

嘉实债券开放式证券投资基金 2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 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 8 月 26 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。本半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 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	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.....	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.....	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11

6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	31
7.6 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.....	32
7.7 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.....	32
7.8 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.....	32
7.9 投资组合报告附注.....	32
§8 基金份额持有人信息.....	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	33
§9 开放式基金份额变动.....	33
§10 重大事件揭示.....	33
10.1 基金份额持有人大会决议.....	33
10.2 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.....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	34
10.4 基金投资策略的改变.....	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 其他重大事件.....	35

§11 备查文件目录	36
11.1 备查文件目录	36
11.2 存放地点	36
11.3 查阅方式	36

§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	1,568,329,371.36 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
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层 嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本报告期（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	45,129,868.20
本期利润	46,971,922.47
加权平均基金份额本期利润	0.0381
本期加权平均净值利润率	2.95%
本期基金份额净值增长率	3.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2010 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	193,290,572.86
期末可供分配基金份额利润	0.1232
期末基金资产净值	2,050,477,284.66
期末基金份额净值	1.307
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2010 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	88.85%

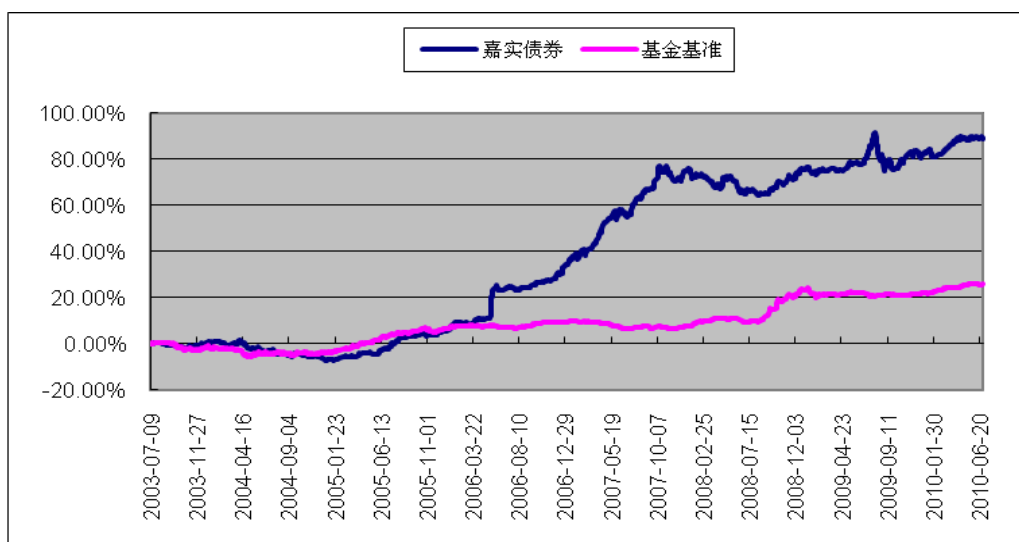
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.23%	0.14%	-0.04%	0.10%	-0.19%	0.04%
过去三个月	0.85%	0.19%	1.43%	0.08%	-0.58%	0.11%
过去六个月	3.48%	0.19%	3.42%	0.07%	0.06%	0.12%
过去一年	5.92%	0.39%	3.42%	0.06%	2.50%	0.33%
过去三年	21.13%	0.34%	18.35%	0.14%	2.78%	0.20%
自基金合同生效起至今	88.85%	0.35%	25.98%	0.20%	62.87%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图：嘉实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2010年6月30日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第三部分（四、（一）投资范围和（四）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%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2010年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式基金、18只开放式基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票。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 基金经理及基金经理助理简介

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	本基金基金经理，公司固定收益部总监	2008 年 4 月 11 日	—	17 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、嘉实多元债券基金经理。经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内，嘉实债券基金份额净值增长率为 3.48%，投资风格相似的嘉实多元债券 A 基金份额净值增长率为 3.40%、嘉实多元债券 B 基金份额净值增长率为 3.22%，某债券组合份额净值增长率为-0.23%。

主要原因：在大类资产配置上，嘉实债券与嘉实多元债券在年初均主动降低了权益类资产的配置比重，受到股票市场大幅下跌的影响较小；同时上述两基金通过参与新股网下申购及个股增发获取了较好的低风险回报。而某债券组合受合同约束，其权益类资产主要集中于可转换债券及转股个股，而转债的流动性较差，可选品种少，大资金交易的冲击成本高，从而造成该组合难以有效降低权益类资产的配置比例，在股票市场的大幅下跌中受到了较大的负面冲击；同时，由于

合同限制，该组合无法参与新股网下申购及个股增发，未能获取股票一级市场的低风险收益。以上原因导致嘉实债券、嘉实多元债券与某债券组合业绩的差异。

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

报告期内，宏观经济形势较为复杂。年初经济处于高位运行，资产价格攀升，通胀预期抬头，从而引发经济刺激政策的逐步退出以及一系列遏制经济过热措施的出台，包括三次上调存款准备金率，出台房地产行业调控政策等，伴随着欧洲债务危机以及对全球经济的看淡，二季度经济增速显著放缓，GDP 从年初的 11.9% 回落到二季度 10.3%，工业增加值从 18.1% 回落到 13.7%。政策基调转到保持宏观经济政策的连续性和稳定性，着力推进经济结构调整和发展方式转变的轨道上来。

报告期内，债券市场收益率震荡下行，收益率曲线平坦化。年初，债市在央票利率和准备金率上调的作用下，收益率小幅上行；随即，由于紧缩政策出台、欧元区危机加深和债券供不应求，带动收益率全线下行；但随存款准备金率连续上调、三年期央票重启和新增外汇占款骤降等多重因素的叠加作用，资金面终于逆转并实现从量到价的转变，资金成本的快速走高导致现券市场在二季度冲高回落，出现阶段机会。

报告期内，股市出现大幅调整，本基金坚持谨慎的权益投资策略，但参与的新股 IPO 有部分跌破发行价，对组合净值产生负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为 1.307 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.48%，同期业绩比较基准收益率为 3.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从基本面看，经济增速将有所放缓，但出现二次探底的可能性较小，CPI 依旧存在不确定因素。从政策面看，决策层多次强调经济运行面临的困难和挑战。保增长，调结构，管理通胀预期依然是最重要的政策目标。基于以上分析，我们认为下半年的债券市场将进入一个持续的震荡整理期，收益率中枢将缓慢上抬。主要理由：一是资金成本的高企抑制债券收益率持续下行；二是，M1、M2 增速同比将继续回落，汇改在短期内难以带来资金流入，流动性不容乐观；三是债券供给逐步加大，供过于求将抑制债券的上涨空间。因此，在政策明朗化之前，我们将依旧维持相对谨慎的投资策略，注重防范利率风险，同时把握短期内的交易型机会。权益类资产投

资方面，我们将关注市场波动带来的机会，有选择性地进行了新股申购，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同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。基金经理兼任估值委员，参加估值专业委员会会议，不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本报告 3.1.1 “本期已实现收益”为 45,129,868.20 元、“本期利润”46,971,922.47 元，以及本基金基金合同（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；年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成”，报告期内本基金未实施收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实债券证券投资基金（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据核对无误。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

报告截止日：2010年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资产			
银行存款	6.4.7.1	43,682,283.14	24,555,930.64
结算备付金		12,292,873.70	18,286,842.26
存出保证金		356,355.86	459,208.96
交易性金融资产	6.4.7.2	1,908,093,656.29	1,510,580,787.96
其中：股票投资		93,000,319.29	207,088,289.96
基金投资		-	-
债券投资		1,815,093,337.00	1,303,492,498.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		94,654,697.23	-
应收利息	6.4.7.5	29,849,033.68	19,504,603.83
应收股利		-	-
应收申购款		2,346,800.93	1,472,975.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,091,275,700.83	1,574,860,348.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
负债			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	120,000,000.00
应付证券清算款		31,557,664.88	21,772,583.11
应付赎回款		5,275,616.66	4,137,964.44
应付管理人报酬		984,847.09	733,966.13
应付托管费		328,282.35	244,655.36
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	406,824.42	177,543.02
应交税费		1,910,613.42	1,848,577.32
应付利息		-	735.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	334,567.35	329,754.47
负债合计		40,798,416.17	149,245,779.62
所有者权益			
实收基金	6.4.7.9	1,568,329,371.36	1,128,730,824.66
未分配利润	6.4.7.10	482,147,913.30	296,883,744.70
所有者权益合计		2,050,477,284.66	1,425,614,569.36
负债和所有者权益总计		2,091,275,700.83	1,574,860,348.98

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.307 元，基金份额总额 1,568,329,371.36 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入		55,854,778.54	39,333,457.05
1.利息收入		24,957,192.00	39,431,446.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	372,134.08	341,740.67
债券利息收入		24,585,057.92	39,089,705.39
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		28,817,074.87	94,453,600.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	28,510,329.11	-812,078.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	100,931.58	95,265,679.30
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	205,814.18	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	1,842,054.27	-95,439,134.65
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	238,457.40	887,544.80
减：二、费用		8,882,856.07	10,894,225.40
1. 管理人报酬		4,736,426.91	6,728,528.96
2. 托管费		1,578,808.96	2,242,842.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	740,779.13	449,418.80

5. 利息支出		1,733,699.56	1,351,776.53
其中: 卖出回购金融资产支出		1,733,699.56	1,351,776.53
6. 其他费用	6.4.7.19	93,141.51	121,658.18
三、利润总额		46,971,922.47	28,439,231.65
减: 所得税费用		-	-
四、净利润		46,971,922.47	28,439,231.65

6.3 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: 2010年1月1日至2010年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,128,730,824.66	296,883,744.70	1,425,614,569.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,971,922.47	46,971,922.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	439,598,546.70	138,292,246.13	577,890,792.83
其中: 1.基金申购款	821,316,783.55	246,300,378.64	1,067,617,162.19
2.基金赎回款	-381,718,236.85	-108,008,132.51	-489,726,369.36
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）	1,568,329,371.36	482,147,913.30	2,050,477,284.66
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	28,439,231.65	28,439,231.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,015,758,156.44	-227,630,766.61	-1,243,388,923.05
其中: 1.基金申购款	393,915,331.97	89,498,743.07	483,414,075.04
2.基金赎回款	-1,409,673,488.41	-317,129,509.68	-1,726,802,998.09
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）	1,430,951,318.03	335,354,152.66	1,766,305,470.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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。

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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》、《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>》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 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2010年6月30日的财务状况以及2010年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

报告期内，本基金不存在重大会计差错事项。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	43,682,283.14
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	43,682,283.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		85,522,361.63	93,000,319.29	7,477,957.66
债券	交易所市场	854,590,479.43	869,652,337.00	15,061,857.57
	银行间市场	943,972,474.79	945,441,000.00	1,468,525.21
	合计	1,798,562,954.22	1,815,093,337.00	16,530,382.78
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,884,085,315.85	1,908,093,656.29	24,008,340.44

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2010年6月30日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2010年6月30日）本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2010年6月30日）本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	9,943.14
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	3,872.25
应收债券利息	29,834,583.59
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	634.70
其他	-
合计	29,849,033.68

6.4.7.6 其他资产

本期末（2010年6月30日）本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	397,538.45
银行间市场应付交易费用	9,285.97
合计	406,824.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	5,226.00
预提费用	79,341.35
其他应付款	-
合计	334,567.35

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,128,730,824.66	1,128,730,824.66
本期申购	821,316,783.55	821,316,783.55
本期赎回	-381,718,236.85	-381,718,236.85
本期末	1,568,329,371.36	1,568,329,371.36

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	99,875,851.04	197,007,893.66	296,883,744.70
本期利润	45,129,868.20	1,842,054.27	46,971,922.47
本期基金份额交易产生的变动数	48,284,853.62	90,007,392.51	138,292,246.13
其中：基金申购款	84,497,583.65	161,802,794.99	246,300,378.64
基金赎回款	-36,212,730.03	-71,795,402.48	-108,008,132.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,290,572.86	288,857,340.44	482,147,913.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
活期存款利息收入	278,622.25

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	77,960.83
其他	15,551.00
合计	372,134.08

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出股票成交总额	328,013,917.89
卖出股票成本总额	299,503,588.78
买卖股票差价收入	28,510,329.11

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交金额	1,442,001,722.28
卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	1,429,762,824.52
应收利息总额	12,137,966.18
债券投资收益	100,931.58

6.4.7.14 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	205,814.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	205,814.18

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
1.交易性金融资产	1,842,054.27
——股票投资	-5,999,226.64
——债券投资	7,841,280.91
——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	1,842,054.27
----	--------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
基金赎回费收入	156,843.41
基金转换费收入	77,354.94
印花税手续费返还收入	-
其他	4,259.05
合计	238,457.40

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
交易所市场交易费用	725,404.13
银行间市场交易费用	15,375.00
合计	740,779.13

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
信息披露费	44,629.17
审计费用	34,712.18
债券托管账户维护费	4,500.00
银行汇划费用	9,300.16
其他	-
合计	93,141.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金不存在资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方，未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期、上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,736,426.91	6,728,528.96
其中：支付销售机构的客户维护费	261,778.89	468,496.47

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,578,808.96	2,242,842.93

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。

6.4.10.3 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						
2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	20,549,078.63	226,523,524.49	-	-	2,540,681,000.00	456,657.27
上年度可比期间						
2009年1月1日至2009年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	264,488,128.09	1,195,939,982.70	-	-	661,333,000.00	17,302.67

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
	基金合同生效日(2003年7月9日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	34,122,230.69	34,122,230.69	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	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	2.18%	2.18%	2.38%	2.38%

注：(1) 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。(2) 基金管理人于 2007 年 2 月 5 日通过本系列基金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。

6.4.10.4.2 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

本期末（2010 年 6 月 30 日）、上年度末（2009 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	43,682,283.14	278,622.25	59,110,457.99	261,728.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

报告期内，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 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
601000	唐山港	2010-06-22	2010-07-05	未上市	8.20	8.20	2,000	16,400.00	16,400.00	-
002383	合众思壮	2010-03-26	2010-07-02	IPO 网下 锁定 3 个月	37.00	48.45	41,124	1,521,588.00	1,992,457.80	-
002387	黑牛食品	2010-04-02	2010-07-13	IPO 网下	27.00	36.96	39,386	1,063,422.00	1,455,706.56	-

				锁定 3 个月						
002388	新亚制程	2010-04-02	2010-07-13	IPO 网下 锁定 3 个月	15.00	30.92	42,464	636,960.00	1,312,986.88	-
002392	北京利尔	2010-04-15	2010-07-23	IPO 网下 锁定 3 个月	42.00	36.38	71,204	2,990,568.00	2,590,401.52	-
002399	海普瑞	2010-04-28	2010-08-06	IPO 网下 锁定 3 个月	148.00	117.03	15,376	2,275,648.00	1,799,453.28	-
002401	交技发展	2010-04-28	2010-08-06	IPO 网下 锁定 3 个月	26.40	35.17	18,927	499,672.80	665,662.59	-
002402	和而泰	2010-04-30	2010-08-11	IPO 网下 锁定 3 个月	35.00	32.80	14,375	503,125.00	471,500.00	-
002403	爱仕达	2010-04-30	2010-08-11	IPO 网下 锁定 3 个月	18.80	16.16	17,488	328,774.40	282,606.08	-
002405	四维图新	2010-05-06	2010-08-18	IPO 网下 锁定 3 个月	25.60	33.18	67,838	1,736,652.80	2,250,864.84	-
002410	广联达	2010-05-13	2010-08-25	IPO 网下 锁定 3 个月	58.00	52.15	50,833	2,948,314.00	2,650,940.95	-
002412	汉森制药	2010-05-13	2010-08-25	IPO 网下 锁定 3 个月	35.80	32.50	30,052	1,075,861.60	976,690.00	-
002419	天虹商场	2010-05-21	2010-09-01	IPO 网下 锁定 3 个月	40.00	34.19	210,987	8,439,480.00	7,213,645.53	-
002431	棕榈园林	2010-06-02	2010-09-10	IPO 网下 锁定 3 个月	45.00	54.89	82,455	3,710,475.00	4,525,954.95	-
002432	九安医疗	2010-06-02	2010-09-10	IPO 网下 锁定 3 个月	19.38	23.06	73,232	1,419,236.16	1,688,729.92	-
002436	兴森科技	2010-06-04	2010-09-20	IPO 网下 锁定 3 个月	36.50	30.60	146,160	5,334,840.00	4,472,496.00	-
002439	启明星辰	2010-06-09	2010-09-27	IPO 网下 锁定 3 个月	25.00	36.41	114,942	2,873,550.00	4,185,038.22	-
002441	众业达	2010-06-25	2010-10-08	IPO 网下 锁定 3 个月	39.90	39.90	112,358	4,483,084.20	4,483,084.20	-
300069	金利华电	2010-04-12	2010-07-21	IPO 网下 锁定 3 个月	23.90	25.73	28,153	672,856.70	724,376.69	-
300073	当升科技	2010-04-16	2010-07-27	IPO 网下 锁定 3 个月	36.00	58.75	33,955	1,222,380.00	1,994,856.25	-
300074	华平股份	2010-04-16	2010-07-27	IPO 网下 锁定 3 个月	72.00	63.41	24,953	1,796,616.00	1,582,269.73	-

300075	数字政通	2010-04-16	2010-07-27	IPO 网下 锁定 3 个月	54.00	47.65	28,000	1,512,000.00	1,334,200.00	-
300077	国民技术	2010-04-23	2010-08-02	IPO 网下 锁定 3 个月	87.50	116.75	23,003	2,012,762.50	2,685,600.25	-
300078	中瑞思创	2010-04-23	2010-07-30	IPO 网下 锁定 3 个月	58.00	69.88	20,380	1,182,040.00	1,424,154.40	-
300082	奥克股份	2010-05-10	2010-08-20	IPO 网下 锁定 3 个月	85.00	67.55	28,198	2,396,830.00	1,904,774.90	-
300084	海默科技	2010-05-10	2010-08-20	IPO 网下 锁定 3 个月	33.00	27.19	39,613	1,307,229.00	1,077,077.47	-
300086	康芝药业	2010-05-17	2010-08-26	IPO 网下 锁定 3 个月	60.00	52.52	64,683	3,880,980.00	3,397,151.16	-
300089	长城集团	2010-06-18	2010-09-27	IPO 网下 锁定 3 个月	20.50	19.78	142,045	2,911,922.50	2,809,650.10	-
300092	科新机电	2010-06-30	2010-07-08	未上市	16.00	16.00	500	8,000.00	8,000.00	-
300094	国联水产	2010-06-30	2010-10-08	IPO 网下 锁定 3 个月	14.38	14.38	439,938	6,326,308.44	6,326,308.44	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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	期末成本总额	期末估值总额	备注
122908	10 苏交通	2010-06-03	2010-07-30	未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

期末（2010 年 6 月 30 日）本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

期末本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日

A-1	129,991,000	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	129,991,000	0.00

注：短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。以上按短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。

6.4.13.2.2 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 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
AAA	213,234,888.00	0.00
AAA 以下	605,056,458.00	413,867,938.80
未评级	0.00	0.00
合计	818,291,346.00	413,867,938.80

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。

6.4.13.3 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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 2010年6月30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	43,682,283.14	-	-	-	-	-	43,682,283.14
结算备付金	12,292,873.70	-	-	-	-	-	12,292,873.70
存出保证金	-	-	-	-	-	356,355.86	356,355.86
交易性金融资产	109,527,000.00	-	231,381,000.00	898,625,689.10	575,559,647.90	93,000,319.29	1,908,093,656.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	94,654,697.23	94,654,697.23
应收利息	-	-	-	-	-	29,849,033.68	29,849,033.68
应收申购款	144,117.43	-	-	-	-	2,202,683.50	2,346,800.93
资产总计	165,646,274.27	-	231,381,000.00	898,625,689.10	575,559,647.90	220,063,089.56	2,091,275,700.83
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	31,557,664.88	31,557,664.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,275,616.66	5,275,616.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	984,847.09	984,847.09
应付托管费	-	-	-	-	-	328,282.35	328,282.35
应付交易费用	-	-	-	-	-	406,824.42	406,824.42
应付税费	-	-	-	-	-	1,910,613.42	1,910,613.42
其他负债	-	-	-	-	-	334,567.35	334,567.35
负债总计	-	-	-	-	-	40,798,416.17	40,798,416.17
利率敏感度缺口	165,646,274.27	-	231,381,000.00	898,625,689.10	575,559,647.90	179,264,673.39	2,050,477,284.66
上年度末 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
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	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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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(2010年6月30日)	上年度末(2009年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	1,487.02	558.02
市场利率上升 25 个基点	-1,487.02	-558.02	

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 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 2010 年 6 月 30 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(2010年6月30日)		上年度末(2009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	93,000,319.29	4.54	207,088,289.96	14.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	93,000,319.29	4.54	207,088,289.96	14.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

2010 年 6 月 30 日,股票等权益类资产占基金资产净值的比例为 4.54% (2009 年 12 月 31 日: 14.53%),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。

6.4.13.4.4 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项：无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	93,000,319.29	4.45
	其中：股票	93,000,319.29	4.45
2	固定收益投资	1,815,093,337.00	86.79
	其中：债券	1,815,093,337.00	86.79
	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	55,975,156.84	2.68
6	其他资产	127,206,887.70	6.08
	合计	2,091,275,700.83	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,326,308.44	0.31
B	采掘业	5,226,277.47	0.25
C	制造业	37,722,570.45	1.84
C0	食品、饮料	1,953,866.56	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,416,294.90	0.12
C5	电子	11,679,594.83	0.57
C6	金属、非金属	9,394,005.11	0.46
C7	机械、设备、仪表	5,166,514.61	0.25
C8	医药、生物制品	6,434,294.44	0.31
C99	其他制造业	678,000.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,525,954.95	0.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	27,486,078.25	1.34
H	批发和零售贸易	11,696,729.73	0.57

I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	16,400.00	0.00
	合计	93,000,319.29	4.54

7.3 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	002419	天虹商场	210,987	7,213,645.53	0.35
2	300094	国联水产	439,938	6,326,308.44	0.31
3	300059	东方财富	90,000	4,872,600.00	0.24
4	002431	棕榈园林	82,455	4,525,954.95	0.22
5	002441	众业达	112,358	4,483,084.20	0.22
6	002436	兴森科技	146,160	4,472,496.00	0.22
7	002439	启明星辰	114,942	4,185,038.22	0.20
8	300086	康芝药业	64,683	3,397,151.16	0.17
9	002353	杰瑞股份	40,000	3,146,000.00	0.15
10	300089	长城集团	142,045	2,809,650.10	0.14
11	300077	国民技术	23,003	2,685,600.25	0.13
12	002410	广联达	50,833	2,650,940.95	0.13
13	002392	北京利尔	71,204	2,590,401.52	0.13
14	300050	世纪鼎利	16,000	2,320,000.00	0.11
15	002405	四维图新	67,838	2,250,864.84	0.11
16	002368	太极股份	62,593	2,228,310.80	0.11
17	300073	当升科技	33,955	1,994,856.25	0.10
18	002383	合众思壮	41,124	1,992,457.80	0.10
19	300082	奥克股份	28,198	1,904,774.90	0.09
20	002399	海普瑞	15,376	1,799,453.28	0.09
21	002432	九安医疗	73,232	1,688,729.92	0.08
22	002362	汉王科技	15,000	1,666,500.00	0.08
23	300074	华平股份	24,953	1,582,269.73	0.08
24	002387	黑牛食品	39,386	1,455,706.56	0.07
25	300078	中瑞思创	20,380	1,424,154.40	0.07
26	300048	合康变频	36,000	1,350,000.00	0.07
27	300075	数字政通	28,000	1,334,200.00	0.07
28	002388	新亚制程	42,464	1,312,986.88	0.06
29	002371	七星电子	28,185	1,312,857.30	0.06
30	300065	海兰信	29,514	1,103,233.32	0.05
31	300084	海默科技	39,613	1,077,077.47	0.05
32	002340	格林美	20,000	1,003,200.00	0.05

33	002412	汉森制药	30,052	976,690.00	0.05
34	002374	丽鹏股份	33,333	883,991.16	0.04
35	300064	豫金刚石	45,000	832,500.00	0.04
36	300069	金利华电	28,153	724,376.69	0.04
37	002345	潮宏基	20,000	678,000.00	0.03
38	002401	交技发展	18,927	665,662.59	0.03
39	002339	积成电子	20,000	634,000.00	0.03
40	000559	万向钱潮	60,000	621,600.00	0.03
41	002341	新纶科技	16,000	511,520.00	0.02
42	002329	皇氏乳业	20,800	498,160.00	0.02
43	002402	和而泰	14,375	471,500.00	0.02
44	002338	奥普光电	11,600	357,048.00	0.02
45	002367	康力电梯	15,000	303,300.00	0.01
46	002403	爱仕达	17,488	282,606.08	0.01
47	002349	精华制药	10,000	261,000.00	0.01
48	300040	九洲电气	5,000	91,800.00	0.00
49	002350	北京科锐	1,000	21,660.00	0.00
50	601000	唐山港	2,000	16,400.00	0.00
51	300092	科新机电	500	8,000.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

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	000559	万向钱潮	41,853,475.22	2.94
2	600227	赤天化	35,100,709.41	2.46
3	002419	天虹商场	8,439,480.00	0.59
4	300094	国联水产	6,326,308.44	0.44
5	002436	兴森科技	5,334,840.00	0.37
6	300059	东方财富	4,784,422.58	0.34
7	300050	世纪鼎利	4,624,048.00	0.32
8	002441	众业达	4,483,084.20	0.31
9	600352	浙江龙盛	4,417,419.71	0.31
10	300086	康芝药业	3,880,980.00	0.27
11	002431	棕榈园林	3,710,475.00	0.26
12	300048	合康变频	3,311,128.80	0.23
13	002353	杰瑞股份	3,242,809.50	0.23
14	002392	北京利尔	2,990,568.00	0.21
15	002410	广联达	2,948,314.00	0.21
16	300089	长城集团	2,911,922.50	0.20
17	002439	启明星辰	2,873,550.00	0.20

18	002362	汉王科技	2,707,284.70	0.19
19	002337	赛象科技	2,559,608.00	0.18
20	002367	康力电梯	2,424,772.50	0.17

7.4.2 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	600971	恒源煤电	75,597,545.20	5.30
2	000559	万向钱潮	48,024,316.63	3.37
3	600227	赤天化	38,211,809.66	2.68
4	600312	平高电气	20,865,482.17	1.46
5	002154	报喜鸟	14,678,059.74	1.03
6	601668	中国建筑	11,407,741.82	0.80
7	002362	汉王科技	7,201,127.21	0.51
8	601788	光大证券	6,332,605.67	0.44
9	300039	上海凯宝	5,803,555.50	0.41
10	300050	世纪鼎利	4,634,775.00	0.33
11	300033	同花顺	4,398,502.69	0.31
12	600352	浙江龙盛	4,052,838.02	0.28
13	002304	洋河股份	3,616,697.53	0.25
14	300003	乐普医疗	3,393,461.50	0.24
15	002309	中利科技	3,083,104.40	0.22
16	300040	九洲电气	3,076,854.05	0.22
17	300048	合康变频	2,892,182.00	0.20
18	002337	赛象科技	2,708,264.00	0.19
19	300027	华谊兄弟	2,419,504.60	0.17
20	601888	中国国旅	2,398,735.00	0.17

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	191,414,844.75
卖出股票收入（成交）总额	328,013,917.89

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	455,262,781.30	22.20
2	央行票据	461,042,000.00	22.48
3	金融债券	62,497,000.00	3.05
	其中：政策性金融债	62,497,000.00	3.05
4	企业债券	706,300,345.90	34.45

5	企业短期融资券	129,991,000.00	6.34
6	可转债	209.80	0.00
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
合计		1,815,093,337.00	88.52

7.6 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	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1001037	10 央行票据 37	2,000,000	200,160,000.00	9.76
2	010203	02 国债(3)	1,518,200	152,806,830.00	7.45
3	122049	10 营口港	1,121,110	117,716,550.00	5.74
4	122964	09 龙湖债	1,092,710	116,155,073.00	5.66
5	1001031	10 央行票据 31	1,100,000	109,527,000.00	5.34

7.7 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。

7.8 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

期末本基金未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名股票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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	356,355.86
2	应收证券清算款	94,654,697.23
3	应收股利	-
4	应收利息	29,849,033.68
5	应收申购款	2,346,800.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		127,206,887.70

7.9.4 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。

7.9.5 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	002419	天虹商场	7,213,645.53	0.35	IPO 网下锁定 3 个月
2	300094	国联水产	6,326,308.44	0.31	IPO 网下锁定 3 个月
3	002431	棕榈园林	4,525,954.95	0.22	IPO 网下锁定 3 个月
4	002441	众业达	4,483,084.20	0.22	IPO 网下锁定 3 个月
5	002436	兴森科技	4,472,496.00	0.22	IPO 网下锁定 3 个月
6	002439	启明星辰	4,185,038.22	0.20	IPO 网下锁定 3 个月
7	300086	康芝药业	3,397,151.16	0.17	IPO 网下锁定 3 个月
8	300089	长城集团	2,809,650.10	0.14	IPO 网下锁定 3 个月

§8 基金份额持有人信息

8.1 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 (%)
38,751	40,471.97	757,879,778.63	48.32	810,449,592.73	51.68

8.2 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	2,650,390.83	0.1690

§9 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	1,128,730,824.66
报告期期间基金总申购份额	821,316,783.55
报告期期间基金总赎回份额	381,718,236.85
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,568,329,371.36

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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，会计师事务所为安永华明会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	160,699,708.66	48.99	189,795.88	58.05	-
华泰联合证券有限责任公司	1	167,314,209.23	51.01	137,171.00	41.95	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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

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(%)
中信证券股份有限公司	843,352,788.07	97.17
华泰联合证券有限责任公司	24,540,945.22	2.83

(2) 债券回购交易

金额单位：人民币元

券商名称	回购交易	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	12,671,400,000.00	100.00

(3) 权证交易：无

10.8 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	关于旗下开放式基金通过浙商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	2010年1月4日
2	关于通过浦发银行电子渠道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	2010年1月8日
3	关于旗下开放式基金通过上海农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	2010年1月18日
4	关于开通直销网上交易赎回转认购/申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年1月27日
5	关于旗下基金参加江苏银行开办的基金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	2010年2月1日
6	关于暂停向深圳证券交易所发送旗下开放式基金净值数据的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年2月26日
7	关于成立广州分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月3日
8	关于旗下开放式基金通过江海证券和第一创业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	2010年3月10日
9	关于调整旗下部分开放式基金转换费用的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月13日
10	关于直销网上交易赎回转申购业务有关申购费率统一优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年3月17日
11	关于调整旗下开放式基金在浦发银行定投起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年4月9日
12	关于旗下开放式基金通过爱建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	2010年4月16日
13	关于增加乌鲁木齐市商业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	2010年4月20日
14	关于对兴业银行借记卡持有人开通嘉实直销网上交易定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年4月21日
15	关于旗下开放式基金通过乌鲁木齐市商业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	2010年4月23日
16	关于增加渤海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	2010年4月27日
17	关于增加华融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	2010年5月5日
18	关于增加中国光大银行为嘉实旗下基金代	中国证券报、上海证券报、证	2010年5月

	销机构并开展定投业务的公告	券时报、管理人网站	6 日
19	关于增加上海农商银行和洛阳银行为嘉实旗下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	2010 年 5 月 24 日
20	关于旗下开放式基金通过华融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	2010 年 5 月 28 日
21	关于旗下开放式基金通过信达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	2010 年 6 月 3 日
22	关于旗下开放式基金通过洛阳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	2010 年 6 月 8 日
23	关于旗下开放式基金通过申银万国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	2010 年 6 月 24 日

§11 备查文件目录

11.1 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》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式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招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式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) 报告期内嘉实债券开放式证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 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8月26日