（上接B57版）

住所,办公地址	山东省济南市市中区经七路86号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	（0531）68889155	传真	（0531）68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538
（122）世纪证券有限责任公司			
住所,办公地址	深圳深南大道7088号招商银行大厦40-42层		
法定代表人	姜昧军	联系人	方文
电话	（0755）83199599	传真	（0755）83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	（0755）83199511
（123）第一创业证券股份有限公司			
住所,办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层		
法定代表人	刘学民	联系人	福国良
电话	（0755）25832852	传真	（0755）82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888
（124）金元证券股份有限公司			
住所,办公地址	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
办公地址	深圳市深南大道4001号时代金融中心17层		
法定代表人	陆涛	联系人	马骁清
电话	（0755）83025022	传真	（0755）83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228
（125）中航证券有限公司			
住所,办公地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	（0791）86768681	传真	（0791）86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567
（126）德邦证券有限责任公司			
住所	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼		
法定代表人	姚文平	联系人	罗芳
电话	（021）68761616	传真	（021）68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128
（127）西部证券股份有限公司			
住所,办公地址	陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
电话	（029）87416787	传真	（029）87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582
（128）宏信证券有限责任公司			
住所	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7至10层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	（0591）87383623	传真	（0591）87383610
网址	www.hfzq.com.cn	客服电话	（0591）96326
（129）华龙证券有限责任公司			
住所,办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	（0931）4890208	传真	（0931）4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	（0931）96668、4006898888
（130）中国国际金融有限公司			
住所	北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层		
办公地址	北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层		
法定代表人	李剑阳	联系人	廉颖峰
电话	（010）65051166	传真	（010）85679535
网址	www.cicc.com.cn	客服电话	（010）85679238；（010）85679169
（131）财通证券有限责任公司			
住所,办公地址	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	（0571）87925129	传真	0571-87818329
网址	www.ctsec.com	客服电话	（0571）96336、962336（上海地区）
（132）上海华信证券有限责任公司			
注册地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818?	传真	021-68775878
网址	www.shhxzq.com	客服电话	68777877
（133）华鑫证券有限责任公司			
住所,办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元		
法定代表人	洪家新	联系人	孔泉
电话	（0755）82083788	传真	（0755）82083408
网址	www.jyzq.cn	客服电话	（021）32109999、（029）68918888
（134）瑞银证券有限责任公司			
住所,办公地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层		
法定代表人	程宜荪	联系人	牟坤
电话	（010）58328112	传真	（010）58328748
网址	www.ubsecurities.com	客服电话	400-887-8827
（135）中国中投证券有限责任公司			
住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元		
办公地址	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层		
法定代表人	高涛	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008
（136）中山证券有限责任公司			
住所,办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	（0755）82570586	传真	（0755）82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011
（137）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	孔伯杰	联系人	冯杰
电话	（010）83991743	传真	（010）66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839
（138）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		
注册地址	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	刘爽
电话	0451-85863719	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288
（139）国金证券股份有限公司			
住所,办公地址	成都市东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	（028）86690126	传真	（028）86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109
（140）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
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618
（141）华宝证券有限责任公司			
住所,办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	（021）68777222	传真	（021）68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898
（142）长城国瑞证券有限公司			
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	王勇	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
（143）爱建证券有限责任公司			
住所,办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼		
法定代表人	宫龙云	联系人	陈斌
电话	（021）32229888	传真	021-68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	（021）63340678
（144）英大证券有限责任公司			
住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	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	吴骏	联系人	吴尔晖
电话	0755-83007159	传真	0755-83007034
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4000-188-688
（145）华融证券股份有限公司			
住所	北京市西城区金融大街35号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层、5层		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
电话	010-58568235	传真	010-58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	（010）58568118
（146）天风证券股份有限公司			
办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼		
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼		
法定代表人	余磊	联系人	张成
电话	027-87610052	传真	027-87618863
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008005000
（147）宏信证券有限责任公司			
办公地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦10楼		
注册地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦11楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	www.hxzq.cn	客服电话	4008366366

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（暨嘉实增长混合、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（暨嘉实增长混合、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（特殊普通合伙）		
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	李慧民
电话	（010）65246688	传真	（010）85188298
经办注册会计师	李慧民、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）投资策略

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信誉度，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，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、基金经理小组将按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：60%*巨潮500（小盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率

嘉实稳健混合：60%*巨潮200（大盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率

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2016年1月18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2015年12月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1.嘉实增长混合

(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	1,996,715,608.46	63.36
	其中：股票	1,996,715,608.46	63.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	668,302,906.80	21.21
	其中：债券	668,302,906.80	21.21
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	463,705,753.72	14.71
8	其他资产	22,570,468.22	0.72
	合计	3,151,294,737.20	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	150,316,766.25	4.98
B	采矿业	58,182,936.00	1.93
C	制造业	806,813,051.38	26.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	184,233,053.10	6.11
F	批发和零售业	419,393,525.52	13.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	239,595,915.20	7.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	57,099,680.24	1.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	81,080,680.77	2.69
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,996,715,608.46	66.20

(3) 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000963	华东医药	3,308,767	271,186,543.32	8.99
2	600477	杭萧钢构	14,978,297	184,233,053.10	6.11
3	000998	隆平高科	6,329,127	150,316,766.25	4.98
4	002439	启明星辰	4,665,570	149,298,240.00	4.95
5	300362	天保重装	1,919,832	116,572,199.04	3.86
6	002020	京新药业	3,354,357	112,538,677.35	3.73
7	603001	奥康国际	3,143,163	105,673,140.06	3.50
8	002049	同方国芯	1,427,950	90,274,999.00	2.99
9	002563	森马服饰	7,248,739	89,884,363.60	2.98
10	002253	川大智胜	1,680,544	89,572,995.20	2.97

(4) 报告期末按债券品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	5,179,701.10	0.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	663,123,205.70	21.98
	其中：政策性金融债	663,123,205.70	21.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	668,302,906.80	22.16

(5) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150311	15进出11	1,400,000	140,140,000.00	4.65
2	150202	15国开02	1,300,000	130,156,000.00	4.31
3	150211	15国开11	900,000	90,261,000.00	2.99
4	150411	15农发11	900,000	90,261,000.00	2.99
5	150301	15进出01	500,000	50,045,000.00	1.66
5	150201	15国开01	400,000	40,992,000.00	1.36

(6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

(8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

(11) 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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,080,182.30
2	应收证券清算款	2,126,284.19
3	应收股利	-
4	应收利息	17,892,842.32
5	应收申购款	1,471,159.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,570,468.22

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	股票名称	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	002020	京新药业	112,538,677.35	3.73	重大事项停牌
2	002049	同方国芯	90,274,999.00	2.99	重大事项停牌

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	2,893,838,001.70	66.24
	其中：股票	2,893,838,001.70	66.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	970,501,000.00	22.22
	其中：债券	970,501,000.00	22.22
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	449,174,375.75	10.28
8	其他资产	55,143,239.35	1.26
	合计	4,368,656,616.80	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	63,070,566.09	1.45
B	采矿业	947.46	0.00
C	制造业	1,502,636,694.07	34.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,393,774.80	0.03
E	建筑业	229,382,847.38	5.27
F	批发和零售业	394,503,033.12	9.06
G	交通运输、仓储和邮政业	23,619,862.20	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,982,622.20	1.45
J	金融业	109,277,755.75	2.51
K	房地产业	71,743,212.48	1.65
L	租赁和商务服务业	206,092,231.81	4.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	102,940,961.34	2.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	126,193,493.00	2.90
S	综合	-	-
	合计	2,893,838,001.70	66.48

(3) 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000028	国药一致	3,240,741	225,814,832.88	5.19
2	600477	杭萧钢构	14,530,424	178,724,215.20	4.11
3	000963	华东医药	2,058,142	168,685,318.32	3.88
4	002400	省广股份	6,510,226	163,732,183.90	3.76
5	002020	京新药业	3,584,997	120,276,649.35	2.76
6	000826	启迪桑德	2,598,207	102,940,961.34	2.36
7	600835	上海机电	3,264,255	98,939,569.05	2.27
8	601992	金隅股份	10,533,907	98,702,708.59	2.27
9	000876	新 希 望	5,061,833	89,138,879.13	2.05
10	002049	同方国芯	1,323,073	83,644,675.06	1.92

(4) 报告期末按债券品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	257,725,000.00	5.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	712,683,000.00	16.37
	其中：政策性金融债	712,683,000.00	16.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	93,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	970,501,000.00	22.30

(5) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	120009	12附息国债09	2,500,000	257,725,000.00	5.92
2	150403	15农发03	2,500,000	250,500,000.00	5.76
3	110208	11国开08	1,000,000	107,830,000.00	2.48
4	110235	11国开35	500,000	52,035,000.00	1.20
5	110216	11国开16	500,000	51,765,000.00	1.19

(6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

(8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

(11) 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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,810,488.62
2	应收证券清算款	32,936,857.11
3	应收股利	-
4	应收利息	20,247,293.94
5	应收申购款	128,599.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,143,239.35

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