嘉实超短债证券投资基金 2008年半年度报告摘要

§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。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2008年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期为2008年1月1日起至2008年6月30日止，本报告财务资料未经审计。本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本资料

(1)基金名称	嘉实超短债证券投资基金
(2)基金简称	嘉实超短债
(3)基金交易代码	070009(深交所净值揭示代码:160708)
(4)基金运作方式	契约型开放式
(5)基金合同生效日	2006年4月26日
(6)报告期末基金份额总额	2,166,758,078.48份
(7)基金合同存续期	不定期
(8)基金份额上市的证券交易所	无
(9)上市日期	无

2.2 基金产品说明

(1)投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳妥，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。
(2)投资策略	本基金投资策略是在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，通过价值挖掘，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，为基金资产提供超额收益。
(3)业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率。
(4)风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金，低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

2.3 基金管理人

(1)名称	嘉实基金管理有限公司
(2)信息披露负责人	胡勇钦
(3)联系电话	(010)65188866
(4)传真	(010)65185678
(5)电子邮箱	service@jsfund.cn

2.4 基金托管人

(1)名称	中国银行股份有限公司
(2)信息披露负责人	宁敏
(3)联系电话	(010)66594977
(4)传真	(010)66594942
(5)电子邮箱	tgxxpl@bank-of-china.com

2.5 信息披露

(1)信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》
(2)登载半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
(3)基金半年度报告置备地点	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

§3 主要财务指标和基金净值表现

下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。

3.1 主要财务指标 单位:元

序号	项目	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	16,139,559.25
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	17,148,616.30
3	加权平均基金份额本期利润	0.0139
4	期末可供分配利润	1,272,318.69
5	期末可供分配基金份额利润	0.0006
6	期末基金资产净值	2,168,030,397.17
7	期末基金份额净值	1.0006
8	加权平均净值利润率	1.39%
9	本期基金份额净值增长率	1.60%
10	份额累计净值增长率	6.95%

注1:本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

注2:执行新会计准则后财务指标披露方面的主要变化

(1)增加“本期利润”指标，新会计准则实施之前相关期间内本指标的计算方法为当期净收益加上当期因对金融资产进行估值产生的未实现利得变动额。原“本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”。

(2)原“加权平均份额本期净收益”名称调整为“加权平均份额本期利润”，计算方法在原“加权平均基金份额本期净收益”公式($\frac{P}{S_1+\sum_{i=1}^{n}M_i\times(n-i)/n}$)的基础上，将P改为本期利润。原“加权平均净值收益率”名称调整为“加权平均净值利润率”，计算方法在原公式的基础上，将P改为本期利润。

(3)原“期末可供分配收益”名称调整为“期末可供分配利润”，如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。原“期末可供分配份额收益”名称调整为“期末可供分配份额利润”，计算公式相应调整。

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.02%	0.33%	0.01%	-0.17%	0.01%
过去三个月	0.67%	0.01%	0.97%	0.01%	-0.30%	0.00%
过去六个月	1.60%	0.01%	1.94%	0.01%	-0.34%	0.00%
过去一年	4.24%	0.03%	3.66%	0.01%	0.58%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.95%	0.02%	6.15%	0.01%	0.80%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较

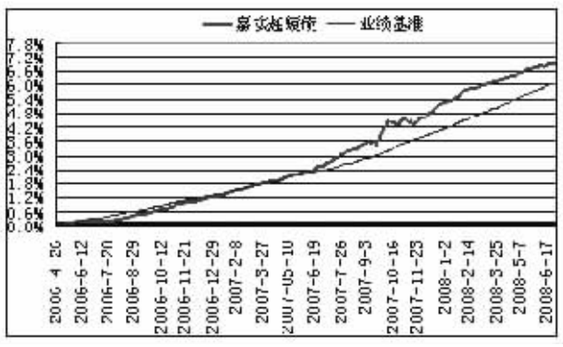

图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2008年6月30日)

注3:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定:(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%;(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期;(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年;(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%，投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

§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，注册资本1亿元，注册地上海，公司总部设在北京，并在深圳、成都设有分公司。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2008年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式基金、13只开放式基金，具体包括基金泰和、基金丰和、嘉实成长收益基金、嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实优质企业基金(原嘉实浦安保本基金转型)、嘉实货币市场基金、嘉实沪深300指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金、嘉实海外中国股票基金和嘉实研究精选基金，其中嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金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、企业年金基金、特定资产投资组合。

4.1.2 基金经理简介

吴洪坚先生，清华大学工学硕士，6年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心(上海)，从事人民币固定收益投资及交易等工作。2005年加入嘉实基金管理有限公司固定收益部工作，2006年10月28日至今任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明

在报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及其他有关法律法规、规章、行业监管规则和《嘉实超短债证券投资基金基金合同》的规定和约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内，本基金严格执行中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，无发生异常交易行为。本基金份额净值增长率为1.60%，投资风格相似的嘉实货币基金份额净值收益率为1.5221%，主要是两者估值方法不同，本基金采用公允价值估值，出现估值增值；嘉实货币市场基金持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值，无估值增值。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末本基金份额净值为1.0006元，本报告期基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准增长率为1.94%。

报告期内，央行连续多次提高金融机构法定存款准备金率至17.5%，以加强银行体系的流动性管理，引导货币信贷合理增长，导致债券市场的流动性受到影响，市场资金成本逐级抬高。在通胀数据持续高企的压制下，中长端券种的收益率水平出现上行，但在央行指导下各期限央行票据的收益率维持稳定。由于股票市场表现持续不佳，新股发行期间的跨市场回购套利空间相当有限。因市场资金缺乏合适的投资标的，高票息且高信用等级的中期票据和短期融资券表现较好，交易所分离债的表现也相当突出。

报告期内，我们秉持控制风险、谨慎操作的原则，根据市场状况及时调整操作策略，争取稳健的投资回报。因新股发行期间逆回购套利机会减少，期初本基金逐步增加债券资产的配置比例，并提高组合久期和杠杆比例。但随后因基金规模波动有所加大，组合资产配置计划难以正常执行，流动性要求相对突出，收益较低的高流动性资产配置比例大幅提高，而部分券种的被动减持也导致了基金组合的业绩低于正常水平。

4.5 宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

展望下半年，虽然宏观经济有减速趋势，但通涨压力和加息预期依然存在，放松货币政策的空间有限，债券市场仍受到压制。此外，大盘新股发行可能提速，预计将对市场资金面造成较大的短期压力。下半年本基金仍将秉持稳健原则，控制组合债券资产比例和久期，以保障基金流动性的要求。此外，在新股发行期间具备较大的组合弹性，以把握阶段性的投资机会。此外，本基金将在日常操作中继续择机运用杠杆操作，以提高组合收益水平。

§5 托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实超短债证券投资基金(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。

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。

本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整(注:财务会计报告中的“风险管理”部分未在托管人复核范围内)。

§6 财务会计报告

6.1 基金会计报表

以下各项除特别注明外，金额单位为人民币元。

6.1.1 资产负债表

项目	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产			
银行存款		2,387,198.32	10,213,574.90
结算备付金		3,710,008.78	1,700,008.00
交易性金融资产	6.2.4(1)	1,846,953,000.00	267,335,603.80
其中:股票投资			
债券投资		1,846,953,000.00	267,335,603.80
资产支持证券投资			
衍生金融资产	6.2.4(2)		
买入返售金融资产		300,000,570.00	60,000,210.00
应收利息	6.2.4(3)	23,398,830.93	5,308,614.93
应收申购款		161,558,782.63	14,019,593.92
其他资产			
资产总计		2,338,008,390.66	358,577,605.55
负债和所有者权益			
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		166,599,796.70	
应付赎回款		1,090,361.84	2,067,103.81
应付管理人报酬		938,884.78	107,932.43
应付托管费		320,594.79	36,854.98
应付销售服务费		572,490.72	65,812.45
应付交易费用	6.2.4(4)	51,253.91	7,633.74
应付税费		1,567.20	
应付利息	6.2.4(5)	12,983.57	
应付利润			2,401,437.74
其他负债	6.2.4(6)	390,059.98	325,511.15
负债合计		169,977,993.49	5,012,286.30
所有者权益			
实收基金	6.2.4(7)	2,166,758,078.48	353,158,638.46
未分配利润		1,272,318.69	406,680.79
所有者权益合计		2,168,030,397.17	353,565,319.25
负债和所有者权益总计		2,338,008,390.66	358,577,605.55
基金份额总额(份)		2,166,758,078.48	353,158,638.46
基金份额净值		1.0006	1.0012

6.1.2 利润表

项目	附注	本期	上年同期
收入			
利息收入		24,850,839.14	10,487,661.61
其中:存款利息收入		132,711.91	89,138.41
债券利息收入		18,761,215.31	9,296,367.57
资产支持证券利息收入			
买入返售金融资产收入		5,956,911.92	1,102,155.63
投资收益		233,436.49	1,081,400.32
其中:股票投资收益	6.2.4(8)		
债券投资收益	6.2.4(9)	233,436.49	1,081,400.32
资产支持证券投资收益	6.2.4(10)		
公允价值变动收益	6.2.4(11)	-1,009,057.05	14,270.39
其他收入	6.2.4(12)		
收入合计		24,075,218.58	11,583,332.32
费用			
管理人报酬		2,357,387.70	1,171,629.11
托管费		804,961.67	400,068.47
销售服务费		1,437,431.51	714,407.92
交易费用	6.2.4(13)	18,353.68	30,108.49
利息支出		3,153,959.91	1,480,421.07
其中:卖出回购金融资产支出		3,153,959.91	1,480,421.07
其他费用	6.2.4(14)	163,564.86	164,107.28
费用合计		7,935,659.33	3,960,742.34
利润总额		16,139,559.25	7,622,589.98

6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	353,158,638.46	406,680.79	353,565,319.25
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)		16,139,559.25	16,139,559.25
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,813,599,440.02	3,597,903.63	1,817,197,343.65
其中:基金申购款	16,776,548,242.54	33,975,131.65	16,810,523,374.19
基金赎回款	-14,962,948,802.52	-30,377,228.02	-14,993,326,030.54
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		-18,871,824.98	-18,871,824.98
期末所有者权益(基金净值)	2,166,758,078.48	1,272,318.69	2,168,030,397.17
项目	上年同期		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	832,209,279.96	444,666.31	832,653,946.27
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)		7,622,589.98	7,622,589.98
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-368,565,031.46	-560,945.05	-369,125,976.51
其中:基金申购款	1,059,206,911.74	1,494,348.27	1,060,701,260.01
基金赎回款	-1,427,771,943.20	-2,055,293.32	-1,429,827,236.52
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		-7,097,359.97	-7,097,359.97
期末所有者权益(基金净值)	463,644,248.50	408,951.27	464,053,199.77

6.2 半年度会计报表附注

6.2.1 会计政策、会计估计及其变更

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度7月1日至12月31日会计报表相一致。自2007年7月1日起，本基金执行新企业会计准则(财政部2006年2月15日颁布)、《证券投资基金会计核算业务指引》(中国证券业协会2007年5月15日颁布)以及修改后的本基金基金合同和中国证监会允许的基金行业实务操作的相关规定。本基金按照《企业会计准则第38号-首次执行企业会计准则》的相关规定，对2007年1月1日起至2007年6月30日止期间的财务报表予以追溯调整。

按新会计准则调整原会计准则的所有者权益及净损益:

项目	2007年1月1日所有者权益	2007-1-1至2007-6-30净收益/利润总额	2007年6月30日所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	832,653,946.27	7,608,319.59	464,053,199.77
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		14,270.39	
按企业会计准则列报的金额	832,653,946.27	7,622,589.98	464,053,199.77

6.2.2 重大会计差错内容和更正金额

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.2.3 关联方关系及关联方交易

(一)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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

(二)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(金额单位:人民币元)。

1. 通过关联方席位进行的交易:无

2. 关联方报酬

(1)基金管理人报酬

支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.41%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.41% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费2,357,387.70元(上年同期:1,171,629.11元)。

(2)基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.14%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:

日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.14% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费804,961.67元(上年同期:400,068.47元)。

(3)基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务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，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。本基金在本会计期间需支付基金销售服务费1,437,431.51元(上年同期:714,407.92元)。

本基金在本期需向关联方支付的基金销售服务费如下:

项目	本期	上年同期
嘉实基金管理有限公司	142,779.05	89,434.44
中国银行股份有限公司	234,373.87	467,664.92
合计	377,152.92	557,099.36

3.与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

项目	本期	上年同期
回购成交金额	18,007,820,000.00	1,039,640,000.00
回购利息收入		
回购利息支出	1,927,569.76	189,652.66
债券成交金额	1,703,075,683.19	251,996,470.83

4. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款和结算备付金由基金托管人中国银行股份有限公司保管。基金托管人于2008年6月30日保管的银行存款余额为2,387,198.32元(2007年6月30日:53,462,569.57元)。期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为76,905.42元(2007年6月30日:84,223.87元)。

5. 联方投资本基金情况

(1)基金管理人投资本基金情况

项目	本期			上年同期		
	数量(份)	占基金总份额比例	适用费率	数量(份)	占基金总份额比例	适用费率
报告期期初持有基金份额	20,325,446.74	5.76%		20,325,446.74	2.44%	
报告期间买入基金份额						
报告期间卖出基金份额						
报告期末持有基金份额	20,325,446.74	0.94%		20,325,446.74	4.38%	

(2)基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金。

6.2.4 报告期末流通转让受到限制的基金资产

报告期末债券正回购交易中作为质押的债券

截至2008年6月30日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额166,599,796.70元，是以如下债券作为质押:

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量	期末估值总额
080404	08农发04	2008-7-1	100.10	1,700,000	170,170,000.00

截至2008年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0.00元。

§7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	1,846,953,000.00	79.00%
买入返售证券	300,000,570.00	12.83%
其中:买断式回购的买入返售证券		
银行存款和清算备付金合计	6,097,207.10	0.26%
资产支持证券		
其他资产	184,957,613.56	7.91%
合计	2,338,008,390.66	100%

7.2 报告期末债券投资组合

7.2.1 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券		
2	金融债券	1,318,844,000.00	60.83%
3	央行票据	338,170,000.00	15.60%
4	企业债券	189,939,000.00	8.76%
5	资产支持证券		
合计		1,846,953,000.00	85.19%

7.2.2 基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值的比例
1	080410	08农发10	299,460,000.00	13.81%
2	0801046	08央行票据46	288,240,000.00	13.30%
3	080403	08农发03	270,756,000.00	12.49%
4	080404	08农发04	210,210,000.00	9.70%
5	080409	08农发09	199,180,000.00	9.19%

7.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

7.4 投资组合报告附注

7.4.1 基金计价方法说明

(1)本基金的基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点第五位四舍五入。

(2)本基金估值采用:在证券交易所市场，实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下按成本估值;在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值;同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值;其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值(详细内容参见本基金管理人2007年9月28日发布的《关于调整旗下证券投资基金估值方法和会计政策的公告》)。

7.4.2 本报告期内需说明的证券投资决策程序:无

7.4.3 其他资产的构成

序号	项目	期末金额(元)
1	存出保证金	
2	应收证券交易清算款	
3	应收利息	23,398,830.93
4	应收申购款	161,558,782.63
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
合计		184,957,613.56

§8 基金份额持有人情况

8.1 报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数(户)	18,463
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	117,356.77

8.2 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量(份)	占总份额的比例
报告期末基金份额总额	2,166,758,078.48	100%
其中:机构投资者持有的基金份额	578,370,237.57	26.69%
个人投资者持有的基金份额	1,588,387,840.91	73.31%

8.3 报告期末本基金管理人从业人员持有本基金情况

项目	持有基金份额总量(份)	占总份额的比例
本基金管理人持有本基金的所有从业人员	2,228,840.28	0.1028%

§9 开放式基金份额变动情况

项目	基金份额总额(份)
基金合同生效日基金份额总额	6,146,255,272.70
报告期期初基金份额总额	353,158,638.46
报告期间基金总申购份额	16,776,548,242.54
报告期间基金总赎回份额	14,962,948,802.52
报告期期末基金份额总额	2,166,758,078.48

§10 重大事件揭示

10.1 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无重大人事变动情况

10.3 本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 报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 基金收益分配

报告期内，本基金实施了6次收益分配，分红金额为18,871,824.98元。

10.6 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.7 报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

(1)基金租用席位的选择标准和程序

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，确定选择证券公司，向其租用本基金专用交易席位。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

(2)报告期内通过证券公司专用席位进行债券、债券回购情况

证券公司名称	债券		债券回购		佣金	
	债券成交金额(元)	占债券成交总额的比例	债券回购成交金额(元)	占债券回购成交总额的比例	佣金(元)	占佣金总量比例
中国建银投资证券公司	1,434,325.00	100%	1,897,000,000.00	100%		
合计	1,434,325.00	100%	1,897,000,000.00	100%		

(3)报告期内租用证券公司席位的变更情况:无

10.9 报告期内本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的其他临时报告

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于旗下开放式基金通过中国建设银行开办日常基金转换业务公告	2008年1月18日	包括本基金
2	关于旗下开放式基金通过兴业银行和深圳平安银行开办定期定额投资业务的公告	2008年1月29日	包括本基金
3	嘉实超短债证券投资基金2008年第一次收益分配公告	2008年1月29日	
4	关于旗下开放式基金通过中国农业银行开办基金转换业务的公告	2008年2月18日	包括本基金
5	嘉实超短债证券投资基金2008年第二次收益分配公告	2008年2月26日	
6	关于对浦发东方借记卡和招商借记卡持有人开通嘉实直销网上交易定期定额申购业务的公告	2008年3月5日	包括本基金
7	关于增加东莞证券和万联证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2008年3月5日	包括本基金
8	关于嘉实策略、嘉实优质、嘉实超短债、嘉实海外基金通过交通银行等17家代销机构开办定期定额投资业务的公告	2008年3月13日	
9	关于旗下开放式基金参加中国农业银行基金定期定额投资费率优惠活动的公告	2008年3月14日	包括本基金
10	关于变更公司股东出资比例的公告	2008年3月20日	
11	嘉实超短债证券投资基金2008年第三次收益分配公告	2008年3月25日	
12	关于增加大同证券、齐鲁证券、国金证券和财通证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2008年4月23日	包括本基金
13	嘉实超短债证券投资基金2008年第四次收益分配公告	2008年4月29日	
14	关于增加第一创业证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2008年4月30日	包括本基金
15	关于增加中投证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2008年5月15日	包括本基金
16	关于增加宁波银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2008年5月21日	包括本基金
17	嘉实超短债证券投资基金2008年第五次收益分配公告	2008年5月27日	
18	关于增加瑞银证券代销机构及其网上交易费率优惠和开办定投业务的公告	2008年6月6日	包括本基金
19	关于调整招商银行借记卡持卡人通过嘉实网上直销转换费率的公告	2008年6月10日	包括本基金
20	关于旗下开放式基金参加交通银行基金定期定额投资费率优惠活动的公告	2008年6月16日	包括本基金
21	关于增加华鑫证券代销机构并开办定期定额投资业务的公告	2008年6月20日	包括本基金
22	嘉实超短债证券投资基金2008年第六次收益分配公告	2008年6月24日	
23	关于旗下开放式基金通过湘财证券和国联证券开办定期定额投资业务的公告	2008年6月27日	包括本基金
24	关于旗下开放式基金通过德邦证券和东海证券开办定期定额投资业务的公告	2008年6月28日	包括本基金

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

2008年8月26日