

(上接D08版)

Table of company information for the first column, including (128) 中信期货有限公司, (129) 东海期货有限公司, (130) 长江证券股份有限公司, (131) 西南证券股份有限公司, (132) 湘财证券股份有限公司, (133) 万联证券股份有限公司, (134) 民生证券股份有限公司, (135) 国元证券股份有限公司, (136) 渤海证券股份有限公司, (137) 山西证券股份有限公司, (138) 东吴证券股份有限公司, (139) 东吴证券股份有限公司, (140) 信达证券股份有限公司, (141) 南京证券股份有限公司, (142) 华泰证券股份有限公司, (143) 新创元证券股份有限公司, (144) 大同证券有限责任公司, (145) 国联证券股份有限公司, (146) 浙商证券股份有限公司, (147) 平安证券股份有限公司, (148) 安信证券股份有限公司, (149) 国海证券股份有限公司, (150) 国海证券股份有限公司, (151) 国海证券股份有限公司, (152) 国海证券股份有限公司, (153) 国海证券股份有限公司, (154) 国海证券股份有限公司, (155) 国海证券股份有限公司, (156) 国海证券股份有限公司, (157) 国海证券股份有限公司, (158) 国海证券股份有限公司, (159) 国海证券股份有限公司, (160) 国海证券股份有限公司, (161) 国海证券股份有限公司, (162) 国海证券股份有限公司, (163) 国海证券股份有限公司, (164) 国海证券股份有限公司, (165) 国海证券股份有限公司, (166) 国海证券股份有限公司, (167) 国海证券股份有限公司, (168) 国海证券股份有限公司, (169) 国海证券股份有限公司, (170) 国海证券股份有限公司, (171) 国海证券股份有限公司, (172) 国海证券股份有限公司, (173) 国海证券股份有限公司, (174) 国海证券股份有限公司, (175) 国海证券股份有限公司, (176) 国海证券股份有限公司, (177) 国海证券股份有限公司, (178) 国海证券股份有限公司, (179) 国海证券股份有限公司, (180) 国海证券股份有限公司, (181) 国海证券股份有限公司, (182) 国海证券股份有限公司, (183) 国海证券股份有限公司, (184) 国海证券股份有限公司, (185) 国海证券股份有限公司, (186) 国海证券股份有限公司, (187) 国海证券股份有限公司, (188) 国海证券股份有限公司, (189) 国海证券股份有限公司, (190) 国海证券股份有限公司, (191) 国海证券股份有限公司, (192) 国海证券股份有限公司, (193) 国海证券股份有限公司, (194) 国海证券股份有限公司, (195) 国海证券股份有限公司, (196) 国海证券股份有限公司, (197) 国海证券股份有限公司, (198) 国海证券股份有限公司, (199) 国海证券股份有限公司, (200) 国海证券股份有限公司.

Table of company information for the second column, including (159) 华龙证券股份有限公司, (160) 财通证券股份有限公司, (161) 上海华信证券有限责任公司, (162) 华鑫证券有限责任公司, (163) 瑞银证券有限责任公司, (164) 中山证券有限责任公司, (165) 国融证券股份有限公司, (166) 江海证券有限公司, (167) 国金证券股份有限公司, (168) 中国民族证券有限责任公司, (169) 宝华证券有限责任公司, (170) 长城国瑞证券有限公司, (171) 爱建证券有限责任公司, (172) 华融证券股份有限公司, (173) 天风证券股份有限公司, (174) 平安证券股份有限公司, (175) 安信证券股份有限公司, (176) 国海证券股份有限公司, (177) 国海证券股份有限公司, (178) 国海证券股份有限公司, (179) 国海证券股份有限公司, (180) 国海证券股份有限公司, (181) 国海证券股份有限公司, (182) 国海证券股份有限公司, (183) 国海证券股份有限公司, (184) 国海证券股份有限公司, (185) 国海证券股份有限公司, (186) 国海证券股份有限公司, (187) 国海证券股份有限公司, (188) 国海证券股份有限公司, (189) 国海证券股份有限公司, (190) 国海证券股份有限公司, (191) 国海证券股份有限公司, (192) 国海证券股份有限公司, (193) 国海证券股份有限公司, (194) 国海证券股份有限公司, (195) 国海证券股份有限公司, (196) 国海证券股份有限公司, (197) 国海证券股份有限公司, (198) 国海证券股份有限公司, (199) 国海证券股份有限公司, (200) 国海证券股份有限公司.

Table of company information for the third column, including (179) 上海华信证券有限责任公司, (180) 财通证券股份有限公司, (181) 上海华信证券有限责任公司, (182) 华鑫证券有限责任公司, (183) 瑞银证券有限责任公司, (184) 中山证券有限责任公司, (185) 国融证券股份有限公司, (186) 江海证券有限公司, (187) 国金证券股份有限公司, (188) 中国民族证券有限责任公司, (189) 宝华证券有限责任公司, (190) 长城国瑞证券有限公司, (191) 爱建证券有限责任公司, (192) 华融证券股份有限公司, (193) 天风证券股份有限公司, (194) 平安证券股份有限公司, (195) 安信证券股份有限公司, (196) 国海证券股份有限公司, (197) 国海证券股份有限公司, (198) 国海证券股份有限公司, (199) 国海证券股份有限公司, (200) 国海证券股份有限公司.

Table of company information for the fourth column, including (180) 财通证券股份有限公司, (181) 上海华信证券有限责任公司, (182) 华鑫证券有限责任公司, (183) 瑞银证券有限责任公司, (184) 中山证券有限责任公司, (185) 国融证券股份有限公司, (186) 江海证券有限公司, (187) 国金证券股份有限公司, (188) 中国民族证券有限责任公司, (189) 宝华证券有限责任公司, (190) 长城国瑞证券有限公司, (191) 爱建证券有限责任公司, (192) 华融证券股份有限公司, (193) 天风证券股份有限公司, (194) 平安证券股份有限公司, (195) 安信证券股份有限公司, (196) 国海证券股份有限公司, (197) 国海证券股份有限公司, (198) 国海证券股份有限公司, (199) 国海证券股份有限公司, (200) 国海证券股份有限公司.

报告期内,本基金未参与股指期货交易。
10. 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。

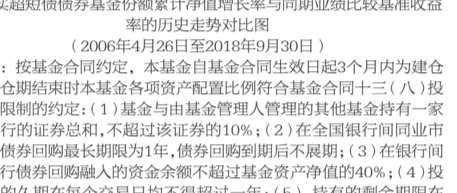
Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 存出保证金, 应收证券利息, 应付股利, etc.

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 存出保证金, 应收证券利息, 应付股利, etc.

(二) 注册登记机构
嘉实基金管理有限公司(同上)
(三) 律师事务所和经办律师

四、基金的投资
本基金名称: 嘉实超短债债券投资基金
五、基金类型
六、基金的投资目标
本基金通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本基金稳健,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。



七、基金的投资方向
本基金的投资范围包括固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级及以上的企业债和次级债券等;债券回购;央行票据、银行存款、资产支持证券以及法律、法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金不投资于可转换债券。

八、基金的投资策略
本基金主要目标是在保持传统债券市场基金的本基金稳健、高流动性特点的同时,通过适当延长投资组合的久期,投资于期限稍长的固定收益工具,获取更高的投资收益。因此本基金的投资策略也是在大货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略,一方面将基金的大部分资产投资于货币市场工具,保持基金资产的高流动性,同时提供稳定的收益;另一方面,通过积极挖掘,将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具,比如投资的企业债、金融债、次级债、浮动利率债等,为基金资产提供超额收益。本基金的投资策略主要包括:

1. 久期策略
为了保持本基金明显的收益-风险特征,本基金久期保持大于0.5年,小于1年。在分析宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业失业率、国际利率水平、汇率和财政货币政策等)的基础上,对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测,决定组合的久期,并通过不同债券剩余期限的合理分布,有效地控制利率波动对基金净值波动的影响,并尽可能提高基金收益。

2. 收益曲线策略
收益曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析,预测收益率曲线的变化趋势,并据此进行投资组合的构建。收益曲线策略有两方面的内容,一是收益率曲线本身的变化,根据收益曲线向上移动或向下移动,降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益曲线上下不同年限收益率的息差特征,通过骑乘策略,投资于具有投资价值债券。

3. 买入持有策略
本基金的投资对象主要是短期的固定收益类投资工具,一般情况下,本基金对这些短期固定收益投资工具,采取买入持有策略,以便降低基金净值波动的风险。

4. 相对价值挖掘策略
本基金在主要投资于货币市场工具的同时,深入挖掘市场上各类固定收益类投资产品,通过市场分割、信息不对称、发行人信用等等意外因素造成的短期市场失衡;新债、新债发行以及节日效应等等意外因素导致的分短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整资产配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

5. 无风险套利策略
本基金将充分利用投资范围广泛的特性,寻找各类可投资工具之间存在的套利机会,比如跨市场套利、跨品种套利等。

6. 报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
7. 报告期末未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
8. 报告期末未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
9. 报告期末未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