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
送出日期:2011年8月24日

嘉实稳健开放式证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

§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。本半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8月19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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
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	14,081,025,118.69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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http:/www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	102,044,499.02
本期利润	-583,946,365.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0402
本期加权平均净值利润率	-4.58%
本期基金份额净值增长率	-4.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	3,475,322,233.41
期末可供分配基金份额利润	0.2468
期末基金资产净值	12,021,224,179.31
期末基金份额净值	0.854
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	215.09%

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
过去一个月	1.79%	0.76%	1.89%	1.17%	-0.10%	-0.41%
过去三个月	-4.26%	0.74%	-3.87%	1.08%	-0.39%	-0.34%
过去六个月	-4.69%	0.89%	-0.50%	1.20%	-4.19%	-0.31%
过去一年	7.42%	0.93%	19.71%	1.37%	-12.29%	-0.44%
过去三年	-10.62%	1.20%	12.21%	2.00%	-22.83%	-0.80%
自基金合同生效起至今	215.09%	1.26%	157.66%	1.86%	57.43%	-0.60%

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

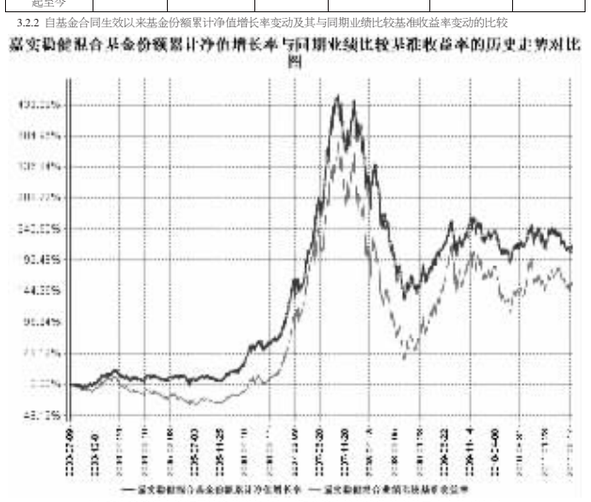

图:嘉实稳健混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年7月9日至2011年6月30日)

注: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、(六)各基投资组合比例限制》的规定:①)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;②)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;③)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%;④)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;⑤)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;⑥)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。

§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。

截止2011年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式基金、23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、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
林青	本基金基金经理	2010年7月29日	-	17	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:①)任职日期、离任日期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

上半年的宏观运行主题是高通胀及经济软着陆。一方面国内CPI再创全年新高,另一面在紧缩政策的持续影响下经济增速缓慢下行,工业增加值降到13%左右。如本基金上季度报告中所预期,上半年通货膨胀居高不下,而经济增速在去年下半年反弹之后上半年正经历缓慢回落的过程。通胀超预期使得资源品板块如煤炭表现优于大盘;食品、零售等消费股体现出在下行经济中的抗跌性;除此之外,绩优价值股在上半年相对表现优秀。而表现不佳的板块包括强周期的重卡、汽车、海运等景气下行行业。

报告期内,本基金在资产配置策略上进行了灵活调整,一定程度上避免了二季度的系统性风险;从风格类资产来看,期初对价值股加大投资力度也取得了较好的成绩。同时,本基金采取了分散化投资策略,避免了个别上市公司非系统性风险给基金收益带来的负面冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为0.854元;本报告期基金份额净值增长率为-4.69%,同期业绩比较基准收益率为-0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为今年下半年,通胀压力将逐渐缓和,但是在三季度物价仍将有反复;从统计的角度看CPI可能出现拐点,但是部分资源品价格仍将居高不下,原材料和人工等生产要素价格高企将蚕食企业盈利;经济增速在放缓但是三季度可能环比持平,政府紧缩政策将持续,预期货币政策由紧转稳;流动性方面渡过了上半年的紧张阶段之后会相对略有放松,使得资本市场在未来几个月会有一个相对宽松的资金环境。经济指标较为纠结,同前几个周期相比,整体经济形势的趋势性还是不强。

对CPI拐点的预期以及相对宽松的资本市场资金环境会在下半年形成一个阶段性的做多窗口。行业结构上,上半年调整较为充分、下半年景气有所复苏的强周期股具备反弹的动力,这些行业包括有色、非银行金融、部分电子及信息产业等。另一方面,从更长的操作周期来看,能够穿越经济下行周期的稳定成长类公司将是获得绝对收益的主要源泉。因此在下半年,本基金将重点把握两类机会:一是阶段牛市中高beta行业的波段操作机会,二是稳定成长类公司的低成本建仓机会。我们争取抓住低迷行情中的绝对收益品种,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、交易、基金运营、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,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《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金基金合同》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",以及本报告3.1"本期利润"为-583,946,365.95元,因此报告期内本基金未实施当期利润分配。

§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")在对嘉实稳健开放式证券投资基金(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 托管人对半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,123,824,487.82	1,348,318,995.73
结算备付金		10,238,078.57	68,819,091.03
存出保证金		10,327,898.97	7,748,568.74
交易性金融资产	6.4.7.2	11,155,407,225.99	12,167,797,819.72
其中:股票投资		8,002,548,272.89	9,036,172,060.42
基金投资		-	-
债券投资		3,152,858,953.10	3,131,625,759.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	1,873,692.81	1,952,341.64
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	32,967,551.23	46,182,255.57
应收股利		21,239,633.65	-
应收申购款		36,918,979.67	356,373.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,392,797,548.71	13,641,175,446.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		330,923,529.02	161,381,366.68
应付赎回款		6,249,554.77	5,209,948.20
应付管理人报酬		14,548,323.50	17,580,322.77
应付托管费		2,424,720.59	2,930,053.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,376,964.39	29,996,731.05
应交税费		1,696,212.84	1,695,268.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,354,064.29	2,081,400.92
负债合计		371,573,369.40	220,875,092.24
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	6,958,858,980.43	7,405,559,134.42
未分配利润	6.4.7.10	5,062,365,198.88	6,014,741,219.66
所有者权益合计		12,021,224,179.31	13,420,300,354.08
负债和所有者权益总计		12,392,797,548.71	13,641,175,446.32

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.854元,基金份额总额14,081,025,118.69份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-422,457,962.33	-2,335,974,967.35
1.利息收入		56,275,119.68	40,987,377.19
其中:存款利息收入	6.4.7.11	2,703,522.87	4,355,578.93
债券利息收入		52,258,393.53	35,352,302.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,313,203.28	1,279,496.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益		206,925,478.72	83,754,667.66
其中:股票投资收益	6.4.7.12	179,744,446.23	53,347,654.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-33,490,766.12	-7,282,915.34
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	60,671,798.61	37,689,928.83
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-685,990,864.97	-2,460,911,236.37
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	332,304.24	194,224.17
减:二、费用		161,488,403.62	166,667,502.24
1.管理人报酬		95,076,400.78	106,591,600.50
2.托管费		15,846,066.79	17,765,266.76
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	50,387,670.76	42,145,261.71
5.利息支出		28,696.83	51,624.44
其中:卖出回购金融资产支出		28,696.83	51,624.44
6.其他费用	6.4.7.19	149,568.46	113,748.83
三、利润总额		-583,946,365.95	-2,502,642,469.59
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-583,946,365.95	-2,502,642,469.59

6.3 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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)	7,405,559,134.42	6,014,741,219.66	13,420,300,354.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-583,946,365.95	-583,946,365.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-446,700,153.99	-368,429,654.83	-815,129,808.82
其中:1.基金申购款	173,898,611.37	134,511,307.66	308,409,919.03
2.基金赎回款	-620,598,765.36	-502,940,962.49	-1,123,539,727.85
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)	6,958,858,980.43	5,062,365,198.88	12,021,224,179.31

项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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)	-	-2,502,642,469.59	-2,502,642,469.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-477,995,568.03	-393,825,953.51	-871,821,521.54
其中:1.基金申购款	136,185,993.06	108,999,502.42	245,185,495.48
2.基金赎回款	-614,181,561.09	-502,825,455.93	-1,117,007,017.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-162,044,752.18	-162,044,752.18
五、期末所有者权益(基金净值)	7,815,629,665.35	4,749,426,907.07	12,565,056,572.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 差错更正的说明

报告期内,本基金不存在重大会计差错事项。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	95,076,400.78	106,591,600.50
其中:支付销售机构的客户维护费	10,003,901.71	11,614,463.96

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1.5%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×1.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,846,066.79	17,765,266.76

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。

6.4.4.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	266,525,781.84	358,410,746.31	-	-	200,240,000.00	10,065.25
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	906,878,755.89	21,222,652.74	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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(2011年6月30日)及上年度末(2010年12月31日),其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	1,123,824,487.82	2,446,236.14	1,914,206,984.81	4,232,468.09

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2011年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 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
600170	上海建工	2011年6月29日	筹划重大资产重组停牌	15.59	2011年7月4日	16.25	10,776,722	160,726,865.48	168,009,095.98	-
000876	新希望	2011年6月29日	筹划重大资产重组停牌	19.95	2011年7月5日	21.95	7,636,266	161,542,864.79	152,343,506.70	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 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	8,002,548,272.89	64.57
	其中:股票	8,002,548,272.89	64.57
2	固定收益投资	3,152,858,953.10	25.44
	其中:债券	3,152,858,953.10	25.44
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,873,692.81	0.02
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	1,134,062,566.39	9.15
6	其他各项资产	101,454,063.52	0.82
7	合计	12,392,797,548.71	100.00

7.2 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	23,613,419.83	0.20
B	采掘业	537,507,847.38	4.47
C	制造业	3,290,381,240.36	27.37
C0	食品、饮料	633,658,192.76	5.27
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	60,063,713.84	0.50
C4	石油、化学、塑胶、塑料	219,808,978.12	1.83
C5	电子	104,736,912.48	0.87
C6	金属、非金属	821,781,313.17	6.84
C7	机械、设备、仪表	887,323,562.32	7.38
C8	医药、生物制品	563,008,567.67	4.68
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	222,007,661.14	1.85
E	建筑业	575,122,865.15	4.78
F	交通运输、仓储业	342,475,313.30	2.85
G	信息技术业	1,174,470,204.83	9.77
H	批发和零售贸易	445,104,640.61	3.70
I	金融、保险业	873,001,794.47	7.26
J	房地产业	496,433,417.06	4.13
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	22,429,868.76	0.19
M	综合类	-	-
	合计	8,002,548,272.89	66.57

7.3 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	000063	中兴通讯	13,663,713	386,409,803.64	3.21
2	600009	上海机场	19,322,032	247,322,009.60	2.06
3	600383	金地集团	35,169,471	225,436,309.11	1.88
4	002304	洋河股份	1,654,130	208,685,040.80	1.74
5	601668	中国建筑	48,529,577	195,574,195.31	1.63
6	000527	美的电器	10,533,651	193,713,841.89	1.61
7	000629	攀钢钒钛	17,320,680	191,739,927.60	1.60
8	600050	中国联通	35,851,231	188,218,962.75	1.57
9	600271	航天信息	7,115,250	183,858,060.00	1.53
10	000960	锡业股份	6,144,496	178,804,833.60	1.49

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)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前20名的股票投资明细

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	601318	中国平安	742,107,357.47	5.53
2	600030	中信证券	411,524,046.26	3.07
3	600188	兖州煤业	402,121,971.99	3.00
4	601601	中国太保	379,203,199.51	2.83
5	000629	攀钢钒钛	349,566,283.43	2.60
6	600000	浦发银行	342,129,087.03	2.55
7	600009	上海机场	326,753,652.70	2.43
8	600970	中材国际	295,193,795.28	2.20
9	601168	西部矿业	294,176,479.36	2.19
10	601668	中国建筑	284,525,734.43	2.12
11	000568	泸州老窖	277,632,890.83	2.07
12	600795	国电电力	273,294,030.57	2.04
13	601398	工商银行	270,856,969.36	2.02
14	601006	大秦铁路	262,980,882.56	1.96
15	600050	中国联通	233,854,514.24	1.74
16	600383	金地集团	232,864,731.16	1.74
17	000937	冀中能源	220,135,493.77	1.64
18	600271	航天信息	220,036,096.49	1.64
19	601939	建设银行	216,586,136.79	1.61
20	000527	美的电器	210,741,298.10	1.57

7.4.2 累计卖出金额前20名的股票投资明细

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	601318	中国平安	847,163,713.74	6.31
2	601006	大秦铁路	457,356,416.80	3.41
3	000629	攀钢钒钛	420,437,637.22	3.13
4	600030	中信证券	414,148,623.65	3.09
5	601288	农业银行	381,449,091.11	2.84
6	600208	新湖中宝	364,906,646.20	2.72
7	601398	工商银行	335,329,945.62	2.50
8	601601	中国太保	326,748,375.43	2.43
9	600497	驰宏锌锗	309,654,523.06	2.31
10	600963	岳阳林纸	290,804,135.30	2.17
11	600188	兖州煤业	285,016,388.58	2.12
12	601299	中国北车	280,858,686.38	2.09
13	601186	中国铁建	278,528,027.11	2.08
14	000568	泸州老窖	271,518,527.00	2.02
15	000792	盐湖股份	268,444,566.97	2.00
16	600068	葛洲坝	265,341,097.32	1.98
17	601168	西部矿业	240,359,387.46	1.79
18	601607	上海医药	239,839,788.67	1.79
19	002155	辰州矿业	223,147,312.83	1.66
20	600664	哈药股份	214,629,391.78	1.60

7.4.3 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	16,099,687,567.36
卖出股票收入(成交)总额	16,630,877,163.09

注:7.4.1项"买入金额"、7.4.2项"卖出金额"及7.4.3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。

7.5 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	589,081,000.00	4.90
3	金融债券	2,037,850