

# 嘉实债券开放式证券投资基金 2009 年年度报告

2009 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

送出日期：2010 年 3 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 2010 年 3 月 26 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 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	4
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 审计报告.....	11
§7 年度财务报表.....	11
7.1 资产负债表.....	11
7.2 利润表.....	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
7.4 报表附注.....	14
§8 投资组合报告.....	36

8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	40
8.9 投资组合报告附注.....	40
§9 基金份额持有人信息.....	41
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
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.....	41
§10 开放式基金份额变动.....	41
§11 重大事件揭示.....	41
11.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
11.4 基金投资策略的改变.....	41
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	42
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
11.8 其他重大事件.....	43
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实债券开放式证券投资基金
基金简称	嘉实债券
交易主代码	070005
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	1,128,730,824.66 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以本金安全为前提，追求较高的组合回报。
投资策略	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。
业绩比较基准	中央国债登记结算公司的中国债券指数
风险收益特征	本基金属于低风险证券投资基金，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。

### 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
注册地址		上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 1702 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005 (办公地址)	100818
法定代表人		王忠民	肖钢

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	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
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	173,358,979.10	-35,700,150.13	391,848,600.25
本期利润	63,010,075.01	-129,625,507.85	601,176,681.69
加权平均基金份额本期利润	0.0409	-0.0299	0.2450
本期加权平均净值利润率	3.30%	-2.51%	19.77%
本期基金份额净值增长率	4.03%	0.41%	30.28%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	99,875,851.04	-5,643,610.31	16,240,654.78
期末可供分配基金份额利润	0.0885	-0.0023	0.0033
期末基金资产净值	1,425,614,569.36	3,006,379,503.57	6,016,275,412.68
期末基金份额净值	1.263	1.229	1.224
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	82.49%	75.42%	74.70%

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	3.95%	0.31%	0.53%	0.04%	3.42%	0.27%
过去六个月	2.35%	0.51%	0.00%	0.05%	2.35%	0.46%
过去一年	4.03%	0.38%	-1.24%	0.10%	5.27%	0.28%
过去三年	36.09%	0.37%	11.41%	0.14%	24.68%	0.23%
过去五年	95.81%	0.39%	26.40%	0.14%	69.41%	0.25%
自基金合同生效起至今	82.49%	0.36%	21.82%	0.20%	60.67%	0.16%

##### 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

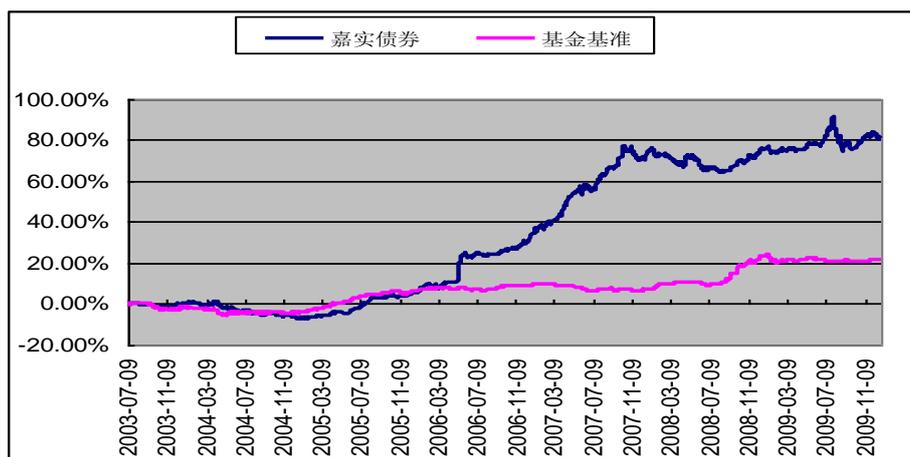


图 1：嘉实债券基金份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2009 年 12 月 31 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）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（3）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%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级；（4）本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月；（5）新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

### 3.2.3 过去五年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

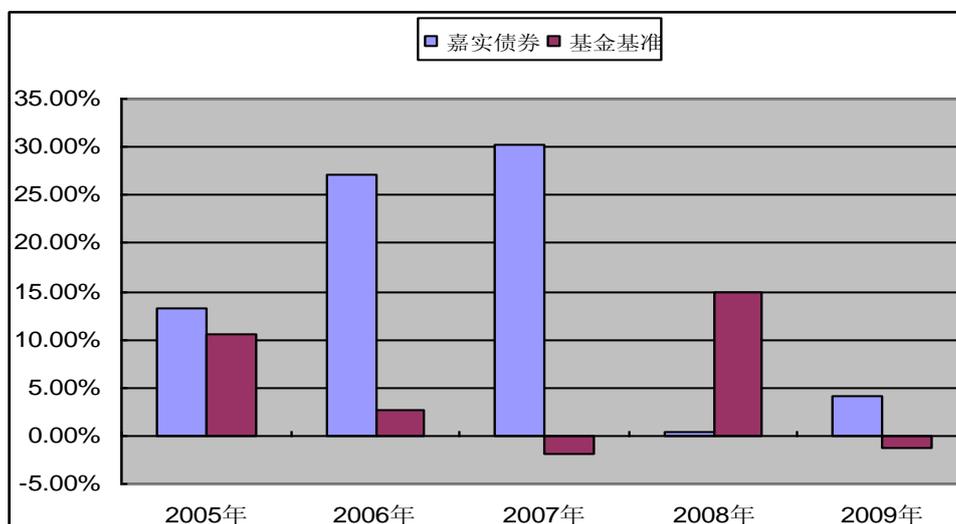


图 2：嘉实债券净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

### 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

2009 年	0.150	8,812,784.93	16,311,556.55	25,124,341.48	2009 年分配一次
2008 年	-	-	-	-	
2007 年	1.600	246,237,952.98	286,717,598.70	532,955,551.68	2007 年分配三次
合计	1.750	255,050,737.91	303,029,155.25	558,079,893.16	

## §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 2009 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、17 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)。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		
刘熹	本基金、嘉实多元债券基金经理、公司固定收益部总监	2008 年 4 月 11 日	—	16 年	曾任平安证券福田营业部分析师、中国平安保险投资管理中心投资经理，巨田证券公司投资部副经理，招商证券公司债券研究员。2003 年 2 月加盟嘉实基金，曾任嘉实策略混合基金经理。经济学硕士，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合规守信情况的说明

在报告期内，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

报告期内，本基金基金份额净值增长率 4.03%，嘉实多元债券 A 基金份额净值增长率 10.22%、嘉实多元债券 B 基金份额净值增长率 9.82%，某债券组合份额净值增长率 1.06%。

主要原因：（1）在权益类资产的配置结构上，嘉实多元债券以参与股票二级市场及新股为主；嘉实债券受基金合同约定，其权益类资产以可转债、增发个股及新股为主；某债券组合受合同约定，主要配置在可转债及其转股个股上。报告期内，沪深 300 涨幅为 96.71%，中信标普转债指数上涨 45.83%，由于股票涨幅好于转债，导致了组合业绩上的差异。（2）相对于嘉实多元债券、嘉实债券，某债券组合受合同约定权益类资产投资上限较低，而报告期内权益类资产表现突出，从而导致业绩差异。

#### 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

2009 年，全球经济形势和政策取向的共性极强，即经济先延续 2008 年第四季度的快速下滑，然后在宽松货币与积极财政政策共同作用下止跌回升，差异之处在于出台刺激政策的先后，中国在此轮政府调控经济中处于先行行列，因此中国经济的 V 型复苏也领先于其他国家。中国的经济复苏路径可以概括为“信贷促进投资、投资拉动经济”，由此在净出口负增长的情况下，通过投资高增长弥补缺口，实现了全年 GDP 增长“保 8”的目标。上半年国内外经济疲弱需求低迷，普遍出现产能过剩状况，价格水平出现通货紧缩，CPI 负值长达 9 个月时间，但到下半年，随着经济逐步复苏，对于流动性过度宽松将重新催生通货膨胀的担忧开始抬头，政府刺激政策的逐步退出也成为市场最新的关注焦点。

经济复苏与通胀重生的预期是 2009 年中国债市两大基本面不利因素，虽然整体流动性宽裕，但实体经济所需之外的流动性主要流向了股票与住房两大类资产，在第四季度之前对于债市的支撑作用都显得微弱。在经历三个季度的下跌后，中长期债券的收益率水平升至对银行保险一类长

期投资资金颇有吸引力的水平。此外，2009 年中国债市的另一特点是信用债成为市场新热点，原因是信用产品高于利率产品的息票收入提供较好的持有收益，并且经济的复苏有利于信用息差的缩窄。

本基金在 2009 年一直维持短久期策略，较好地控制了债市下跌风险，另外，适当配置了信用债，为组合贡献一定的收益。

#### 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 1.263 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.03%，业绩比较基准收益率为-1.24%。

#### 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 2010 年，经济基本面依然存在重大的不确定性，政府投资和产业振兴政策是短暂的“强心针”还是能够真正带领中国经济步入新一轮快速增长的轨道？这些都面临较大变数；另一方面，高通胀的风险较小。因此，预计 2010 年的债券市场将呈现窄幅震荡的格局。本基金将继续遵循“不追求过高风险回报”的投资理念，密切跟踪国内外经济形势变化，充分考虑国内资本市场的风险和机会，在严格控制基金净值波动的基础上，寻求基金净值的稳定增长。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人重点开展了合规管理、内部审计、法律事务、制度建设、信息披露等监察稽核工作，采取的主要措施如下：

**(1) 差错管理：**全面实施内部差错管理，每月进行统计分析，与业务部门及时沟通，提出改进或防范措施有效控制差错行为。以风险源头部门、风险控制部门为主重新改组了风险控制委员会人员构成，风控委员会定期召开会议，对主要风险和差错进行评估，提出改进措施，修正控制流程。

**(2) 内控前置：**在新产品设计、业务创新、市场营销、投资管理、信息披露、公司制度建设等方面，全面实施内控前置，紧跟公司业务发展战略，为业务部门及时提供法律支持以及合规风险、操作风险防范措施。

**(3) “三条底线”的防范：**认真对照“诚实信用、审慎勤勉、恪尽职守”12 字基本要求，积极倡导“主动合规”的内控文化，公司各项管理制度健全并严格执行，规范运作，审慎经营，公司管理的不同投资组合能够得到公平对待，坚守“三条底线”。

**(4) 信息披露和投资者关系管理工作：**完成 19 只基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

#### 4.7 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验。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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本报告 3.1.1 “本期利润” 63,010,075.01 元，报告期内本基金实施了 1 次利润分配，权益登记日、除息日为 2009 年 4 月 7 日，红利发放日为 2009 年 4 月 8 日，分配金额 25,124,341.48 元，符合本基金基金合同（第三部分十一（二）收益分配原则）“7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次”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”）在对嘉实债券证券投资基金（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

安永华明（2010）审字第 60468756\_A01 号

### 嘉实理财通系列开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实理财通系列开放式证券投资基金（以下简称“贵基金”）财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表，2009 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

#### 一、基金管理人 对财务报表的责任

按照企业会计准则编制财务报表是贵基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

#### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则编制，在所有重大方面公允反映了嘉实理财通系列开放式证券投资基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所

中国 北京

中国注册会计师 杨 勃

中国注册会计师 王珊珊

2010年3月22日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
<b>资产</b>			
银行存款	7.4.7.1	24,555,930.64	208,562,963.59
结算备付金		18,286,842.26	89,936,651.91
存出保证金		459,208.96	369,120.43
交易性金融资产	7.4.7.2	1,510,580,787.96	3,203,290,540.90
其中：股票投资		207,088,289.96	959,072.94
基金投资		-	-
债券投资		1,303,492,498.00	3,202,331,467.96
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		-	10,320,983.09
应收利息	7.4.7.5	19,504,603.83	46,030,998.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,472,975.33	1,819,408.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,574,860,348.98	3,560,330,667.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年12月31日</b>	<b>上年度末 2008年12月31日</b>
<b>负债</b>			
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		120,000,000.00	539,123,991.31
应付证券清算款		21,772,583.11	-
应付赎回款		4,137,964.44	10,970,685.75
应付管理人报酬		733,966.13	1,604,074.34
应付托管费		244,655.36	534,691.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	177,543.02	279,752.00
应交税费		1,848,577.32	1,076,883.62
应付利息		735.77	14,972.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	329,754.47	346,113.14
负债合计		149,245,779.62	553,951,163.90
<b>所有者权益</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,128,730,824.66	2,446,709,474.47
未分配利润	7.4.7.10	296,883,744.70	559,670,029.10
所有者权益合计		1,425,614,569.36	3,006,379,503.57
负债和所有者权益总计		1,574,860,348.98	3,560,330,667.47

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.263 元，基金份额总额 1,128,730,824.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
<b>一、收入</b>		84,002,800.00	-53,772,611.97
1.利息收入		65,289,437.21	171,034,654.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	982,964.31	5,193,223.19
债券利息收入		64,301,747.90	165,581,126.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,725.00	260,304.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益		127,847,975.13	-134,887,687.55
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,340,810.37	12,730,658.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	119,466,408.00	-166,086,248.31
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	835,546.93	13,332,965.10
股利收益	7.4.7.15	205,209.83	5,134,937.02
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-110,348,904.09	-93,925,357.72
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	1,214,291.75	4,005,779.29
<b>减：二、费用</b>		20,992,724.99	75,852,895.88
1. 管理人报酬		11,556,565.93	31,086,329.80
2. 托管费		3,852,188.54	10,362,109.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,111,990.52	3,403,410.94
5. 利息支出		4,246,307.70	30,788,051.04
其中：卖出回购金融资产支出		4,246,307.70	30,788,051.04
6. 其他费用	7.4.7.19	225,672.30	212,994.21
<b>三、利润总额</b>		63,010,075.01	-129,625,507.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		63,010,075.01	-129,625,507.85

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	2,446,709,474.47	559,670,029.10	3,006,379,503.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	63,010,075.01	63,010,075.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,317,978,649.81	-300,672,017.93	-1,618,650,667.74
其中：1.基金申购款	730,790,489.57	179,876,626.55	910,667,116.12
2.基金赎回款	-2,048,769,139.38	-480,548,644.48	-2,529,317,783.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动	-	-25,124,341.48	-25,124,341.48
五、期末所有者权益（基金净值）	1,128,730,824.66	296,883,744.70	1,425,614,569.36
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	4,915,169,296.03	1,101,106,116.65	6,016,275,412.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	-129,625,507.85	-129,625,507.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,468,459,821.56	-411,810,579.70	-2,880,270,401.26
其中：1.基金申购款	3,351,505,380.60	681,461,116.55	4,032,966,497.15
2.基金赎回款	-5,819,965,202.16	-1,093,271,696.25	-6,913,236,898.41
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）	2,446,709,474.47	559,670,029.10	3,006,379,503.57

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：

基金管理公司负责人赵学军， 主管会计工作负责人李松林， 会计机构负责人王红。

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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。嘉实理财通开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”或“理财通系列基金”)，系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]67号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于2003年7月9日正式生效，首次

设立募集规模为2,562,105,335.59份基金份额。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定。本系列基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金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%。本基金的业绩比较基准为：中央国债登记结算公司的中国债券指数。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

#### （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### （2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于确认日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 股票投资

##### 1、上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

##### 2、未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本估值；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

##### D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

## （2）债券投资

1、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3、未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4、在全国银行间债券市场交易的债券及交易所固定收益平台交易的债券等，采用估值技术确定公允价值；

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

## （3）权证投资

1、上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2、未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

3、因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

## （4）分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行估值；

## （5）其他

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 本基金的基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率逐日计提;

(2) 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或红利再投资形式。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金无其他重要的会计政策和会计估计说明。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

本基金无会计政策和会计估计变更及差错更正事项。

#### **7.4.6 税项**

(1) 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （2）营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

## （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利，债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
活期存款	24,555,930.64	208,562,963.59
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月-1年	-	-
其他存款	-	-
合计	24,555,930.64	208,562,963.59

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	193,611,105.66	207,088,289.96	13,477,184.30	
债券	交易所市场	733,237,696.20	747,857,498.00	14,619,801.80
	银行间市场	561,565,699.93	555,635,000.00	-5,930,699.93
	合计	1,294,803,396.13	1,303,492,498.00	8,689,101.87
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,488,414,501.79	1,510,580,787.96	22,166,286.17	
项目	上年度末 2008年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	959,072.94	959,072.94	-	
债券	交易所市场	1,314,585,463.51	1,385,518,467.96	70,933,004.45
	银行间市场	1,755,230,814.19	1,816,813,000.00	61,582,185.81
	合计	3,069,816,277.70	3,202,331,467.96	132,515,190.26
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,070,775,350.64	3,203,290,540.90	132,515,190.26	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2009年12月31日）及上年度末（2008年12月31日）、本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2009 年 12 月 31 日）及上年度末（2008 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2009 年 12 月 31 日）及上年度末（2008 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,858.35	17,658.66
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	8,534.60	40,471.50
应收债券利息	19,470,878.35	45,972,653.92
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	332.53	214.56
其他	-	-
合计	19,504,603.83	46,030,998.64

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2009 年 12 月 31 日）和上年度末（2008 年 12 月 31 日），本基金均未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	163,611.46	256,476.44
银行间市场应付交易费用	13,931.56	23,275.56
合计	177,543.02	279,752.00

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	5,254.47	21,613.14
预提审计费	70,000.00	70,000.00
银行间帐户维护费	4,500.00	4,500.00
应付通讯费	-	-
合计	329,754.47	346,113.14

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,446,709,474.47	2,446,709,474.47
本期申购	730,790,489.57	730,790,489.57
本期赎回	-2,048,769,139.38	-2,048,769,139.38
本期末	1,128,730,824.66	1,128,730,824.66

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,643,610.31	565,313,639.41	559,670,029.10
本期利润	173,358,979.10	-110,348,904.09	63,010,075.01
本期基金份额交易产生的变动数	-42,715,176.27	-257,956,841.66	-300,672,017.93
其中：基金申购款	31,639,108.62	148,237,517.93	179,876,626.55
基金赎回款	-74,354,284.89	-406,194,359.59	-480,548,644.48
本期已分配利润	-25,124,341.48	-	-25,124,341.48
本期末	99,875,851.04	197,007,893.66	296,883,744.70

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
活期存款利息收入	806,872.07	4,369,884.00
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	173,376.54	756,641.58
其他	2,715.70	66,697.61
合计	982,964.31	5,193,223.19

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	246,365,501.44	946,243,818.83
减：卖出股票成本总额	239,024,691.07	933,513,160.19
买卖股票差价收入	7,340,810.37	12,730,658.64

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日

卖出债券、债转股及债券到期兑付成交金额	9,617,204,118.31	12,945,314,129.24
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	9,347,890,831.07	12,922,001,070.41
减：应收利息总额	149,846,879.24	189,399,307.14
债券投资收益	119,466,408.00	-166,086,248.31

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交金额	2,332,842.28	70,554,827.61
减：卖出权证成本总额	1,497,295.35	57,221,862.51
买卖权证差价收入	835,546.93	13,332,965.10

注：本期及上年度可比期间均无权证行权。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	205,209.83	5,134,937.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	205,209.83	5,134,937.02

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
1.交易性金融资产	-110,348,904.09	-92,880,917.65
——股票投资	13,477,184.30	-280,938,473.56
——债券投资	-123,826,088.39	188,057,555.91
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-1,044,440.07
——权证投资	-	-1,044,440.07
3.其他	-	-
合计	-110,348,904.09	-93,925,357.72

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	827,629.42	3,474,717.97
转换费收入	344,253.38	527,645.75
印花税手续费返还	-	3,415.57

其他	42,408.95	-
合计	1,214,291.75	4,005,779.29

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	1,066,640.52	3,347,348.44
银行间市场交易费用	45,350.00	56,062.50
合计	1,111,990.52	3,403,410.94

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
席位使用费	-	-
银行费用	47,639.30	34,694.21
其他	33.00	300.00
合计	225,672.30	212,994.21

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项：无

#### 7.4.9 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

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期、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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,556,565.93	31,086,329.80
其中：支付销售机构的客户维护费	772,239.31	1,196,329.16

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,852,188.54	10,362,109.89

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.3 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 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	314,454,728.77	1,322,354,483.93	-	-	3,497,444,000.00	346,523.14
上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	2,130,396,575.29	3,005,286,953.96	-	-	13,259,760,000.00	8,067,985.03

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
期初持有的基金份额	34,122,230.69	34,122,230.69
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	-	-
期末持有的基金份额	34,122,230.69	34,122,230.69
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.02%	1.39%

注：（1）期间申购/买入总份额无红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额无转换出份额。

（2）基金管理人于 2007 年 2 月 5 日通过代销机构申购嘉实债券基金 1500 万元，申购费为 1000 元；2006 年 8 月 22 日，申购嘉实债券基金 1200 万元，申购费为 1000 元；2005 年 10 月 19 日，申购嘉实债券基金 1000 万元，申购费为 1000 元。

#### 7.4.10.4.2 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		上年度末	
	2009年12月31日		2008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
中诚信托有限责任公司	-	-	83,402,001.66	3.41%

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年12月31日		2008年1月1日至2008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	24,555,930.64	806,872.07	208,562,963.59	4,369,884.00

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润 分配合计	备注
1	2009-4-7	2009-4-7	0.150	8,812,784.93	16,311,556.55	25,124,341.48	
合计			0.150	8,812,784.93	16,311,556.55	25,124,341.48	

注：2009 年 4 月 3 日，基金管理人发布《嘉实债券证券投资基金 2009 年第一次收益分配公告》，以截至 2009 年 3 月 31 日的可供分配收益为基准，向本基金份额持有人进行收益分配：每 10 份基金份额派发现金红利 0.15 元，红利发放日为 2009 年 4 月 8 日。

#### 7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

## 7.4.12.1.1 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
601117	中国化学	2009-12-29	2010-1-7	未上市	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-3-25	IPO 网下锁定三个月	6.95	16.78	113,609	789,582.55	1,906,359.02
601888	中国国旅	2009-9-25	2010-1-15	IPO 网下锁定三个月	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40
002299	圣农发展	2009-10-13	2010-1-21	IPO 网下锁定三个月	19.75	25.03	64,239	1,268,720.25	1,607,902.17
002300	太阳电缆	2009-10-13	2010-1-21	IPO 网下锁定三个月	20.56	33.33	48,535	997,879.60	1,617,671.55
002301	齐心文具	2009-10-14	2010-1-21	IPO 网下锁定三个月	20.00	35.20	35,656	713,120.00	1,255,091.20
002303	美盈森	2009-10-22	2010-2-3	IPO 网下锁定三个月	25.36	31.50	51,415	1,303,884.40	1,619,572.50
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-2-8	IPO 网下锁定三个月	60.00	113.99	33,407	2,004,420.00	3,808,063.93
002305	南国置业	2009-10-29	2010-2-8	IPO 网下锁定三个月	12.30	19.57	59,221	728,418.30	1,158,954.97
002307	北新路桥	2009-11-5	2010-2-11	IPO 网下锁定三个月	8.58	27.40	60,106	515,709.48	1,646,904.40
002308	威创股份	2009-11-18	2010-3-1	IPO 网下锁定三个月	23.80	31.83	56,492	1,344,509.60	1,798,140.36
002309	中利科技	2009-11-18	2010-3-1	IPO 网下锁定三个月	46.00	61.21	45,366	2,086,836.00	2,776,852.86
002310	东方园林	2009-11-20	2010-3-1	IPO 网下锁定三个月	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32
002313	日海通讯	2009-11-26	2010-3-3	IPO 网下锁定三个月	24.80	40.82	17,281	428,568.80	705,410.42
002315	焦点科技	2009-12-1	2010-3-9	IPO 网下锁定三个月	42.00	69.18	21,354	896,868.00	1,477,269.72
002317	众生药业	2009-12-3	2010-3-11	IPO 网下锁定三个月	55.00	70.77	26,782	1,473,010.00	1,895,362.14
002318	久立特材	2009-12-3	2010-3-11	IPO 网下锁定三个月	23.00	33.13	60,218	1,385,014.00	1,995,022.34
002321	华英农业	2009-12-9	2010-3-16	IPO 网下锁定三个月	16.98	26.61	82,149	1,394,890.02	2,185,984.89
002322	理工监测	2009-12-11	2010-3-18	IPO 网下锁定三个月	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60
002323	中联电气	2009-12-11	2010-3-18	IPO 网下锁定三个月	30.00	40.57	24,197	725,910.00	981,672.29
002324	普利特	2009-12-11	2010-3-18	IPO 网下锁定三个月	22.50	34.62	42,716	961,110.00	1,478,827.92
002325	洪涛股份	2009-12-15	2010-3-22	IPO 网下锁定三个月	27.00	33.18	40,472	1,092,744.00	1,342,860.96
002326	永太科技	2009-12-15	2010-3-22	IPO 网下锁定三个月	20.00	31.27	37,849	756,980.00	1,183,538.23
002327	富安娜	2009-12-22	2010-3-30	IPO 网下锁定三个月	30.00	39.66	27,665	829,950.00	1,097,193.90
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-4-6	IPO 网下锁定三个月	20.10	20.10	51,032	1,025,743.20	1,025,743.20
002331	皖通科技	2009-12-25	2010-4-6	IPO 网下锁定三个月	27.00	27.00	26,748	722,196.00	722,196.00
002333	罗普斯金	2009-12-30	2010-1-12	未上市	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00
300003	乐普医疗	2009-9-29	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00
300004	南风股份	2009-9-29	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	22.89	39.16	81,702	1,870,158.78	3,199,450.32
300007	汉威电子	2009-9-29	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	27.00	44.01	42,313	1,142,451.00	1,862,195.13
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40
300024	机器人	2009-10-19	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	39.80	72.28	26,015	1,035,397.00	1,880,364.20
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-2-1	IPO 网下锁定三个月	28.58	55.43	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81
300030	阳普医疗	2009-12-18	2010-3-25	IPO 网下锁定三个月	25.00	35.10	25,052	626,300.00	879,325.20
300031	宝通带业	2009-12-18	2010-3-25	IPO 网下锁定三个月	38.00	56.43	36,316	1,380,008.00	2,049,311.88
300033	同花顺	2009-12-18	2010-3-25	IPO 网下锁定三个月	52.80	70.86	43,177	2,279,745.60	3,059,522.22

300036	超图软件	2009-12-18	2010-3-25	IPO 网下锁定三个月	19.60	38.31	24,330	476,868.00	932,082.30
300039	上海凯宝	2009-12-28	2010-4-8	IPO 网下锁定三个月	38.00	38.00	111,457	4,235,366.00	4,235,366.00
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-4-8	IPO 网下锁定三个月	33.00	33.00	62,578	2,065,074.00	2,065,074.00
300041	回天胶业	2009-12-28	2010-1-8	未上市	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00
300042	朗科科技	2009-12-28	2010-4-8	IPO 网下锁定三个月	39.00	39.00	46,705	1,821,495.00	1,821,495.00

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的债券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为零。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 120,000,000.00 元，于 2010 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金

管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于 2009 年 12 月 31 日及 2008 年 12 月 31 日均未持有短期信用评级的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
AAA	-	293,575,692.64
AAA 以下	413,867,938.80	141,570,724.42
未评级	-	-
合计	413,867,938.80	435,146,417.06

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了嘉实债券交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末 2009年12月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	24,555,930.64	-	-	-	-	-	24,555,930.64
结算备付金	18,286,842.26	-	-	-	-	-	18,286,842.26
存出保证金	-	-	-	-	-	459,208.96	459,208.96
交易性金融资产	-	378,770,000.00	-	811,979,478.00	112,743,020.00	207,088,289.96	1,510,580,787.96
应收利息	-	-	-	-	-	19,504,603.83	19,504,603.83
应收申购款	500,000.00	-	-	-	-	972,975.33	1,472,975.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,342,772.90	378,770,000.00	-	811,979,478.00	112,743,020.00	228,025,078.08	1,574,860,348.98

负债							
卖出回购金融资产款	120,000,000.00	-	-	-	-	-	120,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	21,772,583.11	21,772,583.11
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,137,964.44	4,137,964.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	733,966.13	733,966.13
应付托管费	-	-	-	-	-	244,655.36	244,655.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	177,543.02	177,543.02
应付税费	-	-	-	-	-	1,848,577.32	1,848,577.32
应付利息	-	-	-	-	-	735.77	735.77
其他负债	-	-	-	-	-	329,754.47	329,754.47
负债总计	120,000,000.00	-	-	-	-	29,245,779.62	149,245,779.62
利率敏感度缺口	-76,657,227.10	378,770,000.00	-	811,979,478.00	112,743,020.00	198,779,298.46	1,425,614,569.36
上年度末 2008年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	208,562,963.59	-	-	-	-	-	208,562,963.59
结算备付金	89,936,651.91	-	-	-	-	-	89,936,651.91
存出保证金	-	-	-	-	-	369,120.43	369,120.43
交易性金融资产	-	-	185,823,537.00	1,773,022,871.02	1,243,485,059.94	959,072.94	3,203,290,540.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,320,983.09	10,320,983.09
应收利息	-	-	-	-	-	46,030,998.64	46,030,998.64
应收申购款	40,755.49	-	-	-	-	1,778,653.42	1,819,408.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	298,540,370.99	-	185,823,537.00	1,773,022,871.02	1,243,485,059.94	59,458,828.52	3,560,330,667.47
负债							
卖出回购金融资产	539,123,991.31	-	-	-	-	-	539,123,991.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,970,685.75	10,970,685.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,604,074.34	1,604,074.34
应付托管费	-	-	-	-	-	534,691.45	534,691.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	279,752.00	279,752.00
应付税费	-	-	-	-	-	1,076,883.62	1,076,883.62
应付利息	-	-	-	-	-	14,972.29	14,972.29
其他负债	-	-	-	-	-	346,113.14	346,113.14
负债总计	539,123,991.31	-	-	-	-	14,827,172.59	553,951,163.90
利率敏感度缺口	-240,583,620.32	-	185,823,537.00	1,773,022,871.02	1,243,485,059.94	44,631,655.93	3,006,379,503.57

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为嘉实债券利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

假设	(1)该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况； (2)假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； (3)此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
	+25 个基准点	-558.02	-3,646.56
	-25 个基准点	558.02	3,646.56

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险, 市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险, 并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金主要投资于固定收益类金融工具, 投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%; 投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%; 新股投资比例不超过基金资产总值的 20%, 业绩比较基准为: 中央国债登记结算公司的中国债券指数。于 2009 年 12 月 31 日, 本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位: 人民币元

项目	本期末 (2009年12月31日)		上年度末 (2008年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	207,088,289.96	14.53	959,072.94	0.03
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	207,088,289.96	14.53	959,072.94	0.03

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日, 股票等权益类资产占基金资产净值的比例为 14.53% (2008 年 12 月 31 日: 0.03%), 因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变时, 则本基金资产净值不会发生重大变动。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项: 无

## §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	207,088,289.96	13.15
	其中：股票	207,088,289.96	13.15
2	固定收益投资	1,303,492,498.00	82.77
	其中：债券	1,303,492,498.00	82.77
	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	42,842,772.90	2.72
6	其他资产	21,436,788.12	1.36
	合计	1,574,860,348.98	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	3,793,887.06	0.27
B	采掘业	82,429,773.12	5.78
C	制造业	76,720,706.52	5.38
C0	食品、饮料	4,833,807.13	0.34
C1	纺织、服装、皮毛	16,160,212.62	1.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,874,663.70	0.20
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,729,878.03	0.33
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,006,022.34	0.14
C7	机械、设备、仪表	39,985,394.56	2.80
C8	医药、生物制品	6,130,728.14	0.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,906,359.02	0.13
E	建筑业	16,804,549.68	1.18
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	10,516,116.02	0.74
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	5,986,302.96	0.42
J	房地产业	1,158,954.97	0.08
K	社会服务业	4,697,104.80	0.33

L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.22
M	综合类	-	-
	合计	207,088,289.96	14.53

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600971	恒源煤电	2,435,868	82,429,773.12	5.78
2	600312	平高电气	1,309,501	20,179,410.41	1.42
3	002154	报喜鸟	667,687	15,063,018.72	1.06
4	601668	中国建筑	2,600,000	12,272,000.00	0.86
5	601788	光大证券	234,573	5,986,302.96	0.42
6	300039	上海凯宝	111,457	4,235,366.00	0.30
7	002304	洋河股份	33,407	3,808,063.93	0.27
8	300003	乐普医疗	70,615	3,615,488.00	0.25
9	300004	南风股份	81,702	3,199,450.32	0.22
10	300027	华谊兄弟	55,467	3,074,535.81	0.22
11	300033	同花顺	43,177	3,059,522.22	0.21
12	002309	中利科技	45,366	2,776,852.86	0.19
13	601888	中国国旅	131,060	2,744,396.40	0.19
14	002321	华英农业	82,149	2,185,984.89	0.15
15	300040	九洲电气	62,578	2,065,074.00	0.14
16	300031	宝通带业	36,316	2,049,311.88	0.14
17	002318	久立特材	60,218	1,995,022.34	0.14
18	601139	深圳燃气	113,609	1,906,359.02	0.13
19	002317	众生药业	26,782	1,895,362.14	0.13
20	300015	爱尔眼科	38,568	1,882,118.40	0.13
21	300024	机器人	26,015	1,880,364.20	0.13
22	300007	汉威电子	42,313	1,862,195.13	0.13
23	300042	朗科科技	46,705	1,821,495.00	0.13
24	002308	威创股份	56,492	1,798,140.36	0.13
25	002307	北新路桥	60,106	1,646,904.40	0.12
26	002303	美盈森	51,415	1,619,572.50	0.11
27	002300	太阳电缆	48,535	1,617,671.55	0.11
28	002299	圣农发展	64,239	1,607,902.17	0.11
29	002310	东方园林	13,914	1,542,784.32	0.11
30	002324	普利特	42,716	1,478,827.92	0.10
31	002315	焦点科技	21,354	1,477,269.72	0.10
32	002325	洪涛股份	40,472	1,342,860.96	0.09
33	002301	齐心文具	35,656	1,255,091.20	0.09
34	002326	永太科技	37,849	1,183,538.23	0.08

35	002305	南国置业	59,221	1,158,954.97	0.08
36	002327	富安娜	27,665	1,097,193.90	0.08
37	002329	皇氏乳业	51,032	1,025,743.20	0.07
38	002323	中联电气	24,197	981,672.29	0.07
39	300036	超图软件	24,330	932,082.30	0.07
40	002322	理工监测	14,995	927,890.60	0.07
41	300030	阳普医疗	25,052	879,325.20	0.06
42	002331	皖通科技	26,748	722,196.00	0.05
43	002313	日海通讯	17,281	705,410.42	0.05
44	601117	中国化学	13,000	70,590.00	0.00
45	300041	回天胶业	500	18,200.00	0.00
46	002333	罗普斯金	500	11,000.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

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	600971	恒源煤电	93,142,355.96	3.10
2	600219	南山铝业	90,813,524.77	3.02
3	601668	中国建筑	32,564,239.84	1.08
4	600312	平高电气	23,178,167.70	0.77
5	000528	柳工	22,947,968.66	0.76
6	002154	报喜鸟	16,419,834.52	0.55
7	600598	北大荒	15,634,897.12	0.52
8	600596	新安股份	15,325,240.00	0.51
9	000572	海马股份	12,813,992.28	0.43
10	000778	新兴铸管	11,879,910.90	0.40
11	002088	鲁阳股份	10,096,685.88	0.34
12	600033	福建高速	9,773,600.00	0.33
13	600368	五洲交通	7,396,911.08	0.25
14	601788	光大证券	5,998,798.84	0.20
15	300039	上海凯宝	4,235,366.00	0.14
16	600173	卧龙地产	4,185,466.20	0.14
17	300033	同花顺	2,279,745.60	0.08
18	002309	中利科技	2,086,836.00	0.07
19	300040	九洲电气	2,065,074.00	0.07
20	300003	乐普医疗	2,047,835.00	0.07

##### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

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	600219	南山铝业	83,310,097.12	2.77

2	601668	中国建筑	24,805,581.44	0.83
3	000528	柳 工	23,960,875.65	0.80
4	600598	北大荒	15,661,586.60	0.52
5	600596	新安股份	14,406,605.00	0.48
6	000572	海马股份	12,381,942.75	0.41
7	002088	鲁阳股份	11,559,745.31	0.38
8	000778	新兴铸管	10,326,062.83	0.34
9	600033	福建高速	9,757,346.44	0.32
10	600368	五洲交通	7,784,342.88	0.26
11	600173	卧龙地产	5,217,836.26	0.17
12	002154	报喜鸟	3,139,915.00	0.10
13	601107	四川成渝	2,822,448.80	0.09
14	002294	信立泰	1,867,551.00	0.06
15	002293	罗莱家纺	1,725,388.32	0.06
16	002290	禾盛新材	1,523,605.75	0.05
17	002285	世联地产	1,450,764.00	0.05
18	002276	万马电缆	1,374,528.09	0.05
19	002115	三维通信	1,365,920.83	0.05
20	002277	家润多	1,248,826.80	0.04

#### 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	432,635,796.73
卖出股票收入（成交）总额	246,365,501.44

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	333,989,559.20	23.43
2	央行票据	555,635,000.00	38.98
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	294,774,404.60	20.68
5	企业短期融资券	-	-
6	可转换债券	119,093,534.20	8.35
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
	合计	1,303,492,498.00	91.43

**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	债券简称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801017	08 央行票据 17	2,500,000	256,625,000.00	18.00
2	010203	02 国债(3)	1,450,650	146,994,364.50	10.31
3	0901057	09 央行票据 57	1,000,000	99,670,000.00	6.99
4	010308	03 国债(8)	885,730	89,228,440.20	6.26
5	122964	09 龙湖债	807,620	82,942,574.00	5.82

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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**

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	459,208.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,504,603.83
5	应收申购款	1,472,975.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	21,436,788.12

**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	75,502,528.20	5.30
2	110598	大荒转债	55,399.60	0.00

**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	股票简称	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	300039	上海凯宝	4,235,366.00	0.30	IPO网下申购锁定3个月

2	002304	洋河股份	3,808,063.93	0.27	IPO网下申购锁定3个月
3	300003	乐普医疗	3,615,488.00	0.25	IPO网下申购锁定3个月
4	300004	南风股份	3,199,450.32	0.22	IPO网下申购锁定3个月
5	300027	华谊兄弟	3,074,535.81	0.22	IPO网下申购锁定3个月

## §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(%)
38,334	29,444.64	222,185,909.86	19.68	906,544,914.80	80.32

### 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	3,027,940.58	0.27

## §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	586,521,597.17
报告期期初基金份额总额	2,446,709,474.47
报告期期间基金总申购份额	730,790,489.57
减：报告期期间基金总赎回份额	2,048,769,139.38
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,128,730,824.66

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

报告期内基金管理人、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 70,000.00 元, 该审计机构已连续 7 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 (%)	
中信证券股份有限公司	1	164,983,344.54	66.97	528,777.26	80.52	
华泰联合证券有限责任公司	1	81,382,156.90	33.03	127,947.23	19.48	
国泰君安证券股份有限公司	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。

#### 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

##### (1) 债券交易情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券	
	债券成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中信证券股份有限公司	6,886,937,541.02	83.66
华泰联合证券有限责任公司	1,344,877,359.00	16.34

##### (2) 债券回购交易情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券回购	
	债券回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
中信证券股份有限公司	21,389,500,000.00	100.00

## (3) 权证交易情况

金额单位：人民币元

券商名称	权证	
	权证成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	2,332,842.28	100.00

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金通过深圳发展银行开办定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年1月12日
2	关于提示投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月7日
3	关于成立嘉实国际资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月19日
4	关于成立福州、南京分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月19日
5	关于旗下基金参加中国工商银行开展基智定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月26日
6	关于通过交通银行网上银行申购嘉实旗下基金费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月27日
7	嘉实基金管理有限公司关于电话总机变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月27日
8	关于增加天相投资顾问有限公司为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年3月7日
9	关于旗下开放式基金通过宁波银行、山西证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年3月19日
10	关于增加东莞银行为嘉实旗下开放式基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年3月20日
11	关于通过中国工商银行个人网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年4月1日
12	嘉实债券证券投资基金 2009 年第一次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年4月3日
13	关于对广发银行理财通卡和中行广东分行借记卡持有人开通嘉实网上定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年4月9日
14	关于增加广发银行为嘉实债券等开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年4月27日
15	关于旗下基金参加中国银行开展的基金定投和网上银行基金交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年5月6日
16	关于旗下开放式基金通过恒泰证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年5月8日

17	关于旗下开放式基金通过光大证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 9 日
18	关于旗下开放式基金通过中山证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 20 日
19	关于增加中国民族证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 2 日
20	关于旗下开放式基金通过广发银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 3 日
21	关于增加厦门证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 5 日
22	关于增加江海证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 25 日
23	关于旗下开放式基金通过厦门证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 1 日
24	关于增加爱建证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 3 日
25	关于增加华宝证券为嘉实旗下开放式基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 3 日
26	关于增加临商银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 15 日
27	关于增加徽商银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 15 日
28	关于对建行龙卡持卡人开通嘉实直销网上定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 24 日
29	关于增加杭州银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 25 日
30	关于嘉实债券和嘉实多元债券暂停申购和转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 25 日
31	关于恢复嘉实债券和嘉实多元债券申购和转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 29 日
32	关于增加方正证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 29 日
33	关于旗下开放式基金通过徽商银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 29 日
34	关于增加英大证券和宏源证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 7 月 30 日
35	关于增加温州银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 8 月 6 日
36	关于旗下开放式基金通过安信证券和东莞证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 8 月 8 日
37	关于增加杭州银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 8 月 19 日
38	关于增加西南证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 9 月 4 日

39	关于通过中国农业银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 9 月 4 日
40	关于增加南京银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 9 月 10 日
41	关于增加上海农商银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 9 月 17 日
42	关于旗下证券投资基金投资创业板证券的提示公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 9 月 23 日
43	关于通过中国工商银行借记卡在嘉实网上申购基金的费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 10 日
44	关于增加浙商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 16 日
45	关于增加日信证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 27 日
46	关于增加广发华福证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 4 日
47	关于对直销的个人投资者提供网上直销汇款支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 4 日
48	关于增加信达证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 6 日
49	关于旗下开放式基金通过广发华福证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 9 日
50	关于旗下开放式基金通过南京银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 13 日
51	关于增加东兴证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 20 日
52	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加建行龙卡及农行金穗卡持卡人的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 1 日
53	关于增加江苏银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 2 日
54	关于通过广东发展银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 17 日
55	关于旗下开放式基金参加工商银行等代销机构开办定投费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 31 日

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金托管协议》；

- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财通系列开放式证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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**

**2010年3月30日**