40	502,371,579.35	
2008年	-	-	-	-	
合计	2.1000	278,958,754.95	223,412,824.40	502,371,579.35	

§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,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。

截至2010年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式基金、21只开放式基金,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300指数(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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金基金、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		
党开宇	本基金基金经理	2008年5月27日	2010年6月8日	9年	曾任招商证券公司证券投资部投资经理;2003年10月加入诺安基金,曾任诺安平衡混合基金经理助理、基金经理,诺安股票基金经理。2006年9月加盟嘉实基金,曾任嘉实策略混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实稳健混合基金经理。现任公司机构投资部总监。硕士,CFA,CPA,具有基金从业资格,中国国籍。
刘红辉	本基金基金经理	2008年5月27日	2010年5月8日	5年	2004年7月加入嘉实基金管理公司,任产品经理、基金经理助理。经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。
张弢	本基金基金经理	2010年6月8日	-	8年	曾任兴安证券行业分析师。2005年9月加盟嘉实基金任行业分析师,曾任社保组合基金经理、嘉实增长混合基金经理。经济学硕士,CFA,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)党开宇、刘红辉任职日期是指本基金合同生效之日,张弢任职日期和表中"离任日期"均指公司作出决定后公告之日;(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、《嘉实研究精选股票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,本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,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基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与其他投资组合的投资风格不同,未与其他投资组合进行业绩比较。

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

2010年是中国经济和资本市场都比较波动的一段时期,经济上通胀率创下了新高,由此引来各层面或迟或早的紧缩政策。在资本市场上,大盘处于箱体震荡的区间,但大小盘股的表现差异到达了历史最大幅度,针对宏观数据特别是通胀的预期和博弈成为影响市场走向的重要线索和脉络。

与市场的波动相比,行业结构的分化更加剧烈。以房地产为代表的传统投资链条大部分都乏善可陈,而在政策预期的支持下和消费类电子火爆销售的刺激下,TMT等新兴行业表现十分突出。

在全年的操作中,我们始终以精选个股为主要的投资策略,在持续成长类股票中获得了较好的收益。从全年来看最大的失误主要集中在两个方面:第一、低估了政府打压房价的决心和力度,较早的重配了地产行业。第二、整体性的错过了TMT行业的投资机会。

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1.702元;本报告期基金份额净值增长率为9.03%,业绩比较基准收益率为-11.66%,本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率20.69个百分点。

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,在就业拉动和房价回升的双重作用下,美国经济的主旋律应该是走出底部、稳步复苏。中国经济的外部原因将明显好于2010年。同时,我们认为,国内经济也将迎来较好的环境,通胀率将走出高位,政府力推的抑制房产泡沫的措施也将取得阶段性成果,流动性会告别2010年底的紧张状态。

在资本市场上,在考虑2011年一个中性假设下的业绩增长的情况下,市场的估值水平处于较低的水平,整体市场的投资机会大于风险,可以积极地选择低估的投资标的。当然,我们认为2011年市场的表现不会是单边向上的,经济转型的变革、大量的IPO供应、产业资本在二级市场上的博弈,均在不同层面深刻地影响着市场的结构变化。我们判断整个市场处于箱体震荡的形态,结构分化依然是寻找机会的方向。

2011年,本基金将重点关注三类投资机会:第一、维持对持续成长股票的投资,并增加个股的涵盖面和集中度,如:医药、食品饮料、TMT;第二、通胀压力缓解的背景下,重点关注周期股的投资机会,特别是股价处于底部的行业机会;第三、业绩有望超预期的机会,特别是那些估值有较大提升空间的行业,如家电、客车等。

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、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成,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

(1)报告期内本基金未实施利润分配;

(2)根据本基金基金合同《十九(二)收益分配原则》"全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的30%"的约定,本期已实现收益为259,524,870.27元,应分配金额为77,857,461.08元以上。

(3)2011年1月18日,本基金管理人发布《嘉实研究精选股票型证券投资基金2010年年度收益分配公告》,收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利1.560元,权益登记日、除息日为2011年1月21日,红利发放日为2011年1月24日,已分配利润258,914,754.48元,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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实研究精选股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实研究精选股票型证券投资基金2010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、注册会计师汪棣、陈宇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2011)第20644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:嘉实研究精选股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	122,321,618.53	113,391,544.36
结算备付金		9,136,251.68	16,688,131.67
存出保证金		1,888,562.15	6,252,096.24
交易性金融资产	7.4.7.2	2,878,726,204.15	4,035,451,748.71
其中:股票投资		2,728,275,734.43	3,862,492,042.31
基金投资		-	-
债券投资		150,450,469.72	172,959,706.40
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	-	-
应收证券清算款		23,721,680.21	-
应收利息	7.4.7.5	5,431,233.93	489,285.98
应收股利		-	-
应收申购款		3,259,208.36	4,315,569.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,044,484,759.01	4,176,588,376.53

负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		-	-
应付证券清算款		814,143.60	-
应付赎回款		130,421,283.02	6,960,685.37
应付管理人报酬		4,848,531.97	5,171,079.79
应付托管费		808,088.64	861,846.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,390,016.92	8,400,546.45
应交税费		3,876.80	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	101,942.31	123,500.77
负债合计		143,387,883.26	21,517,659.02
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,704,681,092.69	2,662,238,500.28
未分配利润	7.4.7.10	1,196,415,783.06	1,492,832,217.23
所有者权益合计		2,901,096,875.75	4,155,070,717.51
负债和所有者权益总计		3,044,484,759.01	4,176,588,376.53

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.702元,基金份额总额1,704,681,092.69份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实研究精选股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		479,239,125.85	1,657,305,379.89
1.利息收入		11,316,966.97	7,834,410.96
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,596,367.39	2,594,628.98
债券利息收入		7,345,924.31	5,239,781.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		374,675.27	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		366,130,750.75	1,403,268,457.40
其中:股票投资收益	7.4.7.12	343,751,520.77	1,385,959,324.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-459,716.95	-1,823,720.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	463,216.59
股利收益	7.4.7.16	22,838,946.93	18,669,636.32
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	98,094,540.82	240,452,734.74
4. 汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	3,696,867.31	5,749,776.79
减:二、费用		121,619,714.76	126,963,305.43
1.管理人报酬		60,960,781.44	45,206,400.46
2.托管费		10,160,130.23	7,534,400.03
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	49,790,439.30	73,669,076.85
5.利息支出		259,610.29	130,963.36
其中:卖出回购金融资产支出		259,610.29	130,963.36
6.其他费用	7.4.7.20	448,753.50	422,464.73
三、利润总额		357,619,411.09	1,530,342,074.46
减:所得税费用		-	-
四、净利润		357,619,411.09	1,530,342,074.46

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实研究精选股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	2,662,238,500.28	1,492,832,217.23	4,155,070,717.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	357,619,411.09	357,619,411.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-957,557,407.59	-654,035,845.26	-1,611,593,252.85
其中:1.基金申购款	1,437,365,868.33	791,998,650.63	2,229,364,518.96
2.基金赎回款	-2,394,923,275.92	-1,446,034,495.89	-3,840,957,771.81
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)	1,704,681,092.69	1,196,415,783.06	2,901,096,875.75
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	1,600,892,516.15	45,720,734.59	1,646,613,250.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,530,342,074.46	1,530,342,074.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,061,345,984.13	419,140,987.53	1,480,486,971.66
其中:1.基金申购款	4,436,200,626.13	1,805,014,773.93	6,241,215,400.06
2.基金赎回款	-3,374,854,642.00	-1,385,873,786.40	-4,760,728,428.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-502,371,579.35	-502,371,579.35
五、期末所有者权益(基金净值)	2,662,238,500.28	1,492,832,217.23	4,155,070,717.51

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:

赵学军	李松林	王红
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一致。

7.4.2 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

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、基金注册登记机构、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
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
国都证券有限责任公司("国都证券")	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

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

本报告期及上年度可比期间,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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	60,960,781.44	45,206,400.46
其中:支付销售机构的客户维护费	2,944,474.46	1,933,158.17

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1.50%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×1.50% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,160,130.23	7,534,400.03

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0.25%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 ×0.25% / 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31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
中国银行	-	20,343,484.66	-	-	180,480,000.00	145,843.65

注:上年度可比期间(2009年1月1日至2009年12月31日)本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金合同生效日(2008年5月27日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	40,034,200.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	40,034,200.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注:(1)期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回/卖出总份额含转换出份额。(2)在本基金2008年发售期内,基金管理人通过代销机构认购本基金4000万元,认购费为1,000元。(3)2009年3月27日,本基金管理人通过代销机构赎回本基金40,034,200份基金份额,赎回费率为0.50%。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
立信投资有限责任公司	9,199,793.13	0.54	9,724,793.13	0.37

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
中国银行	122,321,618.53	3,380,427.30	113,391,544.36	2,272,738.61

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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

本期及上年度可比期间,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(2010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

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票

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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601126	四方股份	2010年12月28日	2011年3月31日	ipo网下锁定三个月	23.00	31.11	40,473	930,879.00	1,259,115.03	-
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年1月7日	未上市	5.99	5.99	5,000	29,950.00	29,950.00	-
300156	天立环保	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	58.00	58.00	500	29,000.00	29,000.00	-
300158	振东制药	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	38.80	38.80	500	19,400.00	19,400.00	-
002536	西泵股份	2010年12月31日	2011年1月11日	未上市	36.00	36.00	500	18,000.00	18,000.00	-
002534	杭锅股份	2010年12月31日	2011年1月10日	未上市	26.00	26.00	500	13,000.00	13,000.00	-
002535	林州重机	2010年12月31日	2011年1月11日	未上市	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	-

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券

报告期末(2010年12月31日)本基金未持有流通受限的债券。

7.4.5.1.3 受限证券类别:其他

报告期末(2010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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010年12月6日	筹划国资改革事宜	37.13	未知	未知	6,529,467	227,121,972.92	242,439,109.71	-
600518	康美药业	2010年12月28日	配股申购期间停牌	19.71	2011年1月6日	17.29	1,700,053	24,904,940.63	33,508,044.63	-
002439	启明星辰	2010年12月29日	筹划重大资产重组	42.55	未知	未知	500,000	18,634,864.25	21,275,000.00	-

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

报告期末(2010年12月31日)本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末(2010年12月31日)本基金无交易所债券正回购余额。

§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	2,728,275,734.43	89.61
	其中:股票	2,728,275,734.43	89.61
2	固定收益投资	150,450,469.72	4.94
	其中:债券	150,450,469.72	4.94
	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	131,457,870.21	4.32
6	其他各项资产	34,300,684.65	1.13
7	合计	3,044,484,759.01	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	62,561,059.88	2.16
B	采掘业	51,080,000.00	1.76
C	制造业	1,740,131,189.95	59.98
C0	食品、饮料	364,617,000.00	12.57
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,885,670.00	0.58
C4	石油、化学、塑胶、塑料	306,039,558.67	10.55
C5	电子	69,202,312.93	2.39
C6	金属、非金属	59,741,133.10	2.06
C7	机械、设备、仪表	490,182,340.51	16.90
C8	医药、生物制品	406,089,783.33	14.00
C99	其他制造业	27,373,391.41	0.94
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	249,670,851.21	8.61
H	批发和零售贸易	334,692,072.44	11.54
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	243,969,431.00	8.41
K	社会服务业	46,171,129.95	1.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,728,275,734.43	94.04

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600315	上海家化	6,529,467	242,439,109.71	8.36
2	600887	伊利股份	6,000,000	229,560,000.00	7.91
3	600239	云南城投	12,298,300	228,379,431.00	7.87
4	002152	广电运通	3,100,049	168,580,664.62	5.81
5	600079	人福医药	6,500,000	165,620,000.00	5.71
6	002419	天虹商场	3,013,865	143,761,360.50	4.96
7	000858	五 粮 液	3,900,000	135,057,000.00	4.66
8	000651	格力电器	5,800,000	105,154,000.00	3.62
9	600271	航天信息	3,400,000	93,534,000.00	3.22
10	000418	小天鹅A	3,544,384	70,001,584.00	2.41

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累计买入金额超出期初基金资产净值2%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	601006	大秦铁路	321,176,582.34	7.73
2	000858	五 粮 液	315,769,998.33	7.60
3	000069	华侨城A	295,497,470.83	7.11
4	600079	人福医药	284,040,710.20	6.84
5	601111	中国国航	263,371,612.58	6.34
6	600315	上海家化	260,612,456.36	6.27
7	600036	招商银行	254,658,627.17	6.13
8	601318	中国平安	239,159,624.18	5.76
9	600048	保利地产	233,931,648.74	5.63
10	600239	云南城投	223,384,459.56	5.38
11	600519	贵州茅台	207,981,860.21	5.01
12	601398	工商银行	199,990,877.75	4.81
13	600276	恒瑞医药	199,354,715.02	4.80
14	002419	天虹商场	188,592,737.97	4.54
15	000602	金马集团	182,066,690.69	4.38
16	600631	百联股份	177,983,428.70	4.28
17	600312	平高电气	162,495,368.09	3.91
18	601628	中国人寿	161,376,512.41	3.88
19	600261	浙江阳光	160,794,817.45	3.87
20	000651	格力电器	157,886,119.84	3.80
21	600362	江西铜业	148,938,309.45	3.58
22	600015	华夏银行	148,492,128.62	3.57
23	600863	内蒙华电	142,781,950.71	3.44
24	002152	广电运通	139,250,607.17	3.35
25	000998	隆平高科	131,506,956.31	3.16
26	600816	安信信托	130,420,708.59	3.14
27	600859	王府井	129,685,225.40	3.12
28	600879	航天电子	128,275,274.98	3.09
29	600489	中金黄金	124,851,830.30	3.00
30	002232	启明信息	124,294,488.30	2.99
31	600655	豫园商城	123,654,888.69	2.98
32	600376	首开股份	121,846,038.15	2.93
33	000002	万 科A	121,207,889.02	2.92
34	000418	小天鹅A	119,137,582.27	2.87
35	601186	中国铁建	117,823,585.13	2.84
36	600673	东阳光铝	115,829,617.80	2.79
37	000400	许继电气	115,713,269.11	2.78
38	601601	中国太保	115,413,338.04	2.78
39	601989	中国重工	114,593,206.91	2.76
40	600887	伊利股份	111,277,974.76	2.68
41	600804	鹏博士	110,901,253.66	2.67
42	002269	美邦服饰	110,592,221.40	2.66
43	000869	张 裕A	109,645,094.29	2.64
44	600050	中国联通	106,667,462.56	2.57
45	600271	航天信息	106,508,045.78	2.56
46	600111	包钢稀土	105,661,747.92	2.54
47	000338	潍柴动力	104,334,805.54	2.51
48	600038	哈飞股份	104,306,928.33	2.51
49	600697	欧亚集团	104,151,518.94	2.51
50	600066	宇通客车	102,093,731.73	2.46
51	600525	长园集团	100,350,974.90	2.42
52	000059	辽通化工	97,776,265.28	2.35
53	600664	哈药股份	96,472,233.43	2.32
54	000528	柳 工	96,059,652.71	2.31
55	000728	国元证券	95,153,401.20	2.29
56	000063	中兴通讯	91,442,567.87	2.20
57	002008	大族激光	90,760,857.78	2.18
58	600418	江淮汽车	88,767,853.06	2.14
59	600741	华域汽车	88,053,980.70	2.12
60	600729	重庆百货	87,740,051.67	2.11
61	600195	中牧股份	87,312,664.67	2.10
62	000712	锦龙股份	86,040,175.57	2.07
63	601390	中国中铁	85,988,552.93	2.07
64	600000	浦发银行	85,072,814.89	2.05
65	000001	深发展A	83,558,377.81	2.01

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%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	600036	招商银行	439,660,138.33	10.58
2	600048	保利地产	365,890,565.84	8.81
3	600519	贵州茅台	352,105,336.08	8.47
4	601006	大秦铁路	303,814,907.92	7.31
5	601601	中国太保	293,035,735.21	7.05
6	601111	中国国航	279,366,510.68	6.72
7	600050	中国联通	274,763,557.22	6.61
8	000069	华侨城A	242,017,165.88	5.82
9	000858	五 粮 液	230,048,148.67	5.54
10	601318	中国平安	221,138,692.32	5.32
11	601166	兴业银行	218,975,286.39	5.27
12	601398	工商银行	200,994,416.18	4.84
13	600276	恒瑞医药	200,546,745.06	4.83
14	600362	江西铜业	189,944,963.61	4.57
15	000651	格力电器	189,034,098.38	4.55
16	600261	浙江阳光	172,583,359.28	4.15
17	000602	金马集团	167,244,696.94	4.03
18	600067	冠城大通	163,944,870.23	3.95
19	600631	百联股份	158,324,918.58	3.81
20	600015	华夏银行	156,233,517.62	3.76
21	601628	中国人寿	142,906,851.86	3.44
22	000009	中国宝安	142,824,121.72	3.44
23	600887	伊利股份	142,684,343.63	3.43
24	000002	万 科A	135,002,624.29	3.25
25	600859	王府井	133,984,105.94	3.22
26	600816	安信信托	133,230,896.73	3.21
27	600111	包钢稀土	132,259,850.12	3.18
28	000963	华东医药	129,082,663.73	3.11
29	600376	首开股份	128,652,442.36	3.10
30	000528	柳 工	127,000,487.77	3.06
31	600673	东阳光铝	126,452,077.60	3.04
32	600804	鹏博士	125,462,271.37	3.02
33	600031	三一重工	125,437,878.79	3.02
34	600863	内蒙华电	122,301,523.42	2.94
35	600079	人福医药	121,694,241.57	2.93
36	600582	天地科技	121,338,697.80	2.92
37	600312	平高电气	120,560,030.50	2.90
38	601186	中国铁建	119,883,011.70	2.89
39	000728	国元证券	118,083,862.06	2.84
40	600489	中金黄金	117,781,521.41	2.83
41	002232	启明信息	114,677,600.63	2.76
42	600511	国药股份	111,744,413.80	2.69
43	600655	豫园商城	110,158,610.79	2.65
44	601989	中国重工	109,454,282.98	2.63
45	600525	长园集团	107,487,271.24	2.59
46	600038	哈飞股份	107,309,783.86	2.58
47	000338	潍柴动力	105,679,222.70	2.54
48	600697	欧亚集团	103,415,415.45	2.49
49	600361	华联综超	103,061,578.09	2.48
50	000400	许继电气	102,617,113.64	2.47
51	000895	双汇发展	101,845,101.57	2.45
52	600879	航天电子	101,752,136.64	2.45
53	600729	重庆百货	101,484,759.69	2.44
54	000869	张 裕A	100,848,808.04	2.43
55	002269	美邦服饰	99,687,154.88	2.40
56	000917	电广传媒	99,016,457.32	2.38
57	600423	柳化股份	97,776,159.33	2.35
58	600584	长电科技	93,133,234.03	2.24
59	000998	隆平高科	91,088,260.25	2.19
60	600553	太行水泥	90,183,331.43	2.17
61	600112	长征电气	89,010,339.63	2.14
62	600195	中牧股份	88,846,156.36	2.14
63	600664	哈药股份	87,769,824.48	2.11
64	601390	中国中铁	87,641,349.20	2.11
65	600418	江淮汽车	85,377,890.90	2.05
66	000063	中兴通讯	84,545,373.18	2.03
67	600395	盘江股份	84,373,491.72	2.03
68	600000	浦发银行	83,989,826.60	2.02
69	000001	深发展A	83,239,334.78	2.00

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	15,298,126,196.05
卖出股票收入(成交)总额	16,877,191,159.80

注:8.4.1项"买入金额"、8.4.2项"卖出金额"及8.4.3项"买入成本"、"卖出收入"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	150,379,000.00	5.18
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	71,469.72	0.00
7	其他	-	-
8	合计	150,450,469.72	5.19

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	0801035	08央行票据35	1,100,000	110,319,000.00	3.80
2	0801020	08央行票据20	400,000	40,060,000.00	1.38
3	128233	塔牌转债	474	71,469.72	0.00

注:报告期末本基金仅持有上述3只债券。

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	1,888,562.15
2	应收证券清算款	23,721,680.21
3	应收股利	-
4	应收利息	5,431,233.93
5	应收申购款	3,259,208.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,300,684.65

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	242,439,109.71	8.36	筹划国资改革事宜

§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

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
51,418	33,153.39	932,123,446.44	54.68%	772,557,646.25	45.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,915,337.77	0.17%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年5月27日)基金份额总额	1,810,823,226.74
本报告期期初基金份额总额	2,662,238,500.28
本报告期基金总申购份额	1,437,365,868.33
减:本报告期基金总赎回份额	2,394,923,275.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,704,681,092.69

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§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

2010年5月8日,本基金管理人发布《关于调整嘉实研究精选股票基金经理的公告》,刘红辉先生不再担任本基金基金经理职务;2010年6月8日《关于嘉实研究精选股票基金经理变更的公告》,党开宇女士不再担任本基金基金经理,聘请张弢先生担任本基金基金经理职务。

(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。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费100,000.00元,该审计机构已连续3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	2	4,215,997,295.15	13.11%	3,577,798.82	13.30%	-
海通证券股份有限公司	2	3,641,211,625.62	11.32%	3,027,321.25	11.25%	-
安信证券股份有限公司	3	3,128,245,271.77	9.73%	2,638,086.22	9.81%	-
中信证券股份有限公司	3	2,968,093,123.80	9.23%	2,440,724.36	9.07%	-
长城证券有限责任公司	2	1,641,512,196.03	5.11%	1,368,590.15	5.09%	-
东海证券有限责任公司	1	1,569,881,564.30	4.88%	1,334,397.34	4.96%	-
平安证券有限责任公司	2	1,392,612,337.43	4.33%	1,183,716.56	4.40%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	1,351,976,755.88	4.20%	1,113,362.54	4.14%	-
申银万国证券股份有限公司	2	1,295,740,092.08	4.03%	1,096,777.52	4.08%	-
招商证券股份有限公司	1	1,243,411,061.50	3.87%	1,010,278.83	3.76%	-
兴业证券股份有限公司	1	884,061,072.82	2.75%	751,449.23	2.79%	-
长江证券股份有限公司	1	856,697,705.88	2.66%	696,071.06	2.59%	-
浙商证券有限责任公司	1	847,795,940.30	2.64%	720,623.18	2.68%	-
国泰君安证券股份有限公司	4	768,115,781.27	2.39%	624,098.18	2.32%	-
华融证券股份有限公司	1	685,200,860.72	2.13%	582,418.48	2.17%	新增
华泰证券股份有限公司	2	669,951,526.94	2.08%	569,456.21	2.12%	-
广发证券股份有限公司	2	603,338,409.78	1.88%	497,951.80	1.85%	新增1个
齐鲁证券有限公司	1	599,428,435.12	1.86%	487,038.95	1.81%	-
英大证券有限责任公司	2	549,041,636.06	1.71%	446,100.16	1.66%	-
湘财证券有限责任公司	1	459,694,582.85	1.43%	390,738.05	1.45%	-
光大证券股份有限公司	1	457,682,088.46	1.42%	389,026.92	1.45%	-
华泰联合证券有限责任公司	2	408,514,359.37	1.27%	347,234.04	1.29%	-
中航证券有限公司	1	403,038,875.30	1.25%	342,582.65	1.27%	-
东方证券股份有限公司	1	313,944,496.59	0.98%	255,081.04	0.95%	-
中国国际金融有限公司	2	274,510,489.89	0.85%	228,762.96	0.85%	-
民生证券有限责任公司	2	269,931,126.22	0.84%	229,440.84	0.85%	新增
东北证券股份有限公司	2	166,853,544.27	0.52%	135,569.40	0.50%	-
渤海证券股份有限公司	1	150,035,066.73	0.47%	127,527.23	0.47%	-
中信建投证券有限责任公司	2	126,360,239.50	0.39%	107,405.37	0.40%	-
信达证券股份有限公司	1	109,000,901.05	0.34%	92,650.16	0.34%	新增
新时代证券有限责任公司	1	101,915,923.13	0.32%	86,627.88	0.32%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券经纪有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增

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。

注3:原"江南证券有限责任公司"更名为"中航证券有限公司"。

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		权证交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券股份有限公司	1,520,130.70	44.40%	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1,903,359.84	55.60%	-	-	-	-

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

2011年3月28日