



嘉实稳固收益债券型证券投资基金 2010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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年3月28日

8.1 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责任。本年度报告已经基金合同规定程序审议通过,并由董事长签字。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2011年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值信息、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。
 本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自基金合同生效日2010年9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。

2.1 基金基本情况	
基金名称	嘉实稳固收益债券
基金代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金存续日期	2010年9月1日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,531,797,386.99份
报告期末基金份额持有人数量	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在追求基金资产安全的前提下,预期年化收益率在6%左右,力争实现长期稳定的超额回报。
投资策略	本基金采用自上而下资产配置策略,在宏观、中观、微观三个层面进行资产配置,在控制风险的前提下,通过精选具有良好成长性的股票和债券,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率+1.00%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益均低于股票基金,高于货币型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	魏星	赵斌
信息披露负责人	张金松	张金松
联系电话	010-85215888	010-66107799
电子邮箱	service@jia.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-600-8880	95588
网址	http://www.jsfund.cn	http://www.icbc.com.cn

8.2 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况		
1.1 期间业绩指标	2010年9月1日至报告期期末/2010年12月31日	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-40,374,749.87	
本期基金份额净值增长率	-47.817,176.11%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-4.0181%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-1.17%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-1.20%	

1.2 基金份额持有人结构	
报告期末基金份额持有人户数	2010年末
基金份额持有人户数	44,096,734.21
基金份额持有人户数	40,012.23
基金份额持有人户数	3,487,700,652.93
基金份额持有人户数	0.98%
基金份额持有人户数	-1.20%

1.3 基金业绩比较基准	
报告期末基金份额持有人户数	2010年末
基金份额持有人户数	44,096,734.21
基金份额持有人户数	40,012.23
基金份额持有人户数	3,487,700,652.93
基金份额持有人户数	0.98%
基金份额持有人户数	-1.20%

注:Q 期末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。
 Q 期末基金份额净值增长率指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低于所列数字;

Q 期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低者。
 本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自2010年9月1日起至2010年12月31日止。

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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
最近三个月	-4.30%	0.13%	-4.43%
最近六个月	-1.39%	0.12%	-1.51%
自基金合同生效以来	-4.20%	0.12%	-4.32%

注:本基金业绩比较基准为三年期定期存款利率+1.06%
 Benchmark = (1+ Return)^3 Benchmark (1+1)

3.2.2 本基金合同生效以来基金基金份额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

项目	期间	基金	业绩比较基准
一、收入	2010年9月1日至2010年12月31日	-47,817,176.11	-47,817,176.11
利息收入		312,628.04	
公允价值变动损益		1,487,658.67	
其他业务收入		25,000,930.59	
二、费用		-29,740,924.44	
基金管理费		-18,400,738.33	
基金托管费		-44,096,734.21	
其他费用		-7,235,451.80	
三、利润总额		-17,886,445.95	
所得税		-	
净利润		-17,886,445.95	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自基金合同生效日2010年9月1日起至2010年12月31日止,报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.988,基金份额总额3,531,797,386.99份。

7.1 资产负债表		
项目	期末	2010年12月31日
资产		
货币资金	323,628,043.23	
交易性金融资产	2,939,967.88	
应收利息	250,000.00	
其他资产	-	
负债		
应付利息	3,436,509,120.89	
其他负债	100,341,217.99	
所有者权益	3,236,167,903.10	
所有者权益合计	3,236,167,903.10	

7.2 利润表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
当期损益	2,466,567.33	
公允价值变动损益	2,225,579.09	
其他收入	-	
其他费用	-	
利润总额	4,692,146.42	
所得税	-	
净利润	4,692,146.42	

7.3 所有者权益(基金净值)变动表			
项目	期初	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、期初余额	3,531,797,386.99		
本期增加	4,692,146.42		
本期减少	-44,096,734.21		
期末余额	3,531,797,386.99		

7.4 现金流量表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、经营活动产生的现金流量	4,692,146.42	
二、投资活动产生的现金流量	-47,817,176.11	
三、筹资活动产生的现金流量	-	
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	
五、现金及现金等价物净增加额	-43,125,029.69	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,2010年度的相关数据根据当年实际存续期间2010年9月1日至2010年12月31日计算。
 3.2.3 本基金合同生效以来基金基金份额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

8.3 主要财务指标		
1.1 期间业绩指标	2010年9月1日至报告期期末/2010年12月31日	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-40,374,749.87	
本期基金份额净值增长率	-47.817,176.11%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-4.0181%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-1.17%	
基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-1.20%	

注:Q 期末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。
 Q 期末基金份额净值增长率指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低于所列数字;

Q 期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低者。
 本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自2010年9月1日起至2010年12月31日止。

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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
最近三个月	-4.30%	0.13%	-4.43%
最近六个月	-1.39%	0.12%	-1.51%
自基金合同生效以来	-4.20%	0.12%	-4.32%

注:本基金业绩比较基准为三年期定期存款利率+1.06%
 Benchmark = (1+ Return)^3 Benchmark (1+1)

3.2.2 本基金合同生效以来基金基金份额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

项目	期间	基金	业绩比较基准
一、收入	2010年9月1日至2010年12月31日	-47,817,176.11	-47,817,176.11
利息收入		312,628.04	
公允价值变动损益		1,487,658.67	
其他业务收入		25,000,930.59	
二、费用		-29,740,924.44	
基金管理费		-18,400,738.33	
基金托管费		-44,096,734.21	
其他费用		-7,235,451.80	
三、利润总额		-17,886,445.95	
所得税		-	
净利润		-17,886,445.95	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自基金合同生效日2010年9月1日起至2010年12月31日止,报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.988,基金份额总额3,531,797,386.99份。

7.1 资产负债表		
项目	期末	2010年12月31日
资产		
货币资金	323,628,043.23	
交易性金融资产	2,939,967.88	
应收利息	250,000.00	
其他资产	-	
负债		
应付利息	3,436,509,120.89	
其他负债	100,341,217.99	
所有者权益	3,236,167,903.10	
所有者权益合计	3,236,167,903.10	

7.2 利润表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
当期损益	2,466,567.33	
公允价值变动损益	2,225,579.09	
其他收入	-	
其他费用	-	
利润总额	4,692,146.42	
所得税	-	
净利润	4,692,146.42	

7.3 所有者权益(基金净值)变动表			
项目	期初	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、期初余额	3,531,797,386.99		
本期增加	4,692,146.42		
本期减少	-44,096,734.21		
期末余额	3,531,797,386.99		

7.4 现金流量表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、经营活动产生的现金流量	4,692,146.42	
二、投资活动产生的现金流量	-47,817,176.11	
三、筹资活动产生的现金流量	-	
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	
五、现金及现金等价物净增加额	-43,125,029.69	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,2010年度的相关数据根据当年实际存续期间2010年9月1日至2010年12月31日计算。
 3.2.3 本基金合同生效以来基金基金份额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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
最近三个月	-4.30%	0.13%	-4.43%
最近六个月	-1.39%	0.12%	-1.51%
自基金合同生效以来	-4.20%	0.12%	-4.32%

注:本基金业绩比较基准为三年期定期存款利率+1.06%
 Benchmark = (1+ Return)^3 Benchmark (1+1)

3.2.2 本基金合同生效以来基金基金份额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

项目	期间	基金	业绩比较基准
一、收入	2010年9月1日至2010年12月31日	-47,817,176.11	-47,817,176.11
利息收入		312,628.04	
公允价值变动损益		1,487,658.67	
其他业务收入		25,000,930.59	
二、费用		-29,740,924.44	
基金管理费		-18,400,738.33	
基金托管费		-44,096,734.21	
其他费用		-7,235,451.80	
三、利润总额		-17,886,445.95	
所得税		-	
净利润		-17,886,445.95	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自基金合同生效日2010年9月1日起至2010年12月31日止,报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.988,基金份额总额3,531,797,386.99份。

7.1 资产负债表		
项目	期末	2010年12月31日
资产		
货币资金	323,628,043.23	
交易性金融资产	2,939,967.88	
应收利息	250,000.00	
其他资产	-	
负债		
应付利息	3,436,509,120.89	
其他负债	100,341,217.99	
所有者权益	3,236,167,903.10	
所有者权益合计	3,236,167,903.10	

7.2 利润表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
当期损益	2,466,567.33	
公允价值变动损益	2,225,579.09	
其他收入	-	
其他费用	-	
利润总额	4,692,146.42	
所得税	-	
净利润	4,692,146.42	

7.3 所有者权益(基金净值)变动表			
项目	期初	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、期初余额	3,531,797,386.99		
本期增加	4,692,146.42		
本期减少	-44,096,734.21		
期末余额	3,531,797,386.99		

7.4 现金流量表		
项目	本期	2010年9月1日至2010年12月31日
一、经营活动产生的现金流量	4,692,146.42	
二、投资活动产生的现金流量	-47,817,176.11	
三、筹资活动产生的现金流量	-	
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	
五、现金及现金等价物净增加额	-43,125,029.69	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,2010年度的相关数据根据当年实际存续期间2010年9月1日至2010年12月31日计算。
 3.2.3 本基金合同生效以来基金基金份额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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
最近三个月	-4.30%	0.13%	-4.43%
最近六个月	-1.39%	0.12%	-1.51%
自基金合同生效以来	-4.20%	0.12%	-4.32%

注:本基金业绩比较基准为三年期定期存款利率+1.06%
 Benchmark = (1+ Return)^3 Benchmark (1+1)

3.2.2 本基金合同生效以来基金基金份额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

项目	期间	基金	业绩比较基准
一、收入	2010年9月1日至2010年12月31日	-47,817,176.11	-47,817,176.11
利息收入		312,628.04	
公允价值变动损益		1,487,658.67	
其他业务收入		25,000,930.59	
二、费用		-29,740,924.44	
基金管理费		-18,400,738.33	
基金托管费		-44,096,734.21	
其他费用		-7,235,451.80	
三、利润总额		-17,886,445.95	
所得税		-	
净利润		-17,886,445.95	

注:本基金合同生效日为2010年9月1日,本报告自基金合同生效日2010年9月1日起至2010年12月31日止,报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.988,基金份额总额3,531,797,386.99份。