嘉实稳健开放式证券投资基金 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。

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债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9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	14,984,821,242.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票40%-75%、债券20%-55%、现金5%左右。
业绩比较基准	巨潮200（大盘）指数
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金，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。

2.3 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

§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
本期已实现收益	641,478,668.14	1,488,795,944.26	-10,484,096,321.90
本期利润	-896,102,108.14	5,656,139,854.54	-16,777,761,783.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0564	0.2953	-0.7204
本期加权平均净值利润率	-6.44%	35.10%	-71.84%
本期基金份额净值增长率	-5.54%	42.07%	-51.26%
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	3,598,899,045.88	3,519,482,534.96	2,647,325,186.57
期末可供分配基金份额利润	0.2402	0.2097	0.1249
期末基金资产净值	13,420,300,354.08	16,101,565,315.73	14,316,227,320.78
期末基金份额净值	0.896	0.959	0.675
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	230.59%	249.97%	146.33%

注：⑴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；⑵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；⑶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	4.19%	1.16%	6.19%	1.74%	-2.00%	-0.58%
过去六个月	12.70%	0.97%	20.31%	1.52%	-7.61%	-0.55%
过去一年	-5.54%	0.94%	-13.35%	1.56%	7.81%	-0.62%
过去三年	-34.59%	1.44%	-39.31%	2.30%	4.72%	-0.86%
过去五年	195.49%	1.46%	245.57%	2.15%	-50.08%	-0.69%
自基金合同生效起至今	230.59%	1.28%	158.96%	1.90%	71.63%	-0.62%

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：按基金合同规定，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第三部分（四（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：⑴投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；⑵持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；⑶本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；⑷投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%；⑸本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容；⑹法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

注2：2010年6月8日，本基金管理人发布《关于嘉实稳健证券投资基金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，聘请徐晨光先生担任本基金基金经理。

注3：2010年7月29日，本基金管理人发布《关于增聘嘉实稳健混合基金经理的公告》，增聘林青先生任嘉实稳健证券投资基金基金经理，与原基金经理徐晨光先生共同管理嘉实稳健证券投资基金。

注4：2010年11月12日，本基金管理人发布《关于调整嘉实稳健证券投资基金基金经理的公告》，徐晨光先生不再担任本基金基金经理，本基金由现任基金经理林青先生管理。

3.2.3 过去五年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

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	0.1000	63,393,988.14	98,650,764.04	162,044,752.18	2009年度应分利润于2010年实施
2009	-	-	-	-	
2008	-	-	-	-	
合计	0.1000	63,393,988.14	98,650,764.04	162,044,752.18	

§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	2009年1月16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，诺安平衡基金经理，诺安股票基金经理。2006年9月加盟嘉实基金，曾任嘉实策略混合基金经理、嘉实服务增值行业混合基金经理。硕士，CFA，具有基金从业资格，中国国籍。
徐晨光	本基金基金经理	2010年6月8日	2010年11月12日	9年	曾任华泰证券股份有限公司北京总部行业研究员；2002年加盟嘉实基金管理有限公司，先后任研究员、社保基金经理职务。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
林青	本基金基金经理	2010年7月29日	-	17年	曾任职于申银万国证券股份有限公司国际业务部，花旗银行投资银行；曾任鹏华基金管理有限公司机构理财部总监，易方达基金管理有限公司机构理财部总经理，中国国际金融有限公司资产管理部副总经理。2008年3月加盟嘉实基金管理有限公司，曾任公司机构投资部总监，现任嘉实稳健证券投资基金基金经理职务。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

注：⑴任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日；⑵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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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年是中国宏观经济由复苏转向过热的阶段，房价以及通胀率创下了本轮经济周期的新高，货币政策由积极转向稳健，信贷趋于紧缩。A股市场处于系统景气向下而微观流动性活跃的特殊时期，大盘指数震荡向下，而小盘股活跃创造了史上少有的结构性行情：上半年，传统消费行业如医药、零售等体现出在紧缩政策下的防御优势，而下半年科技股的发力使得小盘股的表现大幅度超越大盘指数。

在2010年中，本基金主要投资标的为流通市值居前50%的个股，在2010年整体表现不佳。

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0.896元；本报告期基金份额净值增长率为-5.54%，业绩比较基准收益率为-13.35%，本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率7.81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

从整体上看，我们认为2011年上半年宏观经济可能会处于通货膨胀居高不下的阶段，而经济增速在去年下半年反弹之后会继续回落。具体来说，短期内经济增长的反弹高点可能已过，年初的CPI有较大的向上风险（恶劣天气以及输入型通胀）；流动性方面年初相对宽松，而2-3月份为M1的相对高点，可能为市场带来一些阶段性机会。海外：美国经济2011进入复苏阶段，通缩压力还存在，核心通胀向下走使得货币政策保持宽松；而欧洲经济是扰动因素；总体来看美元还将维持弱势，需求的回暖将使股市以及大宗商品保持向上趋势，海外形势有利于国内资本市场。

综上宏观经济背景从全年来看对股市的影响是错综复杂的，年初政策资金偏紧对市场不利，而春节后流动性相对宽松又会给市场带来了结构性或者是阶段性的机会，未来市场将在增长与通胀的预期变换中踯躅前行。行业结构上，我们认为通胀超预期将继续推动大宗商品的价格，资源品可能仍然会吸引投资者的目光。需要警惕的是如果通胀过高并由此引发更加严厉的紧缩政策，可能市场会面临的系统性风险。因此审时度势，把握市场节奏是今年资本市场操作的要素。

基于以上判断，上半年我们将继续采取哑铃型政策：一端坚守原来基于价值发现寻找的绝对收益品种，另一端维持对资源相关及衍生类产业，包括农业、能源、化工、有色等行业的投资。同时关注通胀趋势，防范系统性风险，力争为投资者带来稳健的投资回报。

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

⑴本报告期内实施了2009年度基金利润分配，具体参见本报告 7.4.11 利润分配情况”。

⑵根据本报告3.1.1 本期利润”为-896,102,108.14元，3.1.2 期末可供分配利润”为3,598,899,045.88元以及本基金基金合同（第三部分十一（二）收益分配原则）5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配”的约定，本基金未实施2010年度基金利润分配，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称 本托管人”）在对嘉实稳健证券投资基金（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

嘉实稳健开放式证券投资基金2010年度财务会计报告已由安永华明会计师事务所审计、注册会计师杨勃、王珊珊签字出具了 无保留意见的审计报告”（安永华明（2011）审字第60468756_A02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：嘉实稳健开放式证券投资基金

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	1,348,318,995.73	691,975,863.02
结算备付金		68,819,091.03	6,819,050.21
存出保证金		7,748,568.74	7,779,667.24
交易性金融资产	7.4.7.2	12,167,797,819.72	15,547,296,077.94
其中：股票投资		9,036,172,060.42	11,763,714,044.28
基金投资		-	-
债券投资		3,131,625,759.30	3,783,582,033.66
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	1,952,341.64	2,356,380.75
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	46,182,255.57	10,558,618.46
应收股利		-	-
应收申购款		356,373.89	220,497.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		13,641,175,446.32	16,267,006,155.27
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		161,381,366.68	111,071,250.08
应付赎回款		5,209,948.20	21,037,047.66
应付管理人报酬		17,580,322.77	20,549,697.93
应付托管费		2,930,053.78	3,424,949.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	29,996,731.05	6,238,847.49
应交税费		1,695,268.84	1,531,168.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,081,400.92	1,587,877.88
负债合计		220,875,092.24	165,440,839.54
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,405,559,134.42	8,293,625,233.38
未分配利润	7.4.7.10	6,014,741,219.66	7,807,940,082.35
所有者权益合计		13,420,300,354.08	16,101,565,315.73
负债和所有者权益总计		13,641,175,446.32	16,267,006,155.27

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值0.896元，基金份额总额14,984,821,242.93份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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		-535,392,794.26	6,032,690,117.07
1.利息收入		94,352,844.98	115,773,256.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,380,379.27	7,482,351.65
债券利息收入		82,333,268.52	108,290,904.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,639,197.19	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		906,906,456.45	1,748,076,684.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	881,895,440.90	1,660,212,991.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-54,394,512.03	23,866,220.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-20,306,000.06
股利收益	7.4.7.16	79,405,527.58	84,303,473.23
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	-1,537,580,776.28	4,167,343,910.28
4. 汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	928,680.59	1,496,265.25
减：二、费用		360,709,313.88	376,550,262.53
1.管理人报酬		208,845,614.81	240,768,050.90
2.托管费		34,807,602.50	40,128,008.55
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	116,603,913.59	94,607,410.47
5.利息支出		191,309.18	812,835.04
其中：卖出回购金融资产支出		191,309.18	812,835.04
6.其他费用	7.4.7.20	260,873.80	233,957.57
三、利润总额		-896,102,108.14	5,656,139,854.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-896,102,108.14	5,656,139,854.54

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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）	8,293,625,233.38	7,807,940,082.35	16,101,565,315.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-896,102,108.14	-896,102,108.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-888,066,098.96	-735,052,002.37	-1,623,118,101.33
其中：1.基金申购款	765,535,449.27	611,381,862.95	1,376,917,312.22
2.基金赎回款	-1,653,601,548.23	-1,346,433,865.32	-3,000,035,413.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-162,044,752.18	-162,044,752.18
五、期末所有者权益（基金净值）	7,405,559,134.42	6,014,741,219.66	13,420,300,354.08
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）	10,477,587,382.47	3,838,639,938.31	14,316,227,320.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,656,139,854.54	5,656,139,854.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,183,962,149.09	-1,686,839,710.50	-3,870,801,859.59
其中：1.基金申购款	340,350,869.12	234,520,186.31	574,871,055.43
2.基金赎回款	-2,524,313,018.21	-1,921,359,896.81	-4,445,672,915.02
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）	8,293,625,233.38	7,807,940,082.35	16,101,565,315.73

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相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金无会计政策和会计估计变更及差错更正事项。

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、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
德意志资产管理（亚洲）有限公司	基金管理人股东
国都证券有限责任公司	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金均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	208,845,614.81	240,768,050.90
其中：支付给销售机构的客户维护费	22,450,888.24	25,624,517.30

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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	34,807,602.50	40,128,008.55

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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 2010年1月1日至2010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
中国银行股份有限公司	1,351,428,087.75	21,222,652.74	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
中国银行股份有限公司	1,377,862,925.39	-	-	-	2,668,900,000.00	517,251.49

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

本期及上年度可比期间，本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

报告期末（2010年12月31日）及上年度末（2009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 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
中国银行股份有限公司	1,348,318,995.73	10,015,865.56	691,975,863.02	7,156,315.66

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

报告期内，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
600804	鹏博士	2010年1月15日	2011年1月14日	非公开发行流通受限	7.79	8.64	9,000,000	70,110,000.00	77,760,000.00	-
600963	岳阳纸业	2010年12月28日	2011年1月6日	配股未上市	7.70	10.09	6,615,036	50,935,777.20	66,745,713.24	-
300146	汤臣倍健	2010年12月8日	2011年3月15日	IPO网下锁定三个月	110.00	150.00	270,000	29,700,000.00	40,500,000.00	-
601177	杭齿前进	2010年9月29日	2011年1月11日	IPO网下锁定三个月	8.29	16.03	322,459	2,673,185.11	5,169,017.77	-
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	88,502	2,035,546.00	2,753,297.22	-
300157	恒泰艾普	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	57.00	57.00	500	28,500.00	28,500.00	-
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年1月7日	未上市	5.99	5.99	4,000	23,960.00	23,960.00	-
002537	海立美达	2010年12月31日	2011年1月10日	未上市	40.00	40.00	500	20,000.00	20,000.00	-
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	-
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
600664	哈药股份	2010年12月29日	重要事项未公告	22.57	2011年2月16日	24.83	9,323,495	230,137,308.00	210,431,282.15	-
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	6,097,509	108,952,887.96	120,181,902.39	-
600816	安信信托	2010年6月2日	重要事项未公告	13.60	未知	未知	1,037,851	21,660,545.25	14,114,773.60	-

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），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	9,036,172,060.42	66.24
	其中：股票	9,036,172,060.42	66.24
2	固定收益投资	3,131,625,759.30	22.96
	其中：债券	3,131,625,759.30	22.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,952,341.64	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	1,417,138,086.76	10.39
6	其他各项资产	54,287,198.20	0.40
7	合计	13,641,175,446.32	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	309,388,839.51	2.31
B	采掘业	619,642,937.71	4.62
C	制造业	4,787,756,509.73	35.68
C0	食品、饮料	1,090,134,985.41	8.12
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	289,231,424.04	2.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	903,109,041.96	6.73
C5	电子	170,081,139.26	1.27
C6	金属、非金属	682,126,911.79	5.08
C7	机械、设备、仪表	951,348,871.40	7.09
C8	医药、生物制品	661,794,478.14	4.93
C99	其他制造业	39,929,657.73	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	36,076,641.64	0.27
E	建筑业	625,623,928.65	4.66
F	交通运输、仓储业	472,682,459.31	3.52
G	信息技术业	800,228,869.44	5.96
H	批发和零售贸易	184,431,377.45	1.37
I	金融、保险业	760,811,885.48	5.67
J	房地产业	262,950,840.00	1.96
K	社会服务业	91,868,897.10	0.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	84,708,874.40	0.63
	合计	9,036,172,060.42	67.33

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	000895	双汇发展	4,736,365	412,063,755.00	3.07
2	000792	盐湖钾肥	4,837,115	320,410,497.60	2.39
3	600963	岳阳纸业	28,665,156	289,231,424.04	2.16
4	601318	中国平安	5,086,810	285,675,249.60	2.13
5	601006	大秦铁路	34,715,843	271,477,892.26	2.02
6	600170	上海建工	18,483,399	269,672,791.41	2.01
7	600208	新湖中宝	43,825,140	262,950,840.00	1.96
8	000629	*ST钒钛	22,315,221	257,517,650.34	1.92
9	000063	中兴通讯	9,305,507	254,040,341.10	1.89
10	000876	新希望	11,430,178	239,462,229.10	1.78

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	000063	中兴通讯	1,011,259,892.81	6.28
2	601006	大秦铁路	974,627,018.09	6.05
3	600030	中信证券	826,352,485.34	5.13
4	000858	五粮液	764,337,787.85	4.75
5	600015	华夏银行	696,860,286.90	4.33
6	600048	保利地产	645,110,720.45	4.01
7	600028	中国石化	619,573,780.49	3.85
8	600887	伊利股份	596,257,736.19	3.70
9	601318	中国平安	584,312,579.60	3.63
10	600519	贵州茅台	583,611,677.25	3.62
11	000002	万科A	518,838,209.82	3.22
12	000060	中金岭南	509,828,590.61	3.17
13	600031	三一重工	502,699,847.97	3.12
14	000792	盐湖钾肥	495,995,189.69	3.08
15	600362	江西铜业	484,569,527.30	3.01
16	601288	农业银行	458,243,128.06	2.85
17	601111	中国国航	440,282,169.77	2.73
18	601668	中国建筑	426,683,737.87	2.65
19	000069	华侨城A	414,132,921.99	2.57
20	600115	东方航空	411,510,489.89	2.56
21	600104	上海汽车	407,649,376.54	2.53
22	000039	中集集团	402,422,405.74	2.50
23	600879	航天电子	393,146,106.86	2.44
24	600036	招商银行	386,610,303.51	2.40
25	600096	云天化	384,723,812.76	2.39
26	601328	交通银行	364,831,479.98	2.27
27	600050	中国联通	362,196,214.06	2.25
28	601169	北京银行	359,732,132.16	2.23
29	601607	上海医药	334,980,715.30	2.08
30	600188	兖州煤业	331,682,077.12	2.06
31	000651	格力电器	330,891,389.32	2.06

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	600048	保利地产	1,089,779,362.94	6.77
2	600036	招商银行	1,054,436,218.48	6.55
3	600050	中国联通	861,591,075.60	5.35
4	000002	万科A	786,459,520.11	4.88
5	600015	华夏银行	761,677,889.42	4.73
6	600519	贵州茅台	758,258,960.80	4.71
7	601006	大秦铁路	757,383,360.51	4.70
8	000651	格力电器	743,082,911.14	4.61
9	600031	三一重工	706,675,590.69	4.39
10	601318	中国平安	696,159,067.78	4.32
11	000895	双汇发展	677,959,993.99	4.21
12	600028	中国石化	676,170,526.15	4.20
13	600276	恒瑞医药	673,680,445.71	4.18
14	000063	中兴通讯	632,464,186.86	3.93
15	600887	伊利股份	623,846,787.59	3.87
16	000858	五粮液	623,711,225.10	3.87
17	600030	中信证券	615,854,034.57	3.82
18	002024	苏宁电器	557,126,839.06	3.46
19	600016	民生银行	555,977,939.91	3.45
20	601111	中国国航	545,751,931.65	3.39
21	601398	工商银行	544,074,812.71	3.38
22	000792	盐湖钾肥	481,073,267.39	2.99
23	601668	中国建筑	479,101,945.43	2.98
24	600362	江西铜业	445,012,687.62	2.76
25	000039	中集集团	431,162,874.95	2.68
26	601088	中国神华	416,129,427.33	2.58
27	000402	金融街	410,709,862.62	2.55
28	600067	冠城大通	395,055,541.50	2.45
29	600104	上海汽车	387,248,021.38	2.41
30	000060	中金岭南	375,212,221.83	2.33
31	601328	交通银行	366,119,854.38	2.27
32	601169	北京银行	356,988,745.06	2.22
33	000069	华侨城A	354,725,337.94	2.20
34	600115	东方航空	341,319,442.85	2.12
35	601166	兴业银行	332,097,860.37	2.06
36	600688	S上石化	330,330,932.61	2.05
37	600188	兖州煤业	328,345,808.05	2.04

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	36,913,464,532.40
卖出股票收入（成交）总额	38,984,335,480.50

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	35,000,000.00	0.26
2	央行票据	2,261,082,000.00	16.85
3	金融债券	555,482,000.00	4.14
	其中：政策性金融债	555,482,000.00	4.14
4	企业债券	118,635,891.20	0.88
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	161,425,868.10	1.20
7	其他	-	-
	合计	3,131,625,759.30	23.33

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	1001074	10央行票据74	5,000,000	487,800,000.00	3.63
2	1001060	10央行票据60	4,900,000	478,779,000.00	3.57
3	1001021	10央行票据21	2,600,000	254,306,000.00	1.89
4	0801035	08央行票据35	2,500,000	250,725,000.00	1.87
5	100233	10国开33	2,000,000	196,860,000.00	1.47

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

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	580027	长虹CWB1	771,067	1,952,341.64	0.01

报告期末本基金仅持有长虹CWB1。

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和处罚。

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	7,748,568.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,182,255.57
5	应收申购款	356,373.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,287,198.20

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	110003	新钢转债	33,251,921.10	0.25
2	110078	澄星转债	8,020,026.00	0.06

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	600963	岳阳纸业	66,745,713.24	0.50	配股未上市

§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
756,763	19,801.21	711,510,437.11	4.75%	14,273,310,805.82	95.25%

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	147,023.57	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月9日）基金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	16,781,976,431.22
本报告期基金总申购份额	1,548,999,815.13
减：本报告期基金总赎回份额	3,346,155,003.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,984,821,242.93

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、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

⑴基金管理人的重大人事变动情况

2010年6月8日，本基金管理人发布《关于嘉实稳健证券投资基金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，聘请徐晨光先生担任本基金基金经理。

2010年7月29日，本基金管理人发布《关于增聘嘉实稳健混合基金经理的公告》，增聘林青先生任嘉实稳健证券投资基金基金经理，与原基金经理徐晨光先生共同管理嘉实稳健证券投资基金。

2010年11月12日，本基金管理人发布《关于调整嘉实稳健证券投资基金基金经理的公告》，徐晨光先生不再担任本基金基金经理，本基金由现任基金经理林青先生管理。

⑵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。报告年度应支付给安永华明会计师事务所的审计费80,000.00元，该审计机构已连续8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	
安信证券股份有限公司	3	7,472,379,730.76	9.90%	6,351,497.80	10.04%	-
渤海证券股份有限公司	1	749,187,650.56	0.99%	636,805.78	1.01%	-
长城证券有限责任公司	2	2,439,600,466.55	3.23%	1,982,190.73	3.13%	-
大通证券股份有限公司	1	803,879,099.71	1.06%	683,293.58	1.08%	-
东北证券股份有限公司	2	797,419,571.54	1.06%	657,876.46	1.04%	-
东方证券股份有限公司	1	2,688,246,285.20	3.56%	2,184,224.72	3.45%	-
北京高华证券有限责任公司	1	3,797,419,303.42	5.03%	3,227,805.85	5.10%	-
光大证券股份有限公司	1	1,113,516,844.57	1.47%	946,482.48	1.50%	-
广发证券股份有限公司	2	2,649,395,314.87	3.51%	2,185,237.02	3.46%	新增1个
国金证券股份有限公司	2	115,869,991.43	0.15%	98,489.72	0.16%	-
国泰君安证券股份有限公司	4	4,485,314,713.52	5.94%	3,793,908.91	6.00%	-
国信证券股份有限公司	1	2,132,327,903.89	2.82%	1,812,485.14	2.87%	-
海通证券股份有限公司	2	2,114,774,182.83	2.80%	1,718,266.54	2.72%	-
华宝证券经纪有限责任公司	1	697,637,833.36	0.92%	592,989.17	0.94%	-
华融证券股份有限公司	1	3,110,308,778.56	4.12%	2,643,744.63	4.18%	新增
华泰证券股份有限公司	2	476,030,022.38	0.63%	404,625.33	0.64%	-
华泰联合证券有限责任公司	2	276,100,955.54	0.37%	234,688.73	0.37%	-
民生证券有限责任公司	2	414,762,966.72	0.55%	336,998.13	0.53%	新增
平安证券有限责任公司	2	6,271,359,062.38	8.31%	5,186,436.12	8.20%	-
齐鲁证券有限公司	1	1,513,954,380.04	2.01%	1,230,101.13	1.95%	-
瑞银证券有限责任公司	1	4,146,122,873.52	5.49%	3,524,190.19	5.57%	-
申银万国证券股份有限公司	2	2,186,886,134.25	2.90%	1,776,859.29	2.81%	-
湘财证券有限责任公司	1	2,021,677,493.72	2.68%	1,718,430.81	2.72%	-
信达证券股份有限公司	1	1,880,202,908.96	2.49%	1,598,168.18	2.53%	新增
招商证券股份有限公司	1	334,152,180.67	0.44%	271,499.82	0.43%	-
中国国际金融有限公司	2	5,391,049,737.33	7.14%	4,573,352.79	7.23%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	2,905,682,191.21	3.85%	2,360,886.08	3.73%	-
中信证券股份有限公司	3	4,851,466,396.30	6.43%	3,994,237.44	6.32%	-
中银国际证券有限责任公司	2	7,665,010,064.90	10.15%	6,515,246.92	10.30%	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
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
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东海证券有限责任公司	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

⑴经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

⑵公司财务状况良好；

⑶有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

⑷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；

⑸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
安信证券股份有限公司	45,514,715.13	6.04%	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	9,485,000.00	1.26%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	45,268,141.99	6.01%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	52,427.07	0.01%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	21,263,593.61	2.82%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	9,956,381.03	1.32%	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	23,120,154.10	3.07%	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	62,114,038.38	8.24%	38,000,000.00	100.00%	-	-
平安证券有限责任公司	61,640,217.66	8.18%	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	8,315,929.58	1.10%	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	23,515,594.55	3.12%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	73,762,098.33	9.79%	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	97,223,942.84	12.90%	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	70,052,950.78	9.30%	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	10,003,669.49	1.33%	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	19,943,150.12	2.65%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	85,306,152.27	11.32%	-	-	-	-
中银国际证券有限公司	87,081,979.22	11.56%	-	-	-	-

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