

B100

## 嘉实稳健开放式证券投资基金

[2011] 第一季度报告

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  
报告送出日期:2011年4月22日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。  
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2011年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金为嘉实理财产品系列证券投资基金之一，嘉实理财产品系列证券投资基金具有不同于市场定位的基金属性，包括但不限于：长期持有、清偿优先、本金保证、嘉实证券投资基金和嘉实货币证券投资基金，每只基金与对应的契约型开放式基金、基金合同和招募说明书。

本报告期内的财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	嘉实稳健混合
基金代码	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
报告期末基金份额总额	14,472,099,326.69份

在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取本基金增值收益和现金流分配的方式，力求本基金资产的中长期稳定增值。

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，取得稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票40%~75%，债券20%~55%，现金5%左右。

亚债比较基准 100% 大盘指数

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±0.8之间。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日 – 2011年3月31日)

1.本期已实现收益 171,240,832.26

2.本期利润 -35,966,199.28

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0024

4.期末基金份额净值 12,916,305,605.36

5.期末基金份额净值 0.892

注：①本期利润为收入减去必要的费用后的余额；②上本期公允价值变动收益；③上期基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入后实际收益水平将有所下降。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 净值增长率 (%) 业绩比较基准 收益率差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.45% 1.03% 3.51% 1.33% -3.96% -0.30%

3.2.2 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

序号 报告期(2003年7月9日至2011年3月31日) 期间净值增长率 (%) 期间净值增长率标准差 (%) ① ②

1 0.0063 海南橡胶 30,848,536 318,356,912.16 2.46

2 0.00170 上海建工 17,720,700 304,796,040.00 2.36

3 0.01006 大秦铁路 35,464,605 303,577,181.08 2.35

4 0.00208 新华锦 53,263,148 302,534,680.64 2.34

5 0.00063 中信国安 9,305,507 279,165,210.00 2.16

6 0.00568 泰州港 6,254,723 278,960,645.80 2.16

7 0.00630 中信证券 18,607,547 259,947,431.59 2.01

8 0.00970 中材国际 5,806,082 253,783,844.22 1.96

9 0.00188 宽敞煤业 6,485,399 223,746,265.50 1.73

10 0.00720 邵阳山 8,865,643 199,033,685.35 1.54

5.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债 债券 34,797,000.00 0.27

2 行业票据 债券 1,600,063,000.00 12.39

3 金融债券 债券 1,075,147,000.00 8.32

4 企业债券 债券 28,483,982.90 0.22

5 企业短期融资券 债券 - -

6 司转债 债券 499,995,395.01 3.87

7 其他 债券 - -

8 合计 - -

3,238,486,377.91 25.07

5.5 报告期未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

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1001060 10央行票据60 5,100,000 499,596,000.00 3.87

2 2100174 10央行票据74 5,000,000 489,100,000.00 3.79

3 113002 工行转债 3,920,600 469,531,056.00 3.64

4 110218 11国开18 3,700,000 369,038,000.00 2.86

5 100232 10国开33 2,000,000 197,420,000.00 1.53

5.6 报告期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支持证券投资明细

序号 代码 名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 880027 长虹CWB1 771,067 2,269,250.18 0.02

注：报告期内本基金持有的贵金属支持证券的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报编制日前一日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。

5.7 报告期内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限制的股票。

5.8 报告期内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限制之外的股票。

5.8.1 报告期内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限制之外的股票。

5.8.2 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限制之外的股票。

5.8.3 其他资产 货币资金

5.9 报告期期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113002 工行转债 469,531,056.00 3.64

2 128233 塔牌转债 30,464,339.01 0.24

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期内本基金持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额 14,984,821,242.93

本报告期基金总申购份额 221,088,704.45

本报告期基金总赎回份额 733,810,620.69

本报告期基金净申购变动份额 -

本报告期末基金份额总额 14,472,099,326.69

注：报告期内本基金的申购赎回费用实行前端收费模式，申购金额为人民币元，赎回金额为人民币元，赎回费用率为0.5%，赎回金额为人民币元，赎回费用为人民币元，赎回费用由赎回人承担，赎回费用归入基金财产。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 平时采用的执行情况

报告期内，本基金未发现不公平对待不同客户、利益输送等违反公平交易原则的现象。

4.2.2 与关联方交易的说明

报告期内，本基金未发现与关联方交易的说明。

4.2.3 与私募类机构因旗下基金的交易行为相关的说明

报告期内，本基金未发现与私募类机构因旗下基金的交易行为相关的说明。

4.2.4 其他

注：本基金的公平交易制度和执行情况详见本报告“四、公平交易情况”部分。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平时采用的执行情况

报告期内，本基金未发现不公平对待不同客户、利益输送等违反公平交易原则的现象。

4.3.2 与关联方交易的说明

报告期内，本基金未发现与关联方交易的说明。

4.3.3 与私募类机构因旗下基金的交易行为相关的说明

报告期内，本基金未发现与私募类机构因旗下基金的交易行为相关的说明。

4.3.4 其他

注：本基金的公平交易制度和执行情况详见本报告“四、公平交易情况”部分。

4.4 公平交易制度和执行情况

报告期内，本基金未发现不公平对待不同客户、利益输送等违反公平交易原则的现象。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望。

4.6 管理人对本基金投资策略的展望

本基金对投资策略的展望。

4.7 其他

注：本基金的公平交易制度和执行情况详见本报告“四、公平交易情况”部分。

5.1 报告期内基金资产组合情况

5.2 报告期内基金资产组合情况

5.3 报告期内基金资产组合情况

5.4 报告期内基金资产组合情况

5.5 报告期内基金资产组合情况

5.6 报告期内基金资产组合情况

5.7 报告期内基金资产组合情况

5.8 报告期内基金资产组合情况

5.9 报告期内基金资产组合情况

5.10 报告期内基金资产组合情况

5.11 报告期内基金资产组合情况

5.12 报告期内基金资产组合情况

5.13 报告期内基金资产组合情况

5.14 报告期内基金资产组合情况

5.15 报告期内基金资产组合情况

5.16 报告期内基金资产组合情况

5.17 报告期内基金资产组合情况

5.18 报告期内基金资产组合情况

5.19 报告期内基金资产组合情况

5.20 报告期内基金资产组合情况

5.21 报告期内基金资产组合情况

5.22 报告期内基金资产组合情况

5.23 报告期内基金资产组合情况

5.24 报告期内基金资产组合情况

5.25