

# 嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

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 2009 年 3 月 20 日，本报告期自 2009 年 3 月 20 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.....	5
§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.....	7
§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.....	8
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.....	10
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.....	11
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.....	11
§6 审计报告.....	11
§7 年度财务报表.....	12
7.1 资产负债表.....	12
7.2 利润表.....	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
7.4 报表附注.....	15
§8 投资组合报告.....	31

8.1 期末基金资产组合情况.....	31
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
8.9 投资组合报告附注.....	41
§9 基金份额持有人信息.....	42
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
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.....	42
§10 开放式基金份额变动.....	42
§11 重大事件揭示.....	43
11.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
11.4 基金投资策略的改变.....	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
11.8 其他重大事件.....	44
§12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
基金简称	嘉实量化阿尔法股票
交易主代码	070017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月20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	2,338,261,385.38份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析,根据市场情况灵活配置大类资产:股票投资以“定量投资”为主,依托内部自主研发的嘉实行业选择模型、嘉实 Alpha 多因素模型以及嘉实组合优化器以及强大的数据库系统,同时辅以“定性投资”策略;债券投资采取“自上而下”的策略。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	较高风险,较高收益。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010) 65182266	(010) 66105798
注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 1702 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005 (办公地址)	100140
法定代表人	王忠民	姜建清

### 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	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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 3 月 20 日—2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	548,749,478.40
本期利润	674,691,361.68
加权平均基金份额本期利润	0.2740
本期加权平均净值利润率	23.56%
本期基金份额净值增长率	29.90%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末
期末可供分配利润	519,017,558.72
期末可供分配基金份额利润	0.2220
期末基金资产净值	3,038,416,244.17
期末基金份额净值	1.299
3.1.3 累计期末指标	2009 年末
基金份额累计净值增长率	29.90%

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。（4）本基金合同生效日为 2009 年 3 月 20 日，本报告期自 2009 年 3 月 20 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

### 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	21.40%	1.71%	14.29%	1.32%	7.11%	0.39%
过去六个月	12.66%	2.19%	10.38%	1.60%	2.28%	0.59%
自基金合同生效起至今	29.90%	1.86%	36.95%	1.46%	-7.05%	0.40%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数 × 75% + 上证国债指数 × 25%，采用该业绩比较基准主要基于：① 沪深 300 指数和上证国债指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性；② 作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收

益特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$Benchmark_0 = 1000$$

$$Return_t = 75\% \times (\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}_{t-1} - 1) + 25\% \times (\text{上证国债指数}_t / \text{上证国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{t-1}$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

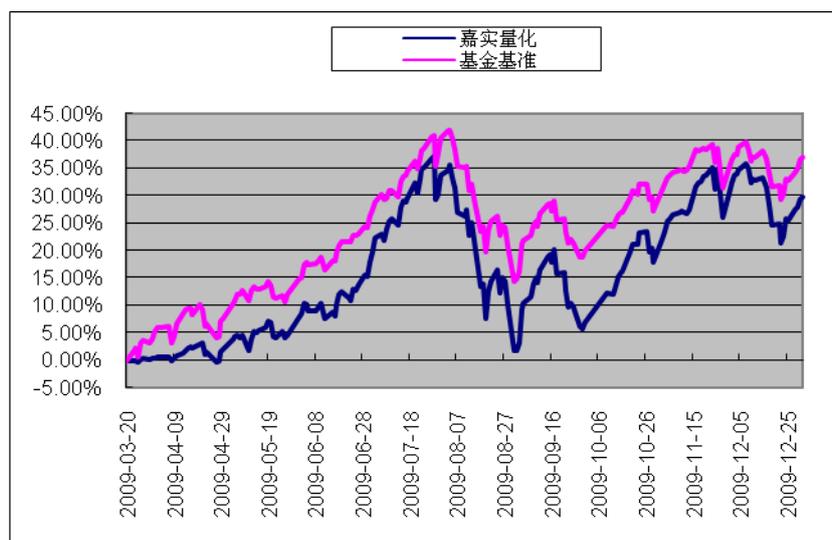


图 1：嘉实量化阿尔法股票基金份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的

历史走势对比图（2009 年 3 月 20 日至 2009 年 12 月 31 日）

注：本基金基金合同生效日 2009 年 3 月 20 日至报告期末未滿 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，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十一部分（二、投资范围和五、（二）投资组合限制）的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效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

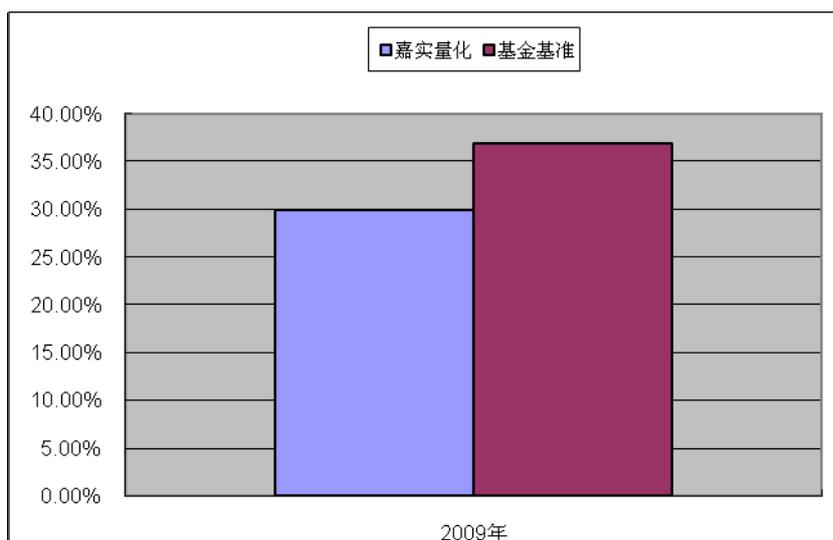


图 2：嘉实量化阿尔法股票净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

注：本基金基金合同生效日为 2009 年 3 月 20 日，2009 年度的相关数据根据当年实际存续期（2009 年 3 月 20 日至 2009 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

自 2009 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日，本基金未实施利润分配。

## §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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
王永宏	本基金基金经理	2009年3月20日	—	11年	曾任海通证券业务经理，大成基金管理有限公司研究员。2001年12月加盟嘉实基金，历任产品总监、首席金融工程师、高级定量分析师。经济学博士，具有基金从业资格，中国国籍。
陶羽	本基金基金经理	2009年3月20日	—	5年	曾任美国高盛公司定量分析师，美国德意志资产管理公司高级定量分析师、基金经理。2008年8月加盟嘉实基金，任高级定量分析师。硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日，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

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、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。因本基金采用定量投资方法需定期更新投资股票库，且恒生系统升级，导致本基金买入托管人“工商银行”股票，于买入次日全部卖出并盈利，未给基金持有人造成损失。本基金的其他运作管理符合有关法律法规和本基金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，本基金未发生有关公平交易方面的异常交易行为。

#### 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年上半年，在国家4万亿经济刺激政策，10大产业振兴计划以及宽松的货币政策和积极的财政政策的联合作用下，中国经济逐渐企稳回升。相应地，在对经济状况改善的预期以及流动性的共同推动下，A股市场走出了一波较大的上升行情。沪深300从年初的1817涨至年中高点3781，涨幅超过100%。其中，以煤炭、有色等上游资源行业和房地产行业涨幅最大。从8月开始，

由于市场对银行贷款增速的担忧，A 股市场出现了超过 20% 的调整。9 月份以来，受良好的宏观经济数据以及海外尤其是美国市场走强的鼓舞，市场结束调整，振荡上行。受到消费政策刺激的汽车、家电板块保持活跃，而房地产板块受政策影响出现比较大的回调。报告期间，经济复苏迹象逐渐明显，市场动能强劲，流动性充裕，因此我们对整体股票市场看多。

2009年3月20日，本基金基金合同正式生效。在操作过程中，我们遵循了定量投资、分散风险、纪律化执行以及系统性组合构建的投资理念。建仓初期，在行业结构上主要选择投资了安全边际比较大、估值合理的钢铁、银行、通讯服务、商业贸易等行业。5月份后，本基金逐步加仓，达到并保持了较高的仓位，主要集中在房地产、煤炭等盈利受益于经济复苏预期、短期动能比较强的行业。四季度，基于对整体经济长期看好的判断，本基金维持了较高的仓位，重点配置了地产、金融、有色等强周期行业。

#### 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 1.299 元；本报告期基金份额净值增长率为 29.90%，同期业绩比较基准收益率为 36.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010 年，我们判断经济将持续恢复，但宏观刺激政策退出的可能性将逐渐加大。政策基调由保增长向稳增长、调结构方向转变。同时，由于 09 年股指的大幅上涨，使得 A 股估值吸引力并不突出。因此，股市将很难产生明显趋势性行情，震荡将是 2010 年市场的主基调，结构调整将成为取得超额收益的主要来源。

2010 年，本基金将采取中性略高的股票资产仓位。重点配置交运、医药、电力设备等估值安全的行业。同时，关注低碳减排、信息产业等受益于经济结构调整政策的板块。

#### 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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告 3.1.2 “期末可供分配利润”为 519,017,558.72 元，本基金基金合同（第十五部分三、收益分配原则）“1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年分配比例不得低于可供分配收益的 30%”，报告期内应分配的金额为 155,705,267.62 元以上。

(3) 本基金管理人以截至 2009 年 12 月 31 日本基金可供分配收益 519,017,558.72 元为基准，向本基金份额持有人进行收益分配，权益登记日、除息日为 2010 年 1 月 20 日，红利发放日为 2010 年 1 月 21 日，分配利润 170,600,558.75 元，符合本基金基金合同的约定。

## §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

2009 年，本托管人在对嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券

投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009年，嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的托管人——嘉实基金管理有限公司在嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

2009年，嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金出现过买入托管人“工商银行”股票的情况，我行及时向嘉实基金管理公司发送提示，嘉实基金管理公司于买入次日全部卖出，未给基金持有人造成损失。

## 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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金2009年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20277 号

嘉实量化阿尔法股票型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量化阿尔法股票型证券投资基金(以下简称“嘉实量化阿尔法基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是嘉实量化阿尔法基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。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和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了嘉实量化阿尔法基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

注册会计师曹银华

会计师事务所有限公司

注册会计师陈宇

中国·上海市

2010 年 3 月 22 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

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
<b>资产</b>		
银行存款	7.4.7.1	298,036,953.76
结算备付金		9,068,757.29
存出保证金		3,201,169.11
交易性金融资产	7.4.7.2	2,744,136,713.82
其中：股票投资		2,744,136,713.82
基金投资		-
债券投资		-
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		10,993,242.28
应收利息	7.4.7.5	54,605.43
应收股利		-
应收申购款		3,377,427.18
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,068,868,868.87
<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>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		-
应付证券清算款		11,400,018.31
应付赎回款		9,015,080.98
应付管理人报酬		3,980,768.83
应付托管费		663,461.50
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	5,259,320.12
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	133,974.96
负债合计		30,452,624.70
<b>所有者权益</b>		
实收基金	7.4.7.9	2,338,261,385.38
未分配利润	7.4.7.10	700,154,858.79
所有者权益合计		3,038,416,244.17
负债和所有者权益总计		3,068,868,868.87

注：本基金合同生效日为 2009 年 3 月 20 日，报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.299 元，基金份额总额 2,338,261,385.38 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 3 月 20 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009年3月20日至2009年12月31日
-----	-----	------------------------------

一、收入		745,554,225.62
1.利息收入		3,482,933.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,482,872.19
债券利息收入		61.55
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益		610,847,074.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	593,626,641.35
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	42,526.45
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	17,177,906.59
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	125,941,883.28
4.汇兑收益		-
5.其他收入	7.4.7.17	5,282,334.21
减：二、费用		70,862,863.94
1. 管理人报酬		33,451,362.37
2. 托管费		5,575,227.09
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	31,557,064.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	279,209.77
三、利润总额		674,691,361.68
减：所得税费用		-
四、净利润		674,691,361.68

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

本报告期：2009年3月20日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年3月20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）	2,961,222,796.80	-	2,961,222,796.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	674,691,361.68	674,691,361.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-622,961,411.42	25,463,497.11	-597,497,914.31
其中：1.基金申购款	2,946,677,753.90	666,385,307.10	3,613,063,061.00

2.基金赎回款	-3,569,639,165.32	-640,921,809.99	-4,210,560,975.31
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）	2,338,261,385.38	700,154,858.79	3,038,416,244.17

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

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 1424 号《关于核准嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,960,807,901.27 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 028 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,961,222,796.80 份基金份额，其中认购资金利息折合 414,895.53 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票资产(A 股以及监管机构允许投资的其他市场的股票资产等)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、央行票据、短期融资券等)、债券回购、以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 60-95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数 X 75% + 上证国债指数 X 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司于 2010 年 3 月 22 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下

合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **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2009年12月31日的财务状况以及2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

##### **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**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债

表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。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。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 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将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值时，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无会计政策变更事项。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无会计估计变更事项。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金无差错更正事项。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

**7.4.7 重要财务报表项目的说明**

本基金基金合同生效日 2009 年 3 月 20 日，2009 年度的相关数据根据当年实际存续期（2009 年 3 月 20 日至 2009 年 12 月 31 日）计算，无涉及对比数据。

**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
活期存款	298,036,953.76
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	298,036,953.76

**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	2,618,194,830.54	2,744,136,713.82	125,941,883.28
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,618,194,830.54	2,744,136,713.82	125,941,883.28

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本期末（2009 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）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）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
应收活期存款利息	51,431.43

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	3,174.00
应收债券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
其他	
合计	54,605.43

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2009年12月31日）本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用）。

#### 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
交易所市场应付交易费用	5,259,320.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,259,320.12

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,974.96
预提费用	100,000.00
合计	133,974.96

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年3月20日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日（2009年3月20日）	2,961,222,796.80	2,961,222,796.80
本期申购	2,946,677,753.90	2,946,677,753.90
本期赎回	-3,569,639,165.32	-3,569,639,165.32
本期末	2,338,261,385.38	2,338,261,385.38

注：（1）申购含转换入份额；赎回含转换出份额。（2）本基金募集期间认购资金本金折份额为 2,960,807,901.27 份，利息折份额为 414,895.53 份。

#### 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
----	-------	-------	---------

基金合同生效日(2009年3月20日)	-	-	-
本期利润	548,749,478.40	125,941,883.28	674,691,361.68
本期基金份额交易产生的变动数	-29,731,919.68	55,195,416.79	25,463,497.11
其中:基金申购款	370,381,792.86	296,003,514.24	666,385,307.10
基金赎回款	-400,113,712.54	-240,808,097.45	-640,921,809.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	519,017,558.72	181,137,300.07	700,154,858.79

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位:人民币元

项目	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
活期存款利息收入	3,342,288.32
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	112,930.74
其他	27,653.13
合计	3,482,872.19

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位:人民币元

项目	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
卖出股票成交总额	9,678,640,758.07
减:卖出股票成本总额	9,085,014,116.72
买卖股票差价收入	593,626,641.35

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位:人民币元

项目	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
卖出债券成交金额	198,588.00
减:卖出债券成本总额	156,000.00
减:应收利息总额	61.55
债券投资收益	42,526.45

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本期(2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日)本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位:人民币元

项目	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	17,177,906.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,177,906.59

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2009年3月20日（基金合同生效日）至2009年12月31日
1.交易性金融资产	125,941,883.28
——股票投资	125,941,883.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	125,941,883.28

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2009年3月20日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金赎回费收入	4,445,536.90
转换基金补偿收入	817,669.27
其他	19,128.04
合计	5,282,334.21

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2009年3月20日（基金合同生效日）至2009年12月31日
交易所市场交易费用	31,557,064.71
银行间市场交易费用	-
合计	31,557,064.71

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2009年3月20日（基金合同生效日）至2009年12月31日
审计费用	100,000.00
信息披露费	150,000.00
债券托管账户维护费	7,500.00
银行汇划费用	20,809.77
其他	900.00
合计	279,209.77

**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**

报告期内，本基金不存在或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2010 年 1 月 16 日, 本基金管理人发布《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金 2009 年年度收益分配公告》, 以截至 2009 年 12 月 31 日本基金可供分配收益为基准, 向本基金份额持有人进行收益分配, 权益登记日、除息日为 2010 年 1 月 20 日, 红利发放日为 2010 年 1 月 21 日, 收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.80 元。

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
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

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国都证券有限责任公司	1,478,053,248.88	6.94%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本期(2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日), 本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国都证券有限责任公司	1,256,339.29	7.04%	1,256,339.29	23.89%

注: 上述佣金按市场佣金率计算, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

##### 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
	2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,451,362.37
其中：支付销售机构的客户维护费	3,894,472.28

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,575,227.09

注：支付基金托管人中国工商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。

#### 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

本期(2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日)，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本报告期(2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日)，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

报告期末(2009年12月31日)，其他关联方未持有本基金。

#### 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	
	2009年3月20日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	298,036,953.76	3,342,288.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本报告期(2009年3月20日(基金合同生效日)至2009年12月31日)，本基金未实施利润分配。

**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	备注
601117	中国化学	2009.12.29	2010.1.7	未上市	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
002329	皇氏乳业	2009.12.25	2010.1.6	未上市	20.10	20.10	500	10,050.00	10,050.00	-
002332	仙锯制药	2009.12.30	2010.1.12	未上市	8.20	8.20	500	4,100.00	4,100.00	-
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	-

**7.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

期末（2009 年 12 月 31 日）本基金未持有流通受限的债券。

**7.4.12.1.3 受限证券类别：其他**

期末（2009 年 12 月 31 日）本基金未持有流通受限的其他证券。

**7.4.12.2 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
600022	济南钢铁	2009.11.9	筹划重大资产重组	5.27	2010.2.24	5.00	1,750,000	8,832,003.19	9,222,500.00	-
600102	莱钢股份	2009.11.9	筹划重大资产重组	13.07	2010.2.24	11.88	926,609	10,331,329.99	12,110,779.63	-
600100	同方股份	2009.12.29	证监会审核公司发行股份购买资产事宜	18.73	2010.1.4	18.70	100	1,524.33	1,873.00	-
600739	辽宁成大	2009.12.28	参股公司拟实施换股重组	38.09	2010.1.11	41.90	99	3,030.28	3,770.91	-
000623	吉林敖东	2009.12.28	参股公司拟实施换股重组	49.19	2010.1.11	54.11	978,648	35,295,823.34	48,139,695.12	-
000709	唐钢股份	2009.12.16	吸收合并	7.09	2010.1.25	6.60	6,139,054	43,582,950.96	43,525,892.86	复牌后更名为河北钢铁

**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**

期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

期末本基金无交易所债券正回购余额。

### **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**

本基金为进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报。

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，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司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，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及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公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司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 workflows、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。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的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%。

#### 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12月31日	6个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	298,036,953.76	-	298,036,953.76
结算备付金	9,068,757.29	-	9,068,757.29
存出保证金	-	3,201,169.11	3,201,169.11
交易性金融资产	-	2,744,136,713.82	2,744,136,713.82
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收证券清算款	-	10,993,242.28	10,993,242.28
应收利息	-	54,605.43	54,605.43
应收股利	-	-	-
应收申购款	29,821.08	3,347,606.10	3,377,427.18
其他资产	-	-	-
资产总计	307,135,532.13	2,761,733,336.74	3,068,868,868.87
负债			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	11,400,018.31	11,400,018.31
应付赎回款	-	9,015,080.98	9,015,080.98
应付管理人报酬	-	3,980,768.83	3,980,768.83
应付托管费	-	663,461.50	663,461.50
应付销售服务费	-	-	-

应付交易费用	-	5,259,320.12	5,259,320.12
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
其他负债	-	133,974.96	133,974.96
负债总计	-	30,452,624.70	30,452,624.70
利率敏感度缺口	307,135,532.13	2,731,280,712.04	3,038,416,244.17

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的比例为 60-95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2009年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,744,136,713.82	90.31
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,744,136,713.82	90.31

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
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)
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 18,929
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 18,929

#### 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	2,744,136,713.82	89.42
	其中: 股票	2,744,136,713.82	89.42
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	307,105,711.05	10.01
6	其他各项资产	17,626,444.00	0.57
	合计	3,068,868,868.87	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	16,791,241.50	0.55
B	采掘业	237,998,335.28	7.83
C	制造业	935,879,605.85	30.80

C0	食品、饮料	121,847,295.53	4.01
C1	纺织、服装、皮毛	12,775,653.28	0.42
C2	木材、家具	7,330,218.00	0.24
C3	造纸、印刷	10,867,023.47	0.36
C4	石油、化学、塑胶、塑料	99,140,773.66	3.26
C5	电子	52,008,092.09	1.71
C6	金属、非金属	321,575,292.61	10.58
C7	机械、设备、仪表	196,384,508.56	6.46
C8	医药、生物制品	107,994,798.99	3.55
C99	其他制造业	5,955,949.66	0.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	79,167,965.35	2.61
E	建筑业	112,491,800.49	3.70
F	交通运输、仓储业	138,048,661.98	4.54
G	信息技术业	81,456,609.54	2.68
H	批发和零售贸易	48,701,685.97	1.60
I	金融、保险业	735,719,148.42	24.21
J	房地产业	240,542,755.46	7.92
K	社会服务业	9,168,955.00	0.30
L	传播与文化产业	12,224,767.07	0.40
M	综合类	95,945,181.91	3.16
	合计	2,744,136,713.82	90.31

### 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	600000	浦发银行	5,398,214	117,087,261.66	3.85
2	601939	建设银行	13,588,459	84,112,561.21	2.77
3	601318	中国平安	1,461,481	80,512,988.29	2.65
4	601988	中国银行	16,866,036	73,029,935.88	2.40
5	601628	中国人寿	2,119,398	67,163,722.62	2.21
6	600036	招商银行	3,548,266	64,046,201.30	2.11
7	600030	中信证券	1,720,587	54,663,048.99	1.80
8	000623	吉林敖东	978,648	48,139,695.12	1.58
9	000686	东北证券	1,243,391	47,708,912.67	1.57
10	600325	华发股份	2,516,053	47,150,833.22	1.55
11	000709	唐钢股份	6,139,054	43,525,892.86	1.43
12	000878	云南铜业	1,363,598	41,739,734.78	1.37
13	000783	长江证券	2,055,698	39,654,414.42	1.31
14	600050	中国联通	4,541,310	33,106,149.90	1.09
15	601001	大同煤业	722,855	32,521,246.45	1.07
16	000933	神火股份	861,904	31,787,019.52	1.05

17	600016	民生银行	3,998,011	31,624,267.01	1.04
18	600307	酒钢宏兴	2,078,934	31,537,428.78	1.04
19	600702	沱牌曲酒	1,844,638	30,565,651.66	1.01
20	601919	中国远洋	2,100,100	29,191,390.00	0.96
21	000043	中航地产	1,891,726	28,621,814.38	0.94
22	600362	江西铜业	711,503	28,609,535.63	0.94
23	600597	光明乳业	2,992,582	28,519,306.46	0.94
24	600052	浙江广厦	3,387,077	28,112,739.10	0.93
25	000100	TCL 集团	5,418,993	27,799,434.09	0.91
26	600015	华夏银行	2,221,487	27,590,868.54	0.91
27	600456	宝钛股份	1,167,063	26,784,095.85	0.88
28	000932	华菱钢铁	3,485,304	26,732,281.68	0.88
29	601006	大秦铁路	2,571,700	26,488,510.00	0.87
30	600875	东方电气	584,849	26,370,841.41	0.87
31	600111	包钢稀土	944,200	25,889,964.00	0.85
32	600348	国阳新能	530,503	25,660,430.11	0.84
33	601333	广深铁路	5,319,877	25,375,813.29	0.84
34	600580	卧龙电气	1,388,922	25,292,269.62	0.83
35	600166	福田汽车	1,324,946	25,240,221.30	0.83
36	600549	厦门钨业	1,313,986	24,873,754.98	0.82
37	600322	天房发展	3,874,100	24,523,053.00	0.81
38	601390	中国中铁	3,890,199	24,508,253.70	0.81
39	000797	中国武夷	3,104,674	24,495,877.86	0.81
40	601601	中国太保	945,600	24,226,272.00	0.80
41	000002	万 科 A	2,236,200	24,173,322.00	0.80
42	600533	栖霞建设	3,396,000	22,787,160.00	0.75
43	600029	南方航空	3,636,843	22,039,268.58	0.73
44	600835	上海机电	1,601,101	21,903,061.68	0.72
45	600653	申华控股	4,899,971	21,853,870.66	0.72
46	000063	中兴通讯	470,641	21,117,661.67	0.70
47	000568	泸州老窖	539,916	21,078,320.64	0.69
48	601857	中国石油	1,417,510	19,589,988.20	0.64
49	600736	苏州高新	2,304,800	19,383,368.00	0.64
50	601666	平煤股份	596,000	19,072,000.00	0.63
51	600827	友谊股份	975,676	18,186,600.64	0.60
52	601168	西部矿业	1,216,638	17,884,578.60	0.59
53	000895	双汇发展	330,300	17,538,930.00	0.58
54	600096	云天化	708,559	17,055,015.13	0.56
55	000625	长安汽车	1,190,000	16,695,700.00	0.55
56	600123	兰花科创	381,280	16,677,187.20	0.55
57	600971	恒源煤电	488,624	16,535,036.16	0.54
58	601898	中煤能源	1,208,033	16,405,088.14	0.54

59	601699	潞安环能	310,000	16,051,800.00	0.53
60	600418	江淮汽车	1,464,510	15,597,031.50	0.51
61	000951	中国重汽	556,400	15,234,232.00	0.50
62	600839	四川长虹	2,285,500	14,992,880.00	0.49
63	601668	中国建筑	3,059,800	14,442,256.00	0.48
64	600383	金地集团	1,025,000	14,227,000.00	0.47
65	600011	华能国际	1,761,112	14,106,507.12	0.46
66	600849	上海医药	976,060	13,664,840.00	0.45
67	600027	华电国际	2,521,035	13,537,957.95	0.45
68	600717	天津港	1,085,788	13,496,344.84	0.44
69	601186	中国铁建	1,460,700	13,350,798.00	0.44
70	000758	中色股份	816,879	12,669,793.29	0.42
71	600428	中远航运	1,198,900	12,648,395.00	0.42
72	000060	中金岭南	445,639	12,433,328.10	0.41
73	000407	胜利股份	1,400,000	12,222,000.00	0.40
74	600102	莱钢股份	926,609	12,110,779.63	0.40
75	600686	金龙汽车	1,085,944	11,912,805.68	0.39
76	000911	南宁糖业	504,914	11,860,429.86	0.39
77	600642	申能股份	1,037,765	11,809,765.70	0.39
78	600665	天地源	1,771,200	11,796,192.00	0.39
79	002133	广宇集团	1,158,745	11,309,351.20	0.37
80	600021	上海电力	1,906,746	11,059,126.80	0.36
81	600872	中炬高新	1,046,762	10,928,195.28	0.36
82	000597	东北制药	409,515	10,782,529.95	0.35
83	000006	深振业 A	938,172	10,629,488.76	0.35
84	600299	蓝星新材	730,175	9,915,776.50	0.33
85	601618	中国中冶	1,824,489	9,888,730.38	0.33
86	000599	青岛双星	1,079,656	9,803,276.48	0.32
87	600058	五矿发展	494,865	9,610,278.30	0.32
88	600837	海通证券	500,000	9,595,000.00	0.32
89	600668	尖峰集团	1,440,486	9,521,612.46	0.31
90	600361	华联综超	992,171	9,495,076.47	0.31
91	600558	大西洋	500,321	9,411,038.01	0.31
92	000589	黔轮胎 A	522,708	9,340,791.96	0.31
93	000616	亿城股份	1,354,952	9,335,619.28	0.31
94	600170	上海建工	602,191	9,309,872.86	0.31
95	600022	济南钢铁	1,750,000	9,222,500.00	0.30
96	600469	风神股份	585,042	9,220,261.92	0.30
97	000608	阳光股份	810,830	9,048,862.80	0.30
98	600652	爱使股份	1,333,363	9,013,533.88	0.30
99	600350	山东高速	1,706,500	8,976,190.00	0.30
100	000078	海王生物	491,200	8,345,488.00	0.27

101	000881	大连国际	946,321	8,091,044.55	0.27
102	000917	电广传媒	440,781	7,942,873.62	0.26
103	600222	太龙药业	768,050	7,534,570.50	0.25
104	600688	S 上石化	680,000	7,459,600.00	0.25
105	600973	宝胜股份	372,400	7,410,760.00	0.24
106	601088	中国神华	211,045	7,348,586.90	0.24
107	600978	宜华木业	943,400	7,330,218.00	0.24
108	600109	国金证券	300,000	7,245,000.00	0.24
109	600153	建发股份	544,795	7,060,543.20	0.23
110	600320	振华重工	676,996	7,000,138.64	0.23
111	600649	城投控股	549,300	6,937,659.00	0.23
112	601588	北辰实业	1,131,700	6,710,981.00	0.22
113	000600	建投能源	947,990	6,569,570.70	0.22
114	000488	晨鸣纸业	746,300	6,388,328.00	0.21
115	600177	雅戈尔	434,722	6,307,816.22	0.21
116	601918	国投新集	347,500	6,237,625.00	0.21
117	600809	山西汾酒	140,000	6,010,200.00	0.20
118	000860	顺鑫农业	329,435	5,821,116.45	0.19
119	000972	新中基	559,435	5,723,020.05	0.19
120	000876	新希望	412,091	5,678,613.98	0.19
121	000983	西山煤电	140,000	5,584,600.00	0.18
122	600782	新钢股份	612,607	5,488,958.72	0.18
123	600508	上海能源	215,200	5,412,280.00	0.18
124	000762	西藏矿业	241,000	5,359,840.00	0.18
125	600210	紫江企业	680,000	5,344,800.00	0.18
126	002148	北纬通信	150,000	5,175,000.00	0.17
127	600416	湘电股份	214,178	5,161,689.80	0.17
128	000973	佛塑股份	568,880	5,125,608.80	0.17
129	600051	宁波联合	399,011	5,031,528.71	0.17
130	600635	大众公用	460,000	4,922,000.00	0.16
131	000725	京东方 A	940,000	4,888,000.00	0.16
132	600026	中海发展	340,000	4,879,000.00	0.16
133	600075	新疆天业	516,000	4,871,040.00	0.16
134	000021	长城开发	377,656	4,867,985.84	0.16
135	600536	中国软件	200,550	4,730,974.50	0.16
136	601328	交通银行	496,900	4,646,015.00	0.15
137	600607	上实医药	198,732	4,457,558.76	0.15
138	600308	华泰股份	309,751	4,376,781.63	0.14
139	000525	红太阳	251,669	4,263,272.86	0.14
140	600078	澄星股份	483,421	4,147,752.18	0.14
141	000679	大连友谊	257,613	4,008,458.28	0.13
142	000990	诚志股份	220,000	3,828,000.00	0.13

143	600263	路桥建设	348,650	3,824,690.50	0.13
144	600470	六国化工	291,900	3,765,510.00	0.12
145	600831	广电网络	421,197	3,727,593.45	0.12
146	000731	四川美丰	385,750	3,587,475.00	0.12
147	600422	昆明制药	336,501	3,573,640.62	0.12
148	600169	太原重工	204,500	3,558,300.00	0.12
149	600864	哈投股份	320,000	3,504,000.00	0.12
150	600622	嘉宝集团	281,934	3,459,330.18	0.11
151	000825	太钢不锈	358,000	3,415,320.00	0.11
152	000909	数源科技	246,697	3,404,418.60	0.11
153	000989	九芝堂	237,600	3,392,928.00	0.11
154	000619	海螺型材	243,820	3,320,828.40	0.11
155	600233	大杨创世	187,300	3,120,418.00	0.10
156	600152	维科精华	414,100	2,973,238.00	0.10
157	000793	华闻传媒	395,200	2,774,304.00	0.09
158	600531	豫光金铅	123,410	2,616,292.00	0.09
159	000528	柳工	116,980	2,541,975.40	0.08
160	601866	中海集运	540,000	2,500,200.00	0.08
161	000733	振华科技	173,800	2,398,440.00	0.08
162	000737	南风化工	378,197	2,352,385.34	0.08
163	000531	穗恒运A	131,100	2,289,006.00	0.08
164	600129	太极集团	176,506	2,280,457.52	0.08
165	600529	山东药玻	140,000	2,091,600.00	0.07
166	000661	长春高新	74,300	1,985,296.00	0.07
167	600999	招商证券	65,000	1,910,350.00	0.06
168	002203	海亮股份	129,100	1,887,442.00	0.06
169	000570	苏常柴A	127,465	1,806,179.05	0.06
170	600596	新安股份	40,000	1,804,400.00	0.06
171	000698	沈阳化工	213,322	1,753,506.84	0.06
172	000539	粤电力A	223,300	1,748,439.00	0.06
173	000680	山推股份	137,000	1,734,420.00	0.06
174	600810	神马实业	109,600	1,385,344.00	0.05
175	600475	华光股份	72,000	1,345,680.00	0.04
176	600121	郑州煤电	104,712	1,334,030.88	0.04
177	600316	洪都航空	40,000	1,332,400.00	0.04
178	000968	煤气化	61,500	1,313,025.00	0.04
179	000009	中国宝安	113,400	1,245,132.00	0.04
180	002261	拓维信息	30,000	1,200,000.00	0.04
181	000636	风华高科	124,500	1,132,950.00	0.04
182	000962	东方钨业	87,222	1,126,908.24	0.04
183	600004	白云机场	105,785	1,073,717.75	0.04
184	600569	安阳钢铁	185,399	1,060,482.28	0.03

185	600893	航空动力	40,000	1,039,600.00	0.03
186	600237	铜峰电子	142,200	1,001,088.00	0.03
187	600482	风帆股份	80,000	958,400.00	0.03
188	600731	湖南海利	111,000	896,880.00	0.03
189	002064	华峰氨纶	40,000	763,200.00	0.03
190	600089	特变电工	30,100	716,380.00	0.02
191	002056	横店东磁	44,600	659,188.00	0.02
192	000729	燕京啤酒	31,209	585,792.93	0.02
193	601169	北京银行	30,000	580,200.00	0.02
194	300027	华谊兄弟	10,000	554,300.00	0.02
195	000039	中集集团	40,400	529,240.00	0.02
196	000960	锡业股份	15,600	481,104.00	0.02
197	002161	远望谷	20,103	439,250.55	0.01
198	600048	保利地产	19,500	436,800.00	0.01
199	600208	新湖中宝	40,000	397,200.00	0.01
200	000728	国元证券	14,900	317,519.00	0.01
201	601899	紫金矿业	30,000	289,200.00	0.01
202	600626	申达股份	35,000	283,500.00	0.01
203	600376	首开股份	14,000	275,520.00	0.01
204	000402	金融街	22,300	270,499.00	0.01
205	600598	北大荒	17,400	265,350.00	0.01
206	600997	开滦股份	10,000	252,100.00	0.01
207	600395	盘江股份	8,000	235,520.00	0.01
208	600675	中华企业	15,000	221,100.00	0.01
209	600020	中原高速	50,334	220,462.92	0.01
210	002003	伟星股份	10,007	213,949.66	0.01
211	000571	新大洲A	30,000	210,600.00	0.01
212	600067	冠城大通	12,300	172,077.00	0.01
213	600888	新疆众和	10,000	157,200.00	0.01
214	600162	香江控股	17,105	150,866.10	0.00
215	601600	中国铝业	10,000	144,700.00	0.00
216	000807	云铝股份	10,000	135,900.00	0.00
217	000996	中国中期	3,300	132,429.00	0.00
218	601299	中国北车	20,000	122,600.00	0.00
219	600707	彩虹股份	10,000	122,300.00	0.00
220	600227	赤天化	10,025	121,703.50	0.00
221	600500	中化国际	10,000	118,700.00	0.00
222	600826	兰生股份	7,000	117,670.00	0.00
223	600104	上海汽车	4,334	113,247.42	0.00
224	600354	敦煌种业	6,100	110,715.00	0.00
225	600966	博汇纸业	9,972	101,913.84	0.00
226	600830	香溢融通	8,500	96,475.00	0.00

227	600987	航民股份	10,014	90,025.86	0.00
228	600158	中体产业	10,000	82,500.00	0.00
229	600150	中国船舶	1,000	77,840.00	0.00
230	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
231	600010	包钢股份	10,000	46,400.00	0.00
232	000027	深圳能源	2,479	33,615.24	0.00
233	600331	宏达股份	1,200	21,696.00	0.00
234	601888	中国国旅	900	18,846.00	0.00
235	300041	回天胶业	500	18,200.00	0.00
236	601808	中海油服	1,000	16,260.00	0.00
237	300032	金龙机电	500	14,900.00	0.00
238	300029	天龙光电	500	14,550.00	0.00
239	002186	全聚德	400	13,804.00	0.00
240	600725	云维股份	513	10,942.29	0.00
241	002329	皇氏乳业	500	10,050.00	0.00
242	600415	小商品城	99	4,428.27	0.00
243	002332	仙琚制药	500	4,100.00	0.00
244	000028	一致药业	139	3,847.52	0.00
245	600739	辽宁成大	99	3,770.91	0.00
246	600685	广船国际	102	2,701.98	0.00
247	601009	南京银行	137	2,650.95	0.00
248	000422	湖北宜化	108	2,305.80	0.00
249	000759	武汉中百	175	2,301.25	0.00
250	002142	宁波银行	112	1,958.88	0.00
251	002073	青岛软控	85	1,908.25	0.00
252	600100	同方股份	100	1,873.00	0.00
253	600664	哈药股份	100	1,847.00	0.00
254	600271	航天信息	91	1,845.48	0.00
255	600755	厦门国贸	116	1,811.92	0.00
256	002047	成霖股份	197	1,798.61	0.00
257	600066	宇通客车	87	1,739.13	0.00
258	600741	华域汽车	139	1,609.62	0.00
259	600138	中青旅	100	1,595.00	0.00
260	600820	隧道股份	110	1,527.90	0.00
261	600028	中国石化	100	1,409.00	0.00
262	600991	广汽长丰	124	1,406.16	0.00
263	000912	泸天化	119	1,256.64	0.00
264	600328	兰太实业	114	1,204.98	0.00
265	600269	赣粤高速	134	1,164.46	0.00
266	600583	海油工程	100	1,140.00	0.00
267	000830	鲁西化工	135	831.60	0.00
268	000652	泰达股份	100	825.00	0.00

269	601989	中国重工	100	781.00	0.00
270	600012	皖通高速	131	778.14	0.00
271	000559	万向钱潮	100	772.00	0.00
272	600797	浙大网新	100	690.00	0.00
273	600396	金山股份	76	661.96	0.00
274	000726	鲁泰A	56	655.20	0.00
275	600033	福建高速	55	363.00	0.00
276	600160	巨化股份	1	9.36	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	354,416,075.44	11.66
2	601318	中国平安	257,349,440.23	8.47
3	600016	民生银行	193,342,851.28	6.36
4	601628	中国人寿	190,419,296.05	6.27
5	600123	兰花科创	181,388,453.24	5.97
6	600050	中国联通	178,227,833.53	5.87
7	601939	建设银行	168,803,555.92	5.56
8	600036	招商银行	167,792,661.88	5.52
9	601857	中国石油	165,203,541.52	5.44
10	600019	宝钢股份	160,863,750.47	5.29
11	600348	国阳新能	138,758,897.25	4.57
12	601988	中国银行	137,498,351.26	4.53
13	000709	唐钢股份	135,074,116.29	4.45
14	000878	云南铜业	133,683,239.24	4.40
15	000060	中金岭南	130,268,950.06	4.29
16	600005	武钢股份	127,147,696.57	4.18
17	600000	浦发银行	126,833,207.38	4.17
18	601601	中国太保	123,925,057.11	4.08
19	601001	大同煤业	116,359,629.75	3.83
20	600052	浙江广厦	115,369,591.74	3.80
21	600325	华发股份	112,942,915.25	3.72
22	601899	紫金矿业	106,948,628.37	3.52
23	000024	招商地产	106,051,650.76	3.49
24	600048	保利地产	105,268,568.30	3.46
25	000002	万科A	101,705,155.47	3.35
26	600739	辽宁成大	100,799,227.57	3.32
27	000063	中兴通讯	99,370,974.24	3.27
28	600383	金地集团	99,053,363.85	3.26

29	000623	吉林敖东	96,557,179.62	3.18
30	002202	金风科技	95,475,375.79	3.14
31	601919	中国远洋	87,175,926.97	2.87
32	601168	西部矿业	85,763,735.68	2.82
33	002024	苏宁电器	83,893,010.06	2.76
34	600028	中国石化	74,255,185.20	2.44
35	600177	雅戈尔	73,675,794.95	2.42
36	000630	铜陵有色	73,502,284.00	2.42
37	000046	泛海建设	68,483,018.80	2.25
38	000898	鞍钢股份	67,989,940.84	2.24
39	600322	天房发展	66,903,794.32	2.20
40	601088	中国神华	66,738,404.41	2.20

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	324,964,748.90	10.70
2	601318	中国平安	198,247,478.64	6.52
3	600123	兰花科创	181,599,624.02	5.98
4	600019	宝钢股份	176,348,281.63	5.80
5	600016	民生银行	171,559,175.95	5.65
6	600050	中国联通	164,497,723.01	5.41
7	600005	武钢股份	145,269,766.01	4.78
8	600348	国阳新能	141,547,618.77	4.66
9	601628	中国人寿	139,318,666.90	4.59
10	000060	中金岭南	131,966,792.99	4.34
11	601857	中国石油	129,776,000.37	4.27
12	600048	保利地产	119,354,401.12	3.93
13	000024	招商地产	112,358,566.97	3.70
14	600739	辽宁成大	111,244,371.50	3.66
15	600036	招商银行	107,582,230.74	3.54
16	601601	中国太保	103,000,741.90	3.39
17	601899	紫金矿业	101,615,478.77	3.34
18	601001	大同煤业	100,475,033.57	3.31
19	000709	唐钢股份	99,875,460.70	3.29
20	601939	建设银行	95,163,400.08	3.13
21	000878	云南铜业	92,218,047.08	3.04
22	002024	苏宁电器	90,718,539.37	2.99
23	000063	中兴通讯	86,897,952.11	2.86
24	000090	深天健	82,857,148.00	2.73
25	002202	金风科技	80,816,116.29	2.66
26	000046	泛海建设	76,987,006.57	2.53

27	600052	浙江广厦	75,611,507.14	2.49
28	000623	吉林敖东	75,396,821.26	2.48
29	601988	中国银行	73,428,556.09	2.42
30	600177	雅戈尔	73,343,295.72	2.41
31	000630	铜陵有色	71,691,099.57	2.36
32	000898	鞍钢股份	71,106,277.44	2.34
33	000002	万科A	69,791,872.54	2.30
34	600383	金地集团	69,545,810.74	2.29
35	601168	西部矿业	68,872,265.35	2.27
36	000667	名流置业	67,519,001.15	2.22
37	600325	华发股份	65,201,299.31	2.15
38	601088	中国神华	62,007,281.94	2.04
39	600028	中国石化	61,911,922.18	2.04
40	000960	锡业股份	61,576,117.13	2.03
41	600887	*ST 伊利	61,545,715.10	2.03
42	600104	上海汽车	61,395,527.68	2.02
43	600550	天威保变	61,068,030.16	2.01
44	600196	复星医药	60,914,488.61	2.00

#### 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	11,703,208,947.26
卖出股票收入（成交）总额	9,678,640,758.07

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

报告期末，本基金未持有债券投资。

#### 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

报告期末，本基金未持有债券投资。

#### 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	3,201,169.11
2	应收证券清算款	10,993,242.28
3	应收股利	-
4	应收利息	54,605.43
5	应收申购款	3,377,427.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	17,626,444.00

**8.9.4 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。

**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	000623	吉林敖东	48,139,695.12	1.58	重组事项停牌

注：“吉林敖东”自 2009 年 12 月 28 日起停牌，2010 年 1 月 11 日上午开市起复牌交易。

**§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 (%)
37,540	62,287.20	806,759,425.67	34.50	1,531,501,959.71	65.50

**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	3,101,600.85	0.13

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 3 月 20 日) 基金份额总额	2,961,222,796.80
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,946,677,753.90
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,569,639,165.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,338,261,385.38

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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

本基金基金合同生效日为 2009 年 3 月 20 日，报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 100,000.00 元，该审计机构第 1 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 (%)	
国信证券股份有限公司	1	5,338,518,782.34	25.07	4,537,727.78	25.42	新增
北京高华证券有限责任公司	2	2,543,175,829.82	11.94	2,106,297.29	11.80	新增
海通证券股份有限公司	2	2,282,358,874.28	10.72	1,883,312.09	10.55	新增
中国国际金融有限公司	1	1,640,710,892.96	7.70	1,394,596.79	7.81	新增
招商证券股份有限公司	2	1,604,303,572.18	7.53	1,333,796.62	7.47	新增
国都证券有限责任公司	1	1,478,053,248.88	6.94	1,256,339.29	7.04	新增
国泰君安证券股份有限公司	2	1,003,782,832.38	4.71	841,915.82	4.72	新增
广发华福证券有限责任公司	1	954,015,722.92	4.48	775,141.88	4.34	新增
广发证券股份有限公司	1	925,403,534.14	4.35	751,894.59	4.21	新增
长城证券有限责任公司	1	869,913,380.99	4.08	739,419.69	4.14	新增
兴业证券股份有限公司	1	853,192,207.93	4.01	725,212.89	4.06	新增

申银万国证券股份有限公司	1	774,113,591.32	3.63	657,992.98	3.69	新增
中信证券股份有限公司	2	652,899,046.18	3.07	530,483.50	2.97	新增
中国建银投资证券有限责任公司	1	322,298,803.95	1.51	273,952.63	1.53	新增
国金证券股份有限公司	1	53,375,138.72	0.25	43,367.92	0.24	新增
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中国银河证券股份有限公司	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

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
国信证券股份有限公司	198,588.00	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	关于增加万联证券和国金证券为嘉实量化阿尔法股票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2月14日
2	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
3	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
4	关于增加深圳发展银行为嘉实量化阿尔法股票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2月20日
5	关于增加中国农业银行、浦发银行、南京银行为嘉实量化阿尔法股票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2月23日

6	关于增加光大银行为嘉实量化阿尔法股票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 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	关于增加民生银行及东莞银行为嘉实量化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 2 月 28 日
9	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
10	嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 3 月 21 日
11	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
12	关于嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 4 月 30 日
13	关于增加宏源证券为嘉实量化阿尔法股票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 5 月 4 日
14	关于嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金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 4 日
15	关于嘉实量化阿尔法股票基金参加交通银行基金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 5 月 4 日
16	关于嘉实量化阿尔法股票基金参加建设银行基金定投和网上及电话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 4 日
17	关于嘉实量化阿尔法股票基金参加中国农业银行开办的基金定投及其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 5 日
18	关于嘉实量化阿尔法股票基金通过中国银行开办定投业务并参加定投及网上银行费率优惠的公告	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
19	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
20	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
21	嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金开放日常基金转换业务公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 14 日
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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

27	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
28	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
29	关于光大银行调整嘉实多元债券和嘉实量化阿尔法股票定投业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月10日
30	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
31	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
32	关于嘉实量化阿尔法股票参加中国工商银行开展的基金定投及其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月23日
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	关于增加上海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14日
43	关于增加上海农商银行作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
44	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
45	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
46	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
47	关于增加英大证券和东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10月19日
48	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

49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	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
55	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
56	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
57	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) 中国证监会核准嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实量化阿尔法股票型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**