

# 嘉实稳健开放式证券投资基金

## 2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 28 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 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 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	15

<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
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 .....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	36
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 .....	37
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 .....	37
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 .....	37
7.9 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
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 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
11.1 备查文件目录 .....	44
11.2 存放地点 .....	44
11.3 查阅方式 .....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,205,826,591.06 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5% 左右。
业绩比较基准	巨潮 200（大盘）指数
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594855
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	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	100818
法定代表人		安奎	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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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	报告期(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-113,399,672.14
本期利润	366,374,737.05
加权平均基金份额本期利润	0.0273
本期加权平均净值利润率	3.55%
本期基金份额净值增长率	3.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	2,158,551,697.87
期末可供分配基金份额利润	0.1635
期末基金资产净值	10,090,134,189.37
期末基金份额净值	0.764
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	181.89%

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

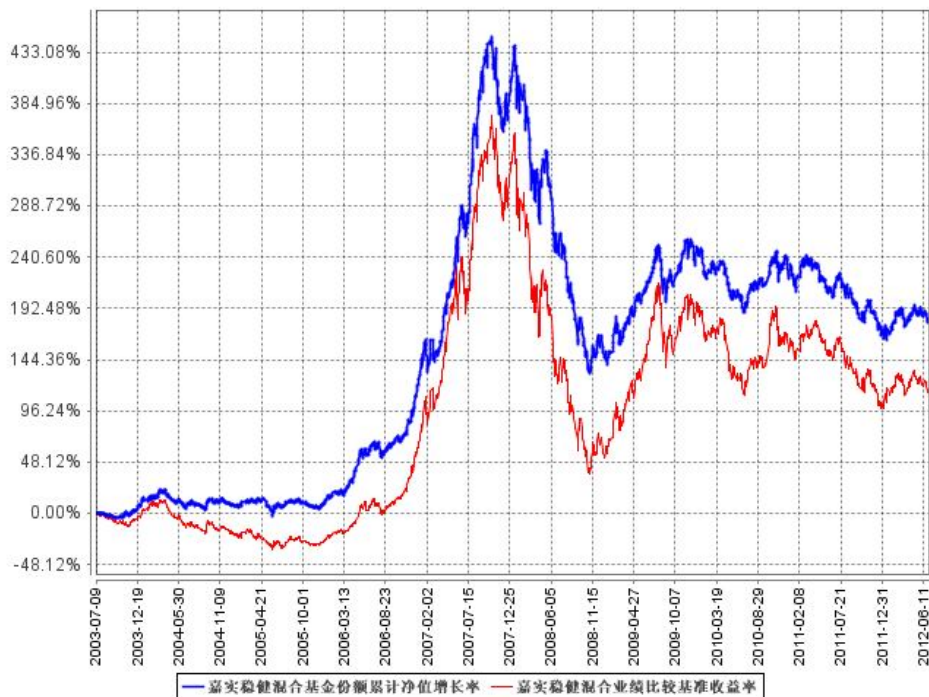
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.78%	0.69%	-4.70%	1.06%	0.92%	-0.37%
过去三个月	2.00%	0.73%	1.85%	1.09%	0.15%	-0.36%
过去六个月	3.52%	0.95%	6.75%	1.28%	-3.23%	-0.33%
过去一年	-10.54%	0.92%	-16.01%	1.31%	5.47%	-0.39%
过去三年	-11.72%	0.99%	-18.67%	1.54%	6.95%	-0.55%
自基金合同	181.89%	1.23%	116.41%	1.81%	65.48%	-0.58%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

### 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

嘉实稳健混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实稳健混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月9日至2012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）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%；（5）本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2012 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、33 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林青	本基金 基金经 理	2010年7月 29日	-	18年	曾任职于申银万国证券股份有限公司国际业务部，花旗银行投资银行；曾任鹏华基金管理有限公司机构理财部总监，易方达基金管理有限公司机构理财部总经理，中国国际金融有限公司资产管理部副总经理。2008年3月加盟嘉实基金管理有限公司，曾任公司机构投资部总监，现任嘉实稳健证券投资基金基金经理职务。硕士研究生，具有基金从业



					资格，中国国籍。
--	--	--	--	--	----------

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；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投资组合。

### 4.3.2 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

2012 年上半年宏观层面呈“双下”格局，通货膨胀与经济增速明确处于下行趋势中，市场对政策存在放松预期，A 股市场表现为震荡走势。全市场指数微幅上扬 5.2%，中证 100 上涨 4.9%，中小板综指上涨 5.0%。

上半年 GDP 继续下滑，需求不振使得投资链条上的企业盈利受到较大负面影响。同时，物价压力进一步得到释放，政府政策趋于宽松，两年半来央行第一次降息以应对经济下滑。报告期内，本基金进一步加长了债券组合的久期，增持了利率下行受益板块的配置，并在 1-5 月份取得了较理想的回报；但是 6 月份，组合中持有的周期股出现大幅下跌，拖累了基金业绩。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为 0.764 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.52%，同期业绩比较基准收益率为 6.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为未来 6 个月，经济增速将处于寻底过程。当这种下滑速度过快时，我们预期政府会加大宏观政策的支持力度。货币政策方面，可以期待更多次的存款准备金率以及利率下调；财政政策方面，我们也会看到政府在新兴产业以及固定资产投资领域加大投资力度。

国际市场上，欧债危机短期内趋于缓和，资本以及大宗商品市场趋于稳定。

虽然宏观经济增速以及微观企业盈利都处于下行通道中，但是我们看到政府政策趋于宽松，货币供应增速低点已过。因此下半年我们认为资本市场将表现积极：首先，我们预计债券市场在利率持续下行的大环境下会表现良好；其次，在 9、10 月份季节性需求复苏的背景下，二季度表现较差的周期股也面临机遇。结合成长股的稳定表现，下半年 A 股市场很有可能走出寻底并向上的转折行情。基于以上判断，本基金将在下半年执行以下策略：继续持有利率受益性板块（如债券、房地产等）以及稳定成长类个股，同时积极寻找周期类投资品（如工程机械、水泥）以及超跌后高 beta 品种的投资时机，力争为组合带来稳定收益的同时，增强组合的进攻性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、基金运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- (1) 报告期内本基金未实施利润分配；
- (2) 根据《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长

开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金基金合同》第三部分十一（二）收益分配原则“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。”，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实稳健开放式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	547,120,430.21	221,060,945.83
结算备付金		29,213,762.72	16,487,070.15
存出保证金		5,699,439.24	7,483,589.12
交易性金融资产	6.4.7.2	9,469,945,566.23	9,536,246,179.44
其中：股票投资		6,321,222,857.53	6,658,738,531.64
基金投资		-	-
债券投资		3,148,722,708.70	2,877,507,647.80
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	-	169,650,574.48
应收证券清算款		248,184,429.46	94,306,473.28
应收利息	6.4.7.5	36,288,176.85	57,122,004.30
应收股利		701,402.36	-
应收申购款		257,290.78	28,677,337.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,337,410,497.85	10,131,034,174.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		217,231,124.71	48,238,168.24
应付赎回款		4,187,790.44	2,159,023.55
应付管理人报酬		12,645,848.05	13,082,396.36
应付托管费		2,107,641.33	2,180,399.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,057,387.63	7,667,256.50
应交税费		1,696,462.38	1,696,462.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,350,053.94	2,331,083.96
负债合计		247,276,308.48	77,354,790.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,526,329,551.75	6,736,722,411.71
未分配利润	6.4.7.10	3,563,804,637.62	3,316,956,972.19
所有者权益合计		10,090,134,189.37	10,053,679,383.90
负债和所有者权益总计		10,337,410,497.85	10,131,034,174.27

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.764 元，基金份额总额 13,205,826,591.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		484,020,890.86	-422,457,962.33
1.利息收入		46,911,750.87	56,275,119.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,780,595.07	2,703,522.87
债券利息收入		43,691,135.14	52,258,393.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,440,020.66	1,313,203.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-42,730,599.85	206,925,478.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-104,735,982.56	179,744,446.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,265,490.95	-33,490,766.12
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	52,739,891.76	60,671,798.61
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	479,774,409.19	-685,990,864.97
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	65,330.65	332,304.24
<b>减：二、费用</b>		117,646,153.81	161,488,403.62
1. 管理人报酬		76,859,575.28	95,076,400.78
2. 托管费		12,809,929.21	15,846,066.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	27,850,062.59	50,387,670.76
5. 利息支出		-	28,696.83
其中：卖出回购金融资产支出		-	28,696.83
6. 其他费用	6.4.7.19	126,586.73	149,568.46
<b>三、利润总额</b>		366,374,737.05	-583,946,365.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		366,374,737.05	-583,946,365.95

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	6,736,722,411.71	3,316,956,972.19	10,053,679,383.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	366,374,737.05	366,374,737.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-210,392,859.96	-119,527,071.62	-329,919,931.58
其中：1.基金申购款	55,874,785.87	30,290,769.85	86,165,555.72
2.基金赎回款	-266,267,645.83	-149,817,841.47	-416,085,487.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,526,329,551.75	3,563,804,637.62	10,090,134,189.37
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,405,559,134.42	6,014,741,219.66	13,420,300,354.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-583,946,365.95	-583,946,365.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-446,700,153.99	-368,429,654.83	-815,129,808.82
其中：1.基金申购款	173,898,611.37	134,511,307.66	308,409,919.03
2.基金赎回款	-620,598,765.36	-502,940,962.49	-1,123,539,727.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,958,858,980.43	5,062,365,198.88	12,021,224,179.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
赵学军  
基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
李松林  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
王红  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)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，嘉实理财通系列开放式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开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 1,030,248,511.17 份基金单位。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和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。

本基金于 2007 年 5 月 30 日进行了基金份额拆分操作，当日本基金拆分前基金份额净值为人民币 2.024 元，本基金管理人按照 1: 2.023867075 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。拆分后，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.023867075 份。本基金于 2007 年 5 月 31 日进行了变更登记。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，股票等权益投资比例范围为基金资产净值的 40%-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%，现金留存比例：5%左右。本基金业绩比较基准为：巨潮 200（大盘）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(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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；

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。

#### 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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	547,120,430.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	547,120,430.21

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,647,317,744.53	6,321,222,857.53	-326,094,887.00	
债券	交易所市场	524,547,511.37	501,565,708.70	-22,981,802.67
	银行间市场	2,621,483,725.45	2,647,157,000.00	25,673,274.55
	合计	3,146,031,236.82	3,148,722,708.70	2,691,471.88
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	9,793,348,981.35	9,469,945,566.23	-323,403,415.12
----	------------------	------------------	-----------------

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2012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（2012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（2012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 2012年6月30日
应收活期存款利息	121,176.12
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	11,831.58
应收债券利息	36,155,166.80
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.35
其他	-
合计	36,288,176.85

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2012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 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,048,612.63
银行间市场应付交易费用	8,775.00
合计	7,057,387.63

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	2,250,000.00
应付赎回费	600.04
预提费用	99,453.90
合计	2,350,053.94

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,631,560,237.22	6,736,722,411.71
本期申购	113,054,484.20	55,874,785.87
本期赎回	-538,788,130.36	-266,267,645.83
本期末	13,205,826,591.06	6,526,329,551.75

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	2,339,110,556.62	977,846,415.57	3,316,956,972.19
本期利润	-113,399,672.14	479,774,409.19	366,374,737.05
本期基金份额交易产生的变动数	-67,159,186.61	-52,367,885.01	-119,527,071.62
其中：基金申购款	18,017,767.80	12,273,002.05	30,290,769.85
基金赎回款	-85,176,954.41	-64,640,887.06	-149,817,841.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,158,551,697.87	1,405,252,939.75	3,563,804,637.62

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,628,607.16
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	150,024.10
其他	1,963.81
合计	1,780,595.07

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	9,347,268,989.90
减：卖出股票成本总额	9,452,004,972.46
买卖股票差价收入	-104,735,982.56

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券、债券到期兑付成交总额	1,700,525,313.67
减：卖出债券、债券到期兑付成本总额	1,660,569,759.17
减：应收利息总额	30,690,063.55
债券投资收益	9,265,490.95

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2012年1月1日至2012年6月30日），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 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	52,739,891.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	52,739,891.76

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	479,774,409.19
——股票投资	486,644,351.39

——债券投资	-6,869,942.20
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	479,774,409.19

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	59,931.12
基金转出费收入	5,399.53
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	65,330.65

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	27,833,762.59
银行间市场交易费用	16,300.00
合计	27,850,062.59

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	18,132.83
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	-
合计	126,586.73

## 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，本基金无重大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、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日），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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	76,859,575.28	95,076,400.78
其中：支付销售机构的客户维护费	8,170,677.39	10,003,901.71

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,809,929.21	15,846,066.79

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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 2012年1月1日至2012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	489,127,125.41	134,780,759.23	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国银行	266,525,781.84	358,410,746.31	-	-	200,240,000.00	10,065.25

#### 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

本期（2012年1月1日至2012年6月30日）及上年度可比期间（2011年1月1日至2011年6月30日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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（2012年6月30日）及上年度末（2011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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011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	547,120,430.21	1,628,607.16	1,123,824,487.82	2,446,236.14

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**

本期（2012年1月1日至2012年6月30日）及上年度可比期间（2011年1月1日至2011年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本期（2012年1月1日至2012年6月30日），本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2012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
002241	歌尔声学	2012年4月11日	2013年4月12日	非公开发行流通受限	24.69	27.32	2,500,000	61,725,000.00	68,300,000.00	-
000970	中科三环	2012年5月15日	2013年5月16日	非公开发行流通受限	24.00	26.09	1,000,000	24,000,000.00	26,090,000.00	-

**6.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

本期末（2012年6月30日），本基金未持有流通受限的债券。

**6.4.12.1.3 受限证券类别：其他**

本期末（2012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	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
------	------	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----



			因							
600780	通宝能源	2012年1月18日	重大事项停牌	6.70	未知	未知	15,623,261	131,100,406.77	104,675,848.70	-

### 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

本期末（2012年6月30日），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

本期末（2012年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.14 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，由公司总经理、督察长以及部门总监组成。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。

#### 6.4.14.1 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股票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。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 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。

#### 6.4.14.4 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、存出权证保证金及债券投资等。

下表统计了本基金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。

##### 6.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	547,120,430.21	-	-	-	547,120,430.21
结算备付金	29,213,762.72	-	-	-	29,213,762.72
存出保证金	-	-	-	5,699,439.24	5,699,439.24
交易性金融资产	1,271,273,000.00	473,043,023.70	1,404,406,685.00	6,321,222,857.53	9,469,945,566.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	248,184,429.46	248,184,429.46
应收利息	-	-	-	36,288,176.85	36,288,176.85
应收股利	-	-	-	701,402.36	701,402.36
应收申购款	19,496.35	-	-	237,794.43	257,290.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,847,626,689.28	473,043,023.70	1,404,406,685.00	6,612,334,099.87	10,337,410,497.85
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	-	-	-	217,231,124.71	217,231,124.71
应付赎回款	-	-	-	4,187,790.44	4,187,790.44
应付管理人报酬	-	-	-	12,645,848.05	12,645,848.05
应付托管费	-	-	-	2,107,641.33	2,107,641.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,057,387.63	7,057,387.63
应交税费	-	-	-	1,696,462.38	1,696,462.38
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,350,053.94	2,350,053.94
负债总计	-	-	-	247,276,308.48	247,276,308.48
利率敏感度缺口	1,847,626,689.28	473,043,023.70	1,404,406,685.00	6,365,057,791.39	10,090,134,189.37
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	221,060,945.83	-	-	-	221,060,945.83
结算备付金	16,487,070.15	-	-	-	16,487,070.15
存出保证金	138,549.12	-	-	7,345,040.00	7,483,589.12
交易性金融资产	532,065,000.00	466,071,234.00	1,879,371,413.80	6,658,738,531.64	9,536,246,179.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	169,650,574.48	-	-	-	169,650,574.48
应收证券清算款	-	-	-	94,306,473.28	94,306,473.28
应收利息	-	-	-	57,122,004.30	57,122,004.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	25,601,976.29	-	-	3,075,361.38	28,677,337.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	965,004,115.87	466,071,234.00	1,879,371,413.80	6,820,587,410.60	10,131,034,174.27
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	-	-	-	48,238,168.24	48,238,168.24
应付赎回款	-	-	-	2,159,023.55	2,159,023.55
应付管理人 报酬	-	-	-	13,082,396.36	13,082,396.36
应付托管费	-	-	-	2,180,399.38	2,180,399.38
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	7,667,256.50	7,667,256.50
应交税费	-	-	-	1,696,462.38	1,696,462.38
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,331,083.96	2,331,083.96
负债总计	-	-	-	77,354,790.37	77,354,790.37
利率敏感度 缺口	965,004,115.87	466,071,234.00	1,879,371,413.80	6,743,232,620.23	10,053,679,383.90

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

#### 6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	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；		
	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：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	30,441,732.11	33,823,239.45
市场利率上升 25 个基点	-29,871,039.92	-33,213,496.23	

#### 6.4.14.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.14.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益投资比例范围为基金资产净值的 40%-75%；债券为 20%-55%；现金比例在 5%左右。

##### 6.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	6,321,222,857.53	62.65	6,658,738,531.64	66.23
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,321,222,857.53	62.65	6,658,738,531.64	66.23

##### 6.4.14.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。			
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：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	354,163,710.05	324,231,160.13
业绩比较基准下降 5%	-354,163,710.05	-324,231,160.13	

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 6,623,722,717.53 元，属于第二层级的余额为 2,846,222,848.70 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 7,404,802,179.44 元，第二层级 2,131,444,000.00 元，无第三层级)。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间不将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	6,321,222,857.53	61.15
	其中：股票	6,321,222,857.53	61.15
2	固定收益投资	3,148,722,708.70	30.46
	其中：债券	3,148,722,708.70	30.46
	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	576,334,192.93	5.58
6	其他各项资产	291,130,738.69	2.82
	合计	10,337,410,497.85	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	-	-
B	采掘业	100,023,898.20	0.99
C	制造业	3,075,676,384.67	30.48
C0	食品、饮料	653,604,445.26	6.48
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	11,855,034.42	0.12
C4	石油、化学、塑胶、塑料	221,279,528.65	2.19
C5	电子	142,496,005.38	1.41
C6	金属、非金属	266,277,557.27	2.64
C7	机械、设备、仪表	1,166,097,040.75	11.56
C8	医药、生物制品	614,066,772.94	6.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	104,675,848.70	1.04
E	建筑业	698,371,131.06	6.92
F	交通运输、仓储业	244,772,893.21	2.43
G	信息技术业	469,000,103.48	4.65
H	批发和零售贸易	307,195,924.57	3.04



I	金融、保险业	293,976,374.38	2.91
J	房地产业	325,661,112.41	3.23
K	社会服务业	354,571,839.71	3.51
L	传播与文化产业	260,452,413.14	2.58
M	综合类	86,844,934.00	0.86
	合计	6,321,222,857.53	62.65

### 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	002304	洋河股份	2,288,488	307,916,060.40	3.05
2	601668	中国建筑	81,581,772	272,483,118.48	2.70
3	000651	格力电器	12,597,766	262,663,421.10	2.60
4	601669	中国水电	57,883,619	252,951,415.03	2.51
5	002063	远光软件	15,287,989	221,828,720.39	2.20
6	000069	华侨城A	31,001,435	197,789,155.30	1.96
7	000650	仁和药业	22,704,040	194,800,663.20	1.93
8	000002	万科A	21,478,558	191,373,951.78	1.90
9	600690	青岛海尔	16,125,391	188,989,582.52	1.87
10	601098	中南传媒	19,196,563	183,903,073.54	1.82
11	600887	伊利股份	8,466,114	174,232,626.12	1.73
12	000927	一汽夏利	21,546,350	157,934,745.50	1.57
13	000999	华润三九	6,734,228	147,142,881.80	1.46
14	601117	中国化学	24,744,058	142,773,214.66	1.41
15	000063	中兴通讯	9,928,447	138,601,120.12	1.37
16	600208	新湖中宝	32,515,051	134,287,160.63	1.33
17	000528	柳工	10,513,616	130,473,974.56	1.29
18	000538	云南白药	2,031,535	120,429,394.80	1.19
19	002266	浙富股份	15,988,659	119,914,942.50	1.19
20	002096	南岭民爆	9,001,990	117,836,049.10	1.17
21	600428	中远航运	28,656,551	116,632,162.57	1.16
22	600720	祁连山	10,694,879	111,975,383.13	1.11
23	600780	通宝能源	15,623,261	104,675,848.70	1.04
24	600309	烟台万华	7,478,613	99,839,483.55	0.99
25	600030	中信证券	7,756,377	97,963,041.51	0.97
26	600820	隧道股份	10,716,917	95,380,561.30	0.95
27	600517	置信电气	7,955,901	91,254,184.47	0.90

28	000157	中联重科	9,082,790	91,100,383.70	0.90
29	600519	贵州茅台	369,274	88,311,877.10	0.88
30	600881	亚泰集团	15,789,988	86,844,934.00	0.86
31	600199	金种子酒	3,328,418	83,143,881.64	0.82
32	000401	冀东水泥	5,610,043	78,877,204.58	0.78
33	002140	东华科技	4,028,885	77,556,036.25	0.77
34	601928	凤凰传媒	8,901,086	76,549,339.60	0.76
35	002241	歌尔声学	2,655,110	73,959,963.90	0.73
36	002024	苏宁电器	8,726,665	73,216,719.35	0.73
37	002269	美邦服饰	2,708,738	65,280,585.80	0.65
38	002099	海翔药业	6,092,155	64,820,529.20	0.64
39	000527	美的电器	5,512,229	60,910,130.45	0.60
40	600837	海通证券	6,154,289	59,265,803.07	0.59
41	600036	招商银行	5,370,968	58,650,970.56	0.58
42	600547	山东黄金	1,750,103	57,473,382.52	0.57
43	600682	南京新百	6,983,410	56,914,791.50	0.56
44	000661	长春高新	1,179,286	55,733,056.36	0.55
45	601318	中国平安	1,186,825	54,285,375.50	0.54
46	600125	铁龙物流	5,775,423	48,975,587.04	0.49
47	000800	一汽轿车	4,236,928	46,013,038.08	0.46
48	600697	欧亚集团	1,907,996	43,635,868.52	0.43
49	600271	航天信息	2,245,544	42,463,237.04	0.42
50	600787	中储股份	4,519,927	40,136,951.76	0.40
51	000786	北新建材	3,084,579	39,914,452.26	0.40
52	600115	东方航空	9,336,888	39,028,191.84	0.39
53	300050	世纪鼎利	3,296,392	36,787,734.72	0.36
54	600563	法拉电子	2,219,878	33,875,338.28	0.34
55	600750	江中药业	1,115,738	31,140,247.58	0.31
56	600498	烽火通信	1,105,971	29,319,291.21	0.29
57	002155	辰州矿业	1,456,496	28,197,762.56	0.28
58	600827	友谊股份	2,352,728	26,609,353.68	0.26
59	000970	中科三环	1,000,000	26,090,000.00	0.26
60	601601	中国太保	1,073,543	23,811,183.74	0.24
61	600778	友好集团	1,619,899	18,207,664.76	0.18
62	600585	海螺水泥	1,209,715	17,927,976.30	0.18
63	300048	合康变频	1,745,674	15,938,003.62	0.16
64	002400	省广股份	731,565	14,009,469.75	0.14
65	000501	鄂武商 A	937,357	13,947,872.16	0.14
66	600489	中金黄金	593,731	12,777,091.12	0.13

67	600356	恒丰纸业	1,698,429	11,855,034.42	0.12
68	000932	华菱钢铁	4,361,400	10,641,816.00	0.11
69	002607	亚夏汽车	854,560	9,383,068.80	0.09
70	002236	大华股份	279,176	8,570,703.20	0.08
71	000709	河北钢铁	2,451,900	6,693,687.00	0.07
72	600722	ST 金化	752,400	3,603,996.00	0.04
73	600403	大有能源	76,600	1,575,662.00	0.02
74	002430	杭氧股份	74,825	904,634.25	0.01
75	000960	锡业股份	12,540	247,038.00	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	600030	中信证券	322,252,390.25	3.21
2	000063	中兴通讯	278,575,689.38	2.77
3	000651	格力电器	277,414,762.94	2.76
4	000002	万科A	256,579,717.09	2.55
5	600837	海通证券	242,786,558.86	2.41
6	000970	中科三环	232,670,007.73	2.31
7	601318	中国平安	214,956,702.25	2.14
8	601006	大秦铁路	212,612,764.94	2.11
9	600690	青岛海尔	202,955,076.35	2.02
10	601669	中国水电	201,599,442.15	2.01
11	601098	中南传媒	195,456,501.68	1.94
12	601666	平煤股份	190,081,653.79	1.89
13	000069	华侨城A	187,982,385.82	1.87
14	601928	凤凰传媒	179,587,410.26	1.79
15	600489	中金黄金	179,536,346.02	1.79
16	600547	山东黄金	175,670,111.66	1.75
17	600585	海螺水泥	175,291,892.46	1.74
18	601601	中国太保	164,949,467.30	1.64
19	000630	铜陵有色	160,958,562.86	1.60
20	601668	中国建筑	150,215,922.27	1.49

## 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	600177	雅戈尔	468,244,280.33	4.66
2	000970	中科三环	331,234,314.77	3.29
3	600030	中信证券	312,032,727.19	3.10
4	600837	海通证券	261,880,220.98	2.60
5	600795	国电电力	258,140,550.39	2.57
6	601601	中国太保	253,403,443.15	2.52
7	000876	新希望	246,061,443.03	2.45
8	601336	新华保险	237,257,600.54	2.36
9	600519	贵州茅台	231,866,440.78	2.31
10	601006	大秦铁路	212,430,350.21	2.11
11	600009	上海机场	206,200,479.35	2.05
12	601666	平煤股份	195,180,215.29	1.94
13	000402	金融街	187,981,972.52	1.87
14	600863	内蒙华电	184,499,309.22	1.84
15	600741	华域汽车	182,168,557.81	1.81
16	600000	浦发银行	180,179,706.59	1.79
17	600266	北京城建	171,042,424.99	1.70
18	000630	铜陵有色	164,884,753.97	1.64
19	600489	中金黄金	162,337,385.36	1.61
20	601318	中国平安	161,559,614.98	1.61

## 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	8,627,844,946.96
卖出股票收入（成交）总额	9,347,268,989.90

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	673,271,000.00	6.67
2	央行票据	678,618,000.00	6.73

3	金融债券	1,295,268,000.00	12.84
	其中：政策性金融债	1,295,268,000.00	12.84
4	企业债券	28,522,685.00	0.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	473,043,023.70	4.69
8	其他	-	-
	合计	3,148,722,708.70	31.21

## 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	1101096	11 央行票据 96	3,900,000	378,222,000.00	3.75
2	120004	12 付息国债 04	3,700,000	375,587,000.00	3.72
3	113002	工行转债	2,843,930	309,959,930.70	3.07
4	110216	11 国开 16	2,200,000	224,158,000.00	2.22
5	120405	12 农发 05	2,000,000	200,940,000.00	1.99

## 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

报告期末，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

报告期末，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证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,699,439.24

2	应收证券清算款	248,184,429.46
3	应收股利	701,402.36
4	应收利息	36,288,176.85
5	应收申购款	257,290.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	291,130,738.69

#### 7.9.4 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	113002	工行转债	309,959,930.70	3.07
2	110015	石化转债	163,083,093.00	1.62

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
683,721	19,314.64	523,461,091.67	3.96%	12,682,365,499.39	96.04%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

##### 8.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况

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基金	35,873.37	0.00%

**8.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理持有本基金情况**

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

**§ 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	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	13,631,560,237.22
本报告期基金总申购份额	113,054,484.20
减：本报告期基金总赎回份额	538,788,130.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	13,205,826,591.06

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****(1) 基金管理人的重大人事变动情况**

2012年4月11日，本基金管理人发布《关于基金行业高级管理人员变更的公告》，李道滨先生不再担任本公司副总经理。

**(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况**

报告期内，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	
中国国际金融有限公司	2	3,245,835,897.73	18.15%	2,713,340.68	18.05%	-
国元证券股份有限公司	1	1,383,844,606.30	7.74%	1,176,266.82	7.82%	-
中银国际证券有限责任公司	2	1,323,293,639.49	7.40%	1,124,794.61	7.48%	-
中信建投证券股份有限公司	2	1,060,139,730.33	5.93%	862,572.79	5.74%	-
北京高华证券有限责任公司	1	890,738,359.34	4.98%	757,755.05	5.04%	-
平安证券有限责任公司	2	838,118,315.37	4.69%	695,076.72	4.62%	-
长江证券股份有限公司	1	827,514,092.92	4.63%	675,903.42	4.50%	-
申银万国证券股份有限公司	2	684,449,468.13	3.83%	574,468.85	3.82%	-
兴业证券股份有限公司	1	664,562,160.32	3.72%	564,874.69	3.76%	-
东方证券股份有限公司	2	644,832,736.70	3.61%	523,932.68	3.49%	-
宏源证券股份有限公司	1	644,262,718.85	3.60%	547,622.35	3.64%	-
华泰证券股份有限公司	4	616,186,902.58	3.44%	523,758.29	3.48%	-
中信证券股份有限公司	3	609,841,836.96	3.41%	518,368.62	3.45%	-
海通证券股份有限公司	2	565,417,199.28	3.16%	493,607.78	3.28%	-
国金证券股份有限公司	2	558,639,759.16	3.12%	474,845.05	3.16%	-
国泰君安证券股份有限公司	4	533,587,003.37	2.98%	434,430.83	2.89%	-
广发证券股份有限公司	2	463,041,618.83	2.59%	396,353.79	2.64%	-
齐鲁证券有限公司	1	407,900,201.34	2.28%	331,422.55	2.20%	-



信达证券股份 有限公司	1	391,943,878.35	2.19%	333,153.92	2.22%	-
瑞银证券有限 责任公司	1	368,787,910.85	2.06%	313,469.65	2.09%	-
民生证券有限 责任公司	2	346,458,151.77	1.94%	299,869.55	1.99%	-
中国中投证券 有限责任公司	2	270,079,020.19	1.51%	234,243.25	1.56%	-
安信证券股份 有限公司	3	222,830,800.38	1.25%	189,410.32	1.26%	-
招商证券股份 有限公司	1	192,228,830.33	1.07%	157,279.28	1.05%	-
中国银河证券 股份有限公司	2	88,783,264.10	0.50%	77,508.26	0.52%	-
国信证券股份 有限公司	1	43,540,929.57	0.24%	38,011.09	0.25%	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
大通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券经纪 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-

湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信金通证券 有限责任公司	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。

注 3: 华泰联合证券有限责任公司交易单元并入华泰证券股份有限公司。

### 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

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中国国际金融 有限公司	558,960.00	0.21%	400,000,000.00	3.12%	-	-
中银国际证券 有限责任公司	140,039,924.50	53.77%	-	-	-	-

华泰证券股份 有限公司	25,157,408.40	9.66%	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	465,000,000.00	3.63%	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	7,360,000,000.00	57.48%	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	200,000,000.00	1.56%	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	2,130,000,000.00	16.63%	-	-
信达证券股份 有限公司	94,675,637.40	36.35%	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	1,000,000,000.00	7.81%	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	200,000,000.00	1.56%	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	450,000,000.00	3.51%	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	600,000,000.00	4.69%	-	-

## 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	关于增加财富里昂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	2012年1月 7日
2	关于嘉实直销网上交易有关建行卡功能升级和申购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	2012年1月 12日
3	关于对中国工商银行借记卡持卡人通过嘉实直销网上交易的在线支付方式申购费率优惠促销的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2012年1月 12日
4	嘉实基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2012年1月 12日
5	关于嘉实旗下开放式基金通过华夏银行开办定投业务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	2012年2月 21日
6	关于基金行业高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2012年4月 11日
7	关于旗下基金投资歌尔声学非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2012年4月 12日
8	关于旗下基金投资中科三环非公	中国证券报、上海证券报、	2012年5月

	开发行股票的公告	证券时报、管理人网站	16 日
9	关于旗下开放式基金通过渤海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	2012 年 6 月 8 日
10	关于对中国银行长城借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易在线支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2012 年 6 月 11 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) 报告期内嘉实稳健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**  
2012 年 8 月 28 日