

嘉实稳健开放式证券投资基金 2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 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 2015 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
8.12 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
§10 开放式基金份额变动	49
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息	56
§13 备查文件目录	56
13.1 备查文件目录	56
13.2 存放地点	56
13.3 查阅方式	56

§ 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	8,651,007,393.61 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 β 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	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.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	田国立

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	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	319,344,583.32	691,340,257.82	-1,032,169,079.26
本期利润	824,933,528.57	1,244,261,664.35	76,184,798.06
加权平均基金份额本期利润	0.0824	0.1058	0.0058
本期加权平均净值利润率	10.52%	13.02%	0.78%
本期基金份额净值增长率	12.34%	13.74%	0.68%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	1,530,874,901.31	1,618,879,852.85	1,178,256,528.47
期末可供分配基金份额利润	0.1770	0.1494	0.0925
期末基金资产净值	8,107,262,709.50	9,119,805,867.66	9,458,844,676.60
期末基金份额净值	0.937	0.842	0.743
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	250.29%	211.80%	174.14%

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

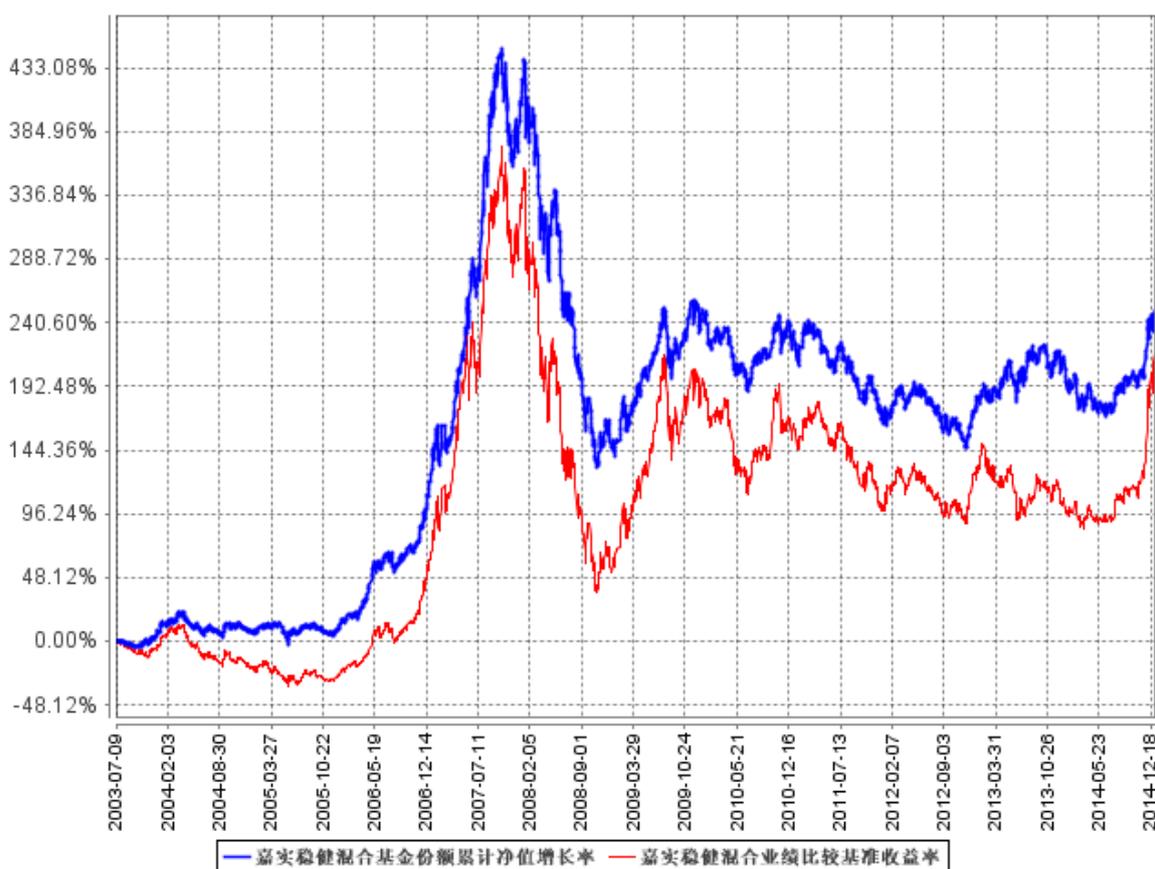
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	16.69%	1.12%	47.44%	1.72%	-30.75%	-0.60%
过去六个月	26.28%	0.92%	64.21%	1.38%	-37.93%	-0.46%
过去一年	12.34%	0.98%	52.42%	1.24%	-40.08%	-0.26%
过去三年	28.64%	0.98%	56.63%	1.30%	-27.99%	-0.32%
过去五年	0.09%	0.95%	6.25%	1.35%	-6.16%	-0.40%
自基金合同生效起至今	250.29%	1.18%	217.51%	1.71%	32.78%	-0.53%

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

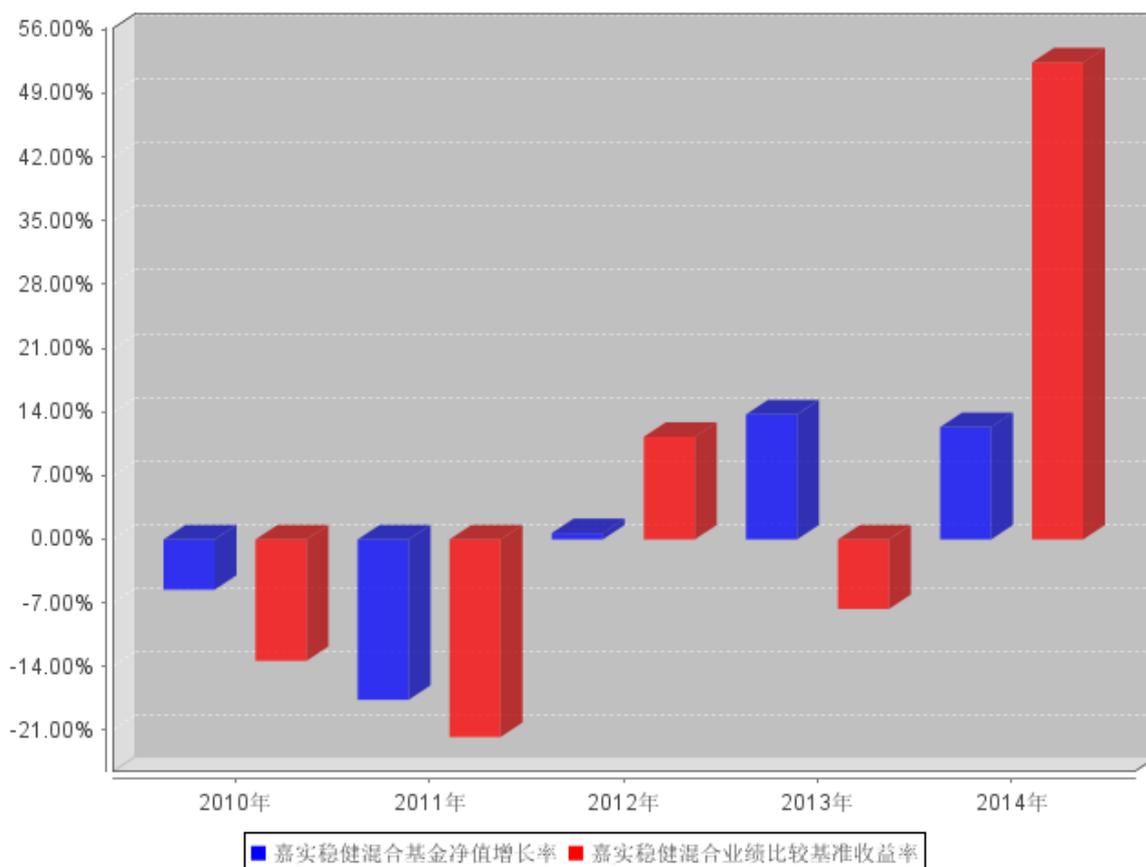
(2003年7月9日至2014年12月31日)

注 1：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发行的证券，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。

注 2：2014 年 11 月 26 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实稳健混合基金经理的公告》，聘请郭东谋先生担任本基金基金经理职务，与基金经理许少波先生共同管理本基金。

3.2.3 过去五年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

嘉实稳健混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配合	备注
----	----------	--------	--------	---------	----

	额分红数	总额	放总额	计	
2014	0.0750	33,165,481.24	47,659,981.27	80,825,462.51	
2013	0.0280	15,073,194.48	20,405,885.09	35,479,079.57	
2012	-	-	-	-	
合计	0.1030	48,238,675.72	68,065,866.36	116,304,542.08	

§ 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，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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 2014 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、66 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和封闭、嘉实元和、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、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强。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		
许少波	本基金基金经理	2013 年 5 月 7 日	-	10 年	曾任中邮创业基金管理有限公司行业研究员，2008 年 2 月加盟嘉实基金管理有限公司，先后担任研究部研究员，股票投资部基金经理助理。清华大学工商管理硕士。
郭东谋	本基金基金经理，嘉实周期优选股票、嘉实元和、嘉实逆向策略股票基金经理	2014 年 11 月 26 日	-	10 年	曾任招商证券研究员，2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司任研究部研究员、基金经理助理。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。（3）2015 年 2 月 17 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实稳健基金经理的公告》，聘请翟琳琳女士、张森先生担任本基金基金经理，与现任基金经理许少波先生、郭东谋先生共同管理本基金。

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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益

输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 7 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

回顾 2014 年，虽然管理层持续出台宽松的货币政策，但是经济仍处于持续下行的态势，经济增速持续放缓，房地产行业加速下滑，在不利的宏观经济因素影响下，二季度中期管理层开始进行政策的微调，强调稳增长，然而社会融资成本居高不下，经济难以见到复苏的迹象，央行在四季度中旬出台了降息的政策。

市场板块分化年初以来越演越烈。上半年创业板涨幅较大，以信息安全、互联网及新能源汽车为主导的新兴产业有比较大的涨幅，而大中市值的成长股跌幅较大；进入七月份以后，随着沪港通的推出，大中市值股票开始启稳回升；四季度在降息政策的刺激下，在金融、钢铁及航空等板块的带领下，大盘股有比较大的涨幅，而创业板有比较大的调整。

报告期内本基金基于大类资产的投资机会和风险分析，保持较高仓位。本基金重点增持了受益降息周期的行业，如非银金融、房地产及化工；主要减持估值偏高的成长股，如电子、医药生物及食品饮料。

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 0.937 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.34%，业绩比较基准收益率为 52.42%。

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 2015 年，经济虽然仍处于寻底的过程中，但是政府会持续出台稳增长的相关政策，资金持续流入的趋势还不会改变，在高层出台相关的打压政策之前，资金推动的行情仍将在低估值板块的板块轮动，部分优质成长股已经进入中长期投资的买点。

本基金在下一阶段将保持中等仓位水平，重点投资业绩增长超预期的低估值成长股，同时加强研究与改革转型相关的新兴成长型公司，优选具有较好的商业模式及具有核心竞争力的公司，在具备安全边际的价格下买入持有。总之，本基金将进一步优化组合结构，力争为投资人获得较好的回报。

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，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，重点支持创新业务和新产品拓展。创新是公司永恒的主题，同时应有效防控风险，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则的创新，使之更加符合投资者需求，并在投资者利益保护、市场营销方面坚持底线。

(2) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

(3) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查(包括各类产品及业务)，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，

未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(4) 合规管理：主要从事前合规审核、合规监控系统化建设、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(5) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

此外，我们还积极配合证监会、北京证监局、社保基金理事会的现场检查、以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

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、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，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基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2014 年 1 月 15 日发布《嘉实稳健开放式证券投资基金 2013 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2013 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.075 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 20 日发布《嘉实稳健开放式证券投资基金 2014 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.089 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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”）在对嘉实稳健证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

安永华明（2015）审字第 60468756_A04 号

嘉实稳健开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实稳健开放式证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表，2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

一、基金管理人对于财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人嘉实基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控

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。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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基金管理人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，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实稳健开放式证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国 北京

中国注册会计师 汤 骏

中国注册会计师 贺 耀

2015 年 3 月 16 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	230,920,579.89	558,690,492.71

结算备付金		10,071,607.70	4,248,504.65
存出保证金		1,493,537.93	1,496,132.58
交易性金融资产	7.4.7.2	7,921,272,191.09	8,549,676,223.27
其中：股票投资		6,005,526,727.69	6,363,121,551.77
基金投资		-	-
债券投资		1,915,745,463.40	2,186,554,671.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	4,534,600.25
应收利息	7.4.7.5	27,986,166.02	28,878,678.54
应收股利		-	-
应收申购款		533,073.92	169,815.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,192,277,156.55	9,147,694,447.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
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		38,355,900.62	35,000.00
应付赎回款		29,776,450.76	9,228,620.32
应付管理人报酬		10,214,965.42	11,749,918.78
应付托管费		1,702,494.25	1,958,319.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,508,200.90	2,768,760.62
应交税费		-	1,696,544.72
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	456,435.10	451,415.65
负债合计		85,014,447.05	27,888,579.89
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,275,294,154.45	5,355,169,368.19
未分配利润	7.4.7.10	3,831,968,555.05	3,764,636,499.47
所有者权益合计		8,107,262,709.50	9,119,805,867.66
负债和所有者权益总计		8,192,277,156.55	9,147,694,447.55

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.937 元，基金份额总额 8,651,007,393.61

份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		990,686,466.02	1,451,425,933.50
1. 利息收入		75,030,619.77	85,880,785.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,218,620.09	2,211,893.21
债券利息收入		72,142,635.65	83,572,526.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		669,364.03	96,365.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		408,344,108.35	812,025,698.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	322,219,511.92	715,705,692.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-16,872,091.46	-330,996.53
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	102,996,687.89	96,651,002.46
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	505,588,945.25	552,921,406.53
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	1,722,792.65	598,043.54
减：二、费用		165,752,937.45	207,164,269.15
1. 管理人报酬		117,799,349.25	143,397,240.60
2. 托管费		19,633,224.91	23,899,540.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	27,050,751.40	39,598,439.55
5. 利息支出		995,925.57	-
其中：卖出回购金融资产支出		995,925.57	-
6. 其他费用	7.4.7.19	273,686.32	269,048.86
三、利润总额		824,933,528.57	1,244,261,664.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润		824,933,528.57	1,244,261,664.35

7.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	5,355,169,368.19	3,764,636,499.47	9,119,805,867.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	824,933,528.57	824,933,528.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,079,875,213.74	-676,776,010.48	-1,756,651,224.22
其中：1. 基金申购款	97,889,213.84	59,423,632.28	157,312,846.12
2. 基金赎回款	-1,177,764,427.58	-736,199,642.76	-1,913,964,070.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-80,825,462.51	-80,825,462.51
五、期末所有者权益（基金净值）	4,275,294,154.45	3,831,968,555.05	8,107,262,709.50
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	6,292,776,567.08	3,166,068,109.52	9,458,844,676.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,244,261,664.35	1,244,261,664.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-937,607,198.89	-610,214,194.83	-1,547,821,393.72
其中：1. 基金申购款	86,025,033.81	53,458,031.68	139,483,065.49
2. 基金赎回款	-1,023,632,232.70	-663,672,226.51	-1,687,304,459.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-35,479,079.57	-35,479,079.57

五、期末所有者权益（基金净值）	5,355,169,368.19	3,764,636,499.47	9,119,805,867.66
-----------------	------------------	------------------	------------------

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：

_____ 赵学军	_____ 李松林	_____ 王红
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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 份基金份额。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，包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50% 的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，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，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%，债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。

本基金业绩比较基准为：巨潮 200（大盘）指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按除息日的基金单位净值自动转为基金单位进行再投资；

(2) 每一基金单位享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每基金单位净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；

(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四个月内完成；

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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[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。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
活期存款	230,920,579.89	558,690,492.71
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	230,920,579.89	558,690,492.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,677,204,271.00	6,005,526,727.69	1,328,322,456.69	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	201,687,255.64	250,381,463.40	48,694,207.76
	银行间市场	1,678,694,259.66	1,665,364,000.00	-13,330,259.66
	合计	1,880,381,515.30	1,915,745,463.40	35,363,948.10
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,557,585,786.30	7,921,272,191.09	1,363,686,404.79	
项目	上年度末 2013年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	5,379,162,458.05	6,363,121,551.77	983,959,093.72	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	292,661,463.60	267,297,671.50	-25,363,792.10
	银行间市场	2,019,754,842.08	1,919,257,000.00	-100,497,842.08
	合计	2,312,416,305.68	2,186,554,671.50	-125,861,634.18

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,691,578,763.73	8,549,676,223.27	858,097,459.54

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 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（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 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（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	39,726.34	92,113.97
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	4,532.40	1,900.24
应收债券利息	27,941,231.02	28,783,987.69
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	4.16	3.34
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	672.10	673.30
合计	27,986,166.02	28,878,678.54

7.4.7.6 其他资产

本期末（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,505,246.90	2,765,910.62
银行间市场应付交易费用	2,954.00	2,850.00
合计	4,508,200.90	2,768,760.62

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	6,435.10	1,415.65
预提费用	200,000.00	200,000.00
合计	456,435.10	451,415.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,836,138,031.28	5,355,169,368.19
本期申购	198,054,547.60	97,889,213.84
本期赎回	-2,383,185,185.27	-1,177,764,427.58
本期末	8,651,007,393.61	4,275,294,154.45

注：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,618,879,852.85	2,145,756,646.62	3,764,636,499.47
本期利润	319,344,583.32	505,588,945.25	824,933,528.57
本期基金份额交易产生的变动数	-326,524,072.35	-350,251,938.13	-676,776,010.48
其中：基金申购款	29,293,955.49	30,129,676.79	59,423,632.28
基金赎回款	-355,818,027.84	-380,381,614.92	-736,199,642.76
本期已分配利润	-80,825,462.51	-	-80,825,462.51
本期末	1,530,874,901.31	2,301,093,653.74	3,831,968,555.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
活期存款利息收入	2,064,968.53	1,974,570.14
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	131,106.97	204,557.67
其他	22,544.59	32,765.40
合计	2,218,620.09	2,211,893.21

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014 年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
卖出股票成交总额	10,591,706,917.00	13,799,497,823.35
减：卖出股票成本总额	10,269,487,405.08	13,083,792,131.24
买卖股票差价收入	322,219,511.92	715,705,692.11

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014 年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	1,341,259,156.82	1,277,239,173.28
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	1,320,650,215.08	1,248,398,285.59
减：应收利息总额	37,481,033.20	29,171,884.22
买卖债券差价收入	-16,872,091.46	-330,996.53

7.4.7.14 衍生工具收益

本期（2014年1月1日至2014年12月31日），及上年度可比期间（2013年1月1日至2013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 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
股票投资产生的股利收益	102,996,687.89	96,651,002.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	102,996,687.89	96,651,002.46

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014 年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
1. 交易性金融资产	505,588,945.25	552,921,406.53
——股票投资	344,363,362.97	687,866,610.67
——债券投资	161,225,582.28	-134,945,204.14
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	505,588,945.25	552,921,406.53

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
基金赎回费收入	84,693.98	81,090.21
其他	1,620,006.87	567.59
基金转换费收入	18,091.80	11,855.74
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
证管费退还	-	504,530.00
合计	1,722,792.65	598,043.54

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
交易所市场交易费用	27,044,726.40	39,588,889.55
银行间市场交易费用	6,025.00	9,550.00
合计	27,050,751.40	39,598,439.55

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12

	12 月 31 日	月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	55,286.32	50,648.86
指数使用费	-	-
上市年费	-	-
红利手续费	-	-
其他	400.00	400.00
合计	273,686.32	269,048.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2015 年 1 月 20 日，本基金管理人发布《嘉实稳健开放式证券投资基金 2014 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，权益登记日、除息日为 2015 年 1 月 22 日，红利发放日为 2015 年 1 月 23 日，收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.089 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
中诚信托有限责任公司	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
德意志资产管理（亚洲）有限公司	基金管理人股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	117,799,349.25	143,397,240.60
其中：支付销售机构的客户维护费	13,135,011.32	15,823,499.37

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,633,224.91	23,899,540.14

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易各关联方名称	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	-	40,832,182.47	-	-	-	-
上年度可比期间						
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

易的 各关联方名称	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	40,177,538.63	20,217,744.66	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年12月31日），基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本期末（2014年12月31日）及上年度末（2013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 2014年1月1日至2014年12月31 日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	230,920,579.89	2,064,968.53	558,690,492.71	1,974,570.14

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年12月31日），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

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2014年1 月17日	-	2014年1 月17日	0.0750	33,165,481.24	47,659,981.27	80,825,462.51	2013年年度收益分配于2014年实施
合计	-	-		0.0750	33,165,481.24	47,659,981.27	80,825,462.51	

注：2015年1月20日，本基金管理人发布《嘉实稳健开放式证券投资基金2014年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2014年12月31日，权益登记日、除息日为2015年1月22日，红利发放日为2015年1月23日，收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.089元。

7.4.12 期末（2014 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
002456	欧菲光	2014 年 8 月 29 日	2015 年 9 月 4 日	非公开发行流通受限	19.92	18.96	1,000,000	19,920,000.00	18,960,000.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2014 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

本期末（2014 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
300168	万达信息	2014 年 12 月 31 日	重大事项停牌	46.20	2015 年 1 月 8 日	44.50	2,982,270	120,273,634.27	137,780,874.00	-
002439	启明星辰	2014 年 12 月 8 日	重大事项停牌	23.84	2015 年 3 月 12 日	28.86	3,817,549	77,727,168.24	91,010,368.16	-
600061	中纺投资	2014 年 12 月 30 日	重大事项停牌	23.04	2015 年 1 月 7 日	25.34	3,769,916	99,177,193.43	86,858,864.64	-
002009	天奇股份	2014 年 10 月 20 日	重大事项停牌	16.30	2015 年 1 月 28 日	17.93	5,179,006	75,038,234.17	84,417,797.80	-
600716	凤凰股份	2014 年 12 月 12 日	重大事项停牌	9.58	2015 年 1 月 12 日	8.79	2,499,907	23,495,698.59	23,949,109.06	-

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

本期末（2014 年 12 月 31 日），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

本期末（2014 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

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、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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、结算保证金、债券投资及应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	230,920,579.89	-	-	-	230,920,579.89
结算备付金	10,071,607.70	-	-	-	10,071,607.70
存出保证金	1,493,537.93	-	-	-	1,493,537.93

交易性金融资产	857,310,463.40	101,045,000.00	957,390,000.00	6,005,526,727.69	7,921,272,191.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	27,986,166.02	27,986,166.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	27,597.02	-	-	505,476.90	533,073.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,099,823,785.94	101,045,000.00	957,390,000.00	6,034,018,370.61	8,192,277,156.55
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	-	-	-	38,355,900.62	38,355,900.62
应付赎回款	-	-	-	29,776,450.76	29,776,450.76
应付管理人报酬	-	-	-	10,214,965.42	10,214,965.42
应付托管费	-	-	-	1,702,494.25	1,702,494.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,508,200.90	4,508,200.90
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	456,435.10	456,435.10
负债总计	-	-	-	85,014,447.05	85,014,447.05
利率敏感度缺口	1,099,823,785.94	101,045,000.00	957,390,000.00	5,949,003,923.56	8,107,262,709.50
上年度末 2013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	558,690,492.71	-	-	-	558,690,492.71
结算备付金	4,248,504.65	-	-	-	4,248,504.65
存出保证金	1,496,132.58	-	-	-	1,496,132.58
交易性金融资产	824,864,000.00	361,582,671.50	1,000,108,000.00	6,363,121,551.77	8,549,676,223.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,534,600.25	4,534,600.25
应收利息	-	-	-	28,878,678.54	28,878,678.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	8,558.32	-	-	161,257.23	169,815.55

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,389,307,688.26	361,582,671.50	1,000,108,000.00	6,396,696,087.79	9,147,694,447.55
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	-	-	-	35,000.00	35,000.00
应付赎回款	-	-	-	9,228,620.32	9,228,620.32
应付管理人报酬	-	-	-	11,749,918.78	11,749,918.78
应付托管费	-	-	-	1,958,319.80	1,958,319.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,768,760.62	2,768,760.62
应交税费	-	-	-	1,696,544.72	1,696,544.72
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	451,415.65	451,415.65
负债总计	-	-	-	27,888,579.89	27,888,579.89
利率敏感度缺口	1,389,307,688.26	361,582,671.50	1,000,108,000.00	6,368,807,507.90	9,119,805,867.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 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（2014 年 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	16,014,175.52	21,389,466.06
	市场利率上升 25 个基点	-15,746,126.93	-21,018,232.60

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，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：在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。于 2014 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 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	6,005,526,727.69	74.08	6,363,121,551.77	69.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,005,526,727.69	74.08	6,363,121,551.77	69.77

7.4.13.4.3.2 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（2014 年 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	258,069,797.61	252,807,275.46
业绩比较基准下降 5%	-258,069,797.61	-252,807,275.46	

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

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 5,648,414,769.43 元，属于第二层次的余额为人民币 2,272,857,421.66 元，无属于第三层次的余额。

(2) 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和债券，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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	6,005,526,727.69	73.31
	其中：股票	6,005,526,727.69	73.31
2	固定收益投资	1,915,745,463.40	23.38
	其中：债券	1,915,745,463.40	23.38

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	240,992,187.59	2.94
7	其他各项资产	30,012,777.87	0.37
	合计	8,192,277,156.55	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	-	-
B	采矿业	390,863,469.12	4.82
C	制造业	3,364,691,164.49	41.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,643,858.05	1.35
E	建筑业	114,379,411.25	1.41
F	批发和零售业	114,131,453.17	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	101,872,662.84	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	672,452,032.85	8.29
J	金融业	744,050,144.70	9.18
K	房地产业	384,792,930.42	4.75
L	租赁和商务服务业	1,967,516.88	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,682,083.92	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,005,526,727.69	74.08

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	601633	长城汽车	14,308,685	594,525,861.75	7.33
2	000651	格力电器	12,954,141	480,857,713.92	5.93
3	600340	华夏幸福	7,137,178	311,180,960.80	3.84
4	600486	扬农化工	9,296,611	279,827,991.10	3.45
5	000060	中金岭南	28,058,706	266,277,119.94	3.28
6	600309	万华化学	11,476,675	249,961,981.50	3.08
7	600030	中信证券	4,902,433	166,192,478.70	2.05
8	300168	万达信息	2,982,270	137,780,874.00	1.70
9	600050	中国联通	25,320,098	125,334,485.10	1.55
10	600010	包钢股份	30,000,000	122,400,000.00	1.51
11	601088	中国神华	5,999,829	121,736,530.41	1.50
12	601766	中国南车	17,023,520	113,206,408.00	1.40
13	600970	中材国际	8,080,956	108,365,619.96	1.34
14	600036	招商银行	6,499,811	107,831,864.49	1.33
15	600570	恒生电子	1,879,371	102,914,355.96	1.27
16	300104	乐视网	2,907,988	94,335,130.72	1.16
17	002439	启明星辰	3,817,549	91,010,368.16	1.12
18	600837	海通证券	3,749,842	90,221,198.52	1.11
19	600061	中纺投资	3,769,916	86,858,864.64	1.07
20	002009	天奇股份	5,179,006	84,417,797.80	1.04
21	601318	中国平安	1,129,639	84,395,329.69	1.04
22	002051	中工国际	3,018,758	82,472,468.56	1.02
23	300253	卫宁软件	1,157,879	81,016,793.63	1.00
24	002450	康得新	2,795,745	80,992,732.65	1.00
25	600188	兖州煤业	5,999,897	79,078,642.46	0.98
26	601006	大秦铁路	7,157,174	76,295,474.84	0.94
27	600005	武钢股份	20,000,000	71,600,000.00	0.88
28	002155	辰州矿业	6,998,854	71,318,322.26	0.88
29	002215	诺普信	8,060,027	69,477,432.74	0.86
30	000975	银泰资源	4,500,000	68,805,000.00	0.85
31	000001	平安银行	4,000,000	63,360,000.00	0.78
32	000726	鲁泰A	5,000,000	59,950,000.00	0.74
33	601328	交通银行	8,800,357	59,842,427.60	0.74
34	300274	阳光电源	3,523,096	56,933,231.36	0.70

35	601601	中国太保	1,746,807	56,421,866.10	0.70
36	601933	永辉超市	6,094,063	53,079,288.73	0.65
37	000960	锡业股份	2,999,950	52,199,130.00	0.64
38	601299	中国北车	7,000,000	51,310,000.00	0.63
39	600217	秦岭水泥	5,767,589	50,408,727.86	0.62
40	600549	厦门钨业	1,499,964	49,468,812.72	0.61
41	601012	隆基股份	2,334,525	48,651,501.00	0.60
42	600483	福能股份	4,997,318	47,024,762.38	0.58
43	000712	锦龙股份	1,499,933	40,798,177.60	0.50
44	600320	振华重工	5,000,000	36,650,000.00	0.45
45	002311	海大集团	2,840,070	34,876,059.60	0.43
46	601225	陕西煤业	4,900,000	32,585,000.00	0.40
47	000807	云铝股份	5,515,822	30,447,337.44	0.38
48	002285	世联行	1,999,839	30,077,578.56	0.37
49	002048	宁波华翔	2,030,711	29,181,317.07	0.36
50	600498	烽火通信	1,862,930	28,726,380.60	0.35
51	600000	浦发银行	1,830,800	28,725,252.00	0.35
52	601600	中国铝业	4,524,025	28,275,156.25	0.35
53	002081	金螳螂	1,597,150	26,832,120.00	0.33
54	600635	大众公用	3,000,000	25,590,000.00	0.32
55	601688	华泰证券	1,000,000	24,470,000.00	0.30
56	600716	凤凰股份	2,499,907	23,949,109.06	0.30
57	000669	金鸿能源	799,963	23,478,914.05	0.29
58	600153	建发股份	2,218,000	22,579,240.00	0.28
59	601166	兴业银行	1,320,700	21,791,550.00	0.27
60	000333	美的集团	785,500	21,554,120.00	0.27
61	000963	华东医药	409,204	21,528,222.44	0.27
62	600887	伊利股份	723,332	20,708,995.16	0.26
63	600048	保利地产	1,810,100	19,585,282.00	0.24
64	002456	欧菲光	1,000,000	18,960,000.00	0.23
65	600125	铁龙物流	2,069,300	18,333,998.00	0.23
66	601001	大同煤业	1,999,997	17,339,973.99	0.21
67	300377	赢时胜	413,454	17,150,071.92	0.21
68	300113	顺网科技	828,646	16,705,503.36	0.21
69	600085	同仁堂	716,485	16,070,758.55	0.20
70	002349	精华制药	708,039	15,881,314.77	0.20
71	600511	国药股份	500,000	15,495,000.00	0.19
72	002241	歌尔声学	572,493	14,043,253.29	0.17

73	600585	海螺水泥	556,700	12,291,936.00	0.15
74	000039	中集集团	500,000	10,945,000.00	0.14
75	000401	冀东水泥	748,700	9,785,509.00	0.12
76	600900	长江电力	716,986	7,650,240.62	0.09
77	002110	三钢闽光	1,236,700	7,618,072.00	0.09
78	000905	厦门港务	465,800	7,243,190.00	0.09
79	300273	和佳股份	303,860	7,034,359.00	0.09
80	000568	泸州老窖	328,987	6,711,334.80	0.08
81	600292	中电远达	299,914	6,682,083.92	0.08
82	600885	宏发股份	320,753	5,991,666.04	0.07
83	600008	首创股份	499,995	5,899,941.00	0.07
84	002544	杰赛科技	210,000	5,846,400.00	0.07
85	002466	天齐锂业	134,990	5,452,246.10	0.07
86	000065	北方国际	279,913	5,074,822.69	0.06
87	603288	海天味业	120,200	4,801,990.00	0.06
88	600104	上汽集团	194,878	4,184,030.66	0.05
89	300049	福瑞股份	116,400	3,783,000.00	0.05
90	600519	贵州茅台	15,847	3,004,908.14	0.04
91	300124	汇川技术	98,188	2,866,107.72	0.04
92	600557	康缘药业	105,742	2,440,525.36	0.03
93	600211	西藏药业	38,700	1,449,702.00	0.02
94	002049	同方国芯	56,065	1,345,560.00	0.02
95	002223	鱼跃医疗	52,200	1,302,912.00	0.02
96	300298	三诺生物	35,300	1,110,538.00	0.01
97	600138	中青旅	63,628	1,047,316.88	0.01
98	002712	思美传媒	20,000	920,200.00	0.01
99	002085	万丰奥威	20,000	530,000.00	0.01
100	300206	理邦仪器	20,000	377,600.00	0.00
101	300352	北信源	15,000	358,050.00	0.00
102	002189	利达光电	2,500	48,250.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	332,962,849.98	3.65
2	600050	中国联通	252,211,717.96	2.77

3	002241	歌尔声学	237,379,013.86	2.60
4	601933	永辉超市	211,665,598.22	2.32
5	601318	中国平安	199,841,051.20	2.19
6	600352	浙江龙盛	196,217,410.85	2.15
7	600010	包钢股份	185,222,637.71	2.03
8	300124	汇川技术	168,310,439.16	1.85
9	600406	国电南瑞	165,975,785.26	1.82
10	002415	海康威视	143,170,890.39	1.57
11	600570	恒生电子	143,154,415.82	1.57
12	300168	万达信息	133,513,053.28	1.46
13	000963	华东医药	131,371,997.90	1.44
14	601633	长城汽车	127,297,044.21	1.40
15	300104	乐视网	124,377,899.28	1.36
16	300228	富瑞特装	122,278,080.27	1.34
17	000333	美的集团	120,390,449.35	1.32
18	002439	启明星辰	119,991,884.90	1.32
19	600837	海通证券	112,917,789.44	1.24
20	601088	中国神华	109,322,959.89	1.20

8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔声学	719,675,645.13	7.89
2	000538	云南白药	641,550,489.50	7.03
3	000651	格力电器	430,387,610.53	4.72
4	600309	万华化学	398,229,178.39	4.37
5	002415	海康威视	394,259,987.22	4.32
6	002236	大华股份	358,674,431.64	3.93
7	600887	伊利股份	320,564,175.98	3.52
8	600352	浙江龙盛	296,673,383.79	3.25
9	000060	中金岭南	245,530,708.33	2.69
10	002456	欧菲光	245,490,881.02	2.69
11	601633	长城汽车	237,562,524.27	2.60
12	600340	华夏幸福	228,763,549.93	2.51
13	002081	金螳螂	205,273,390.01	2.25
14	601933	永辉超市	192,326,788.70	2.11

15	600050	中国联通	187,204,691.68	2.05
16	000963	华东医药	170,329,207.45	1.87
17	002450	康得新	156,687,243.73	1.72
18	600406	国电南瑞	151,453,413.72	1.66
19	601318	中国平安	149,409,526.04	1.64
20	002294	信立泰	148,162,181.02	1.62

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	9,567,529,218.03
卖出股票收入（成交）总额	10,591,706,917.00

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	854,550,000.00	10.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	810,814,000.00	10.00
	其中：政策性金融债	810,814,000.00	10.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	250,381,463.40	3.09
8	其他	-	-
	合计	1,915,745,463.40	23.63

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	120004	12 付息国债 04	3,000,000	298,140,000.00	3.68
2	110024	11 付息国债 24	2,600,000	259,480,000.00	3.20
3	113005	平安转债	1,387,770	250,381,463.40	3.09
4	120009	12 付息国债 09	2,500,000	245,950,000.00	3.03

5	140213	14 国开 13	1,400,000	140,000,000.00	1.73
---	--------	----------	-----------	----------------	------

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	1,493,537.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,986,166.02
5	应收申购款	533,073.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	30,012,777.87

8.12.4 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	113005	平安转债	250,381,463.40	3.09

8.12.5 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	300168	万达信息	137,780,874.00	1.70	重大事项停牌

§ 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
478,985	18,061.12	34,429,375.36	0.40%	8,616,578,018.25	99.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,797.71	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2003 年 7 月 9 日 ）基金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	10,836,138,031.28
本报告期基金总申购份额	198,054,547.60
减:本报告期基金总赎回份额	2,383,185,185.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,651,007,393.61

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2014 年 11 月 26 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实稳健混合基金经理的公告》，聘请郭东谋先生担任本基金基金经理，与现任基金经理许少波共同管理本基金。

2014 年 10 月 10 日本基金管理人发布公告，聘请邵健先生、李松林先生担任公司副总经理职务。

2014 年 12 月 10 日本基金管理人发布公告，安奎先生因任期届满不再担任公司董事长，邓红国先生任公司董事长。

(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。

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 80,000.00 元，该审计机构已连续 12 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	
长江证券股份有限公司	1	12,165,870,470.84	10.76%	1,516,122.04	10.76%	-
华创证券有限责任公司	2	1,812,017,043.37	9.00%	1,268,420.41	9.00%	-
海通证券股份有限公司	2	1,475,270,835.90	7.33%	1,032,693.84	7.33%	-
申银万国证券股份有限公司	2	1,250,517,359.87	6.21%	875,366.90	6.21%	-
招商证券股份有限公司	2	1,237,919,559.42	6.15%	866,555.54	6.15%	-
广发证券股份有限公司	5	1,207,027,068.92	5.99%	844,925.27	5.99%	-
东北证券股份有限公司	2	1,142,187,101.80	5.67%	799,535.79	5.67%	-
安信证券股份有限公司	3	1,038,938,269.12	5.16%	727,256.78	5.16%	-
国泰君安证券股份有限公司	4	986,366,075.20	4.90%	690,463.30	4.90%	-
新时代证券有限责任公司	1	929,572,907.40	4.62%	650,701.06	4.62%	-
东兴证券股份有限公司	1	766,121,557.43	3.80%	536,285.08	3.80%	-
宏源证券股份有限公司	1	729,109,733.43	3.62%	510,376.85	3.62%	-
民生证券股份有限公司	2	680,651,355.47	3.38%	476,457.05	3.38%	-

北京高华证券 有限责任公司	1	656,236,826.03	3.26%	459,365.80	3.26%	-
兴业证券股份 有限公司	3	619,553,741.27	3.08%	433,689.84	3.08%	-
国元证券股份 有限公司	1	494,128,467.31	2.45%	345,889.94	2.45%	-
瑞银证券有限 责任公司	1	487,348,131.56	2.42%	341,143.67	2.42%	-
中国民族证券 有限责任公司	1	446,491,023.32	2.22%	312,543.72	2.22%	-
中国国际金融 有限公司	2	360,804,055.07	1.79%	252,565.61	1.79%	-
浙商证券有限 责任公司	1	309,792,258.59	1.54%	216,854.58	1.54%	-
中信证券股份 有限公司	3	303,845,274.86	1.51%	212,692.37	1.51%	-
光大证券股份 有限公司	1	290,113,756.17	1.44%	203,079.63	1.44%	-
长城证券有限 责任公司	3	183,908,665.26	0.91%	128,736.05	0.91%	-
国金证券股份 有限公司	2	129,760,303.40	0.64%	90,832.21	0.64%	-
国信证券股份 有限公司	1	121,737,752.38	0.60%	85,216.42	0.60%	-
东方证券股份 有限公司	2	107,199,410.71	0.53%	75,039.34	0.53%	-
方正证券股份 有限公司	3	101,420,598.04	0.50%	70,994.42	0.50%	新增 2 个
中银国际证券 有限责任公司	2	64,174,090.50	0.32%	44,921.86	0.32%	-
中信建投证券 股份有限公司	2	38,461,387.26	0.19%	26,923.33	0.19%	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 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	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙 江）有限责任公 司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	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。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：大通证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

注 4：广州证券有限责任公司更名为广州证券股份有限公司。

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		债券回购交易	
	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
长江证券股份有限公司	9,282,076.48	1.44%	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	233,700,000.00	9.53%
海通证券股份有限公司	-	-	1,067,800,000.00	43.53%
申银万国证券股份有限公司	54,633,051.90	8.47%	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	246,000,000.00	10.03%
国泰君安证券股份有限公司	20,429,087.50	3.17%	-	-
新时代证券有限责任公司	178,459,393.87	27.67%	-	-
东兴证券股份有限公司	81,518,101.60	12.64%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	184,100,000.00	7.50%
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	221,600,000.00	9.03%
瑞银证券有限责任公司	205,200,949.60	31.81%	-	-
中国民族证券有限责任公司	7,960,466.10	1.23%	-	-
长城证券有限责任公司	79,020,352.80	12.25%	-	-
国金证券股份有限公司	8,492,680.00	1.32%	500,000,000.00	20.38%

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	嘉实稳健开放式证券投资基金 2013 年年度收益分配公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 1 月 15 日
2	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金网上直销申购、赎回及最低账面份额的单笔最低要求的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 2 月 26 日
3	关于调整嘉实旗下部分开放式基金的日常转换费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 16 日
4	关于增加苏州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	2014 年 4 月 17 日
5	关于增加和讯信息科技有限公司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	2014 年 4 月 28 日
6	关于增加瑞丰银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与瑞丰银行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	2014 年 6 月 16 日
7	嘉实基金管理有限公司关于对交通银行太平洋借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易电子支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 7 月 1 日
8	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行参加申购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	2014 年 7 月 3 日
9	关于增加同花顺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	2014 年 7 月 23 日
10	关于增加华安证券为旗下基金代销机构并开展定投及费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 7 月 23 日
11	关于增加宏信证券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	2014 年 8 月 29 日
12	关于增加展恒基金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	2014 年 10 月 29 日
13	关于增加深圳腾元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	2014 年 10 月 29 日
14	关于增加锦州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	2014 年 11 月 7 日

15	关于新增嘉实稳健混合基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 11 月 26 日
16	关于增加宜信普泽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	2014 年 12 月 8 日
17	关于调整嘉实理财通系列开放式证券投资基金之间互转的转换费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 12 月 16 日
18	嘉实基金管理有限公司关于网上直销继续实施基金申购与转换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	2014 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财通系列开放式证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 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

13.3 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
2015 年 3 月 31 日