

# 嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金

## 2007 年半年度报告

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2007 年 8 月 28 日

## 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 27 日复核了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、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 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止，本报告财务资料未经审计。

## 目 录

<b>§1</b>	基金简介.....	1
<b>§2</b>	主要财务指标和基金净值表现.....	2
<b>§3</b>	管理人报告.....	4
	3.1 基金管理人及基金经理情况.....	4
	3.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明.....	4
	3.3 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	5
	3.4 宏观经济、证券市场及行业走势简要展望.....	5
<b>§4</b>	托管人报告.....	5
<b>§5</b>	财务会计报告.....	6
	5.1 基金会计报表.....	6
	5.2 半年度会计报表附注.....	8
<b>§6</b>	投资组合报告.....	13
<b>§7</b>	基金份额持有人情况.....	17
<b>§8</b>	开放式基金份额变动情况.....	18
<b>§9</b>	重大事件揭示.....	18
<b>§10</b>	备查文件目录.....	20

## §1 基金简介

### 1.1 基金基本资料

(1) 基金名称	嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金
(2) 基金简称	嘉实浦安保本（深交所净值揭示简称：嘉实保本）
(3) 基金交易代码	070007（深交所净值揭示代码：160707）
(4) 基金运作方式	契约型开放式
(5) 基金合同生效日	2004 年 12 月 1 日
(6) 报告期末基金份额总额	241,420,888.58 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

### 1.2 基金产品说明

(1) 投资目标	运用投资组合保险技术，力争在保本到期日，保证投资本金安全的同时，谋求基金资产的稳定增值。
(2) 投资策略	在保本期内，按照固定比例投资组合保险机制，动态调整股票、债券投资比例。债券投资以追求本金安全为目的，主要投资于交易所和银行间债券市场债券；股票投资采取灵活配置、积极管理，选择优势行业和优势企业，基于市场有效性研究、寻找套利机会的策略。
(3) 业绩比较基准	保本周期同期限的 3 年期银行定期存款税后收益率。
(4) 风险收益特征	在保本期内，本基金为证券投资基金中的低风险投资品种。

### 1.3 基金管理人

(1) 名称	嘉实基金管理有限公司
(2) 注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室
(3) 办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
(4) 邮政编码	100005（办公地址）
(5) 互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
(6) 法定代表人	王忠民
(7) 总经理	赵学军

(8) 信息披露负责人	胡勇钦
(9) 联系电话	(010) 65188866
(10) 传真	(010) 65185678
(11) 电子邮箱	service@jsfund.cn

#### 1.4 基金托管人

(1) 名称	上海浦东发展银行股份有限公司
(2) 注册地址	上海市浦东新区浦东南路 500 号
(3) 办公地址	上海市中山东一路 12 号
(4) 邮政编码	200120
(5) 互联网网址	http://www.spdb.com.cn
(6) 法定代表人	吉晓辉
(7) 信息披露负责人	周倩芝
(8) 联系电话	(021) 61618888
(9) 传真	(021) 63602540
(10) 电子邮箱	zhouqz@spdb.com.cn

#### 1.5 信息披露

(1) 信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
(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

#### 1.6 基金注册登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

## §2 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。

### 2.1 主要财务指标

单位: 元

序号	项目	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	102, 288, 886. 91

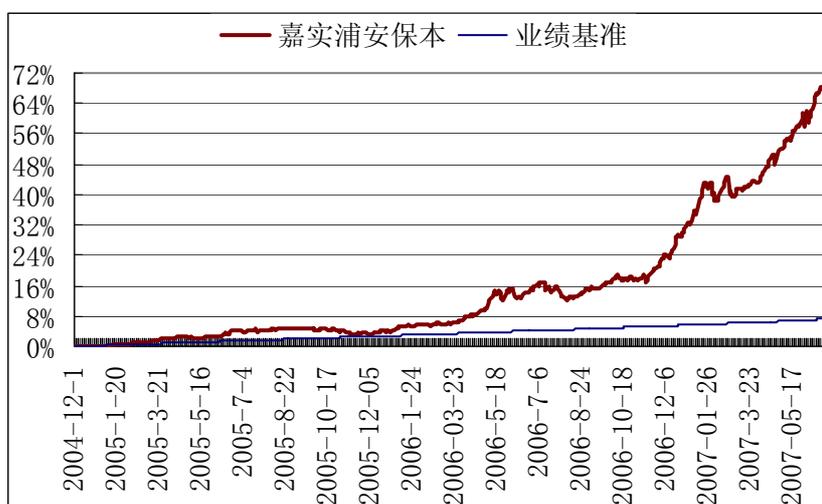
2	基金份额本期净收益	0.4071
3	期末可供分配基金收益	126,071,475.00
4	期末可供分配基金份额收益	0.5222
5	期末基金资产净值	373,090,082.75
6	期末基金份额净值	1.545
7	基金加权平均净值收益率	28.75%
8	本期基金份额净值增长率	24.10%
9	基金份额累计净值增长率	64.62%

## 2.2 基金净值表现

### 2.2.1 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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	3.00%	0.89%	0.29%	0.01%	2.71%	0.88%
过去三个月	14.87%	0.74%	0.82%	0.01%	14.05%	0.73%
过去六个月	24.10%	0.77%	1.56%	0.01%	22.54%	0.76%
过去一年	42.13%	0.63%	3.01%	0.01%	39.12%	0.62%
自基金合同生效 起至今	64.62%	0.44%	7.25%	0.01%	57.37%	0.43%

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



图：嘉实浦安保本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

(2004年12月1日至2007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。本报告期内，本基金的各项投资比例符合基金合同第十九条（（一）、2、投资范围和（五）投资组合比例限制）的规定：

（1）持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；（2）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发行的证券，不得超过该证券的10%；（3）基金

财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；（4）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；（5）在本基金合同生效后一个月内，股票投资比例不超过基金资产净值的 20%。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但应在 10 个交易日内进行调整，并符合相应的规定。

## §3 管理人报告

### 3.1 基金管理人及基金经理情况

#### 3.1.1 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，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资格和 QDII 资格。2005 年公司引入新股东德意志资产管理（亚洲）有限公司，成为中外合资基金管理公司。

截止 2007 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、11 只开放式证券投资基金，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、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实 300 指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金和嘉实策略增长基金，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、企业年金基金投资组合。

#### 3.1.2 基金经理简介

邹唯先生，硕士研究生，5 年证券从业经历。曾任职于长城证券研究发展中心，2003 年 6 月进入嘉实基金管理有限公司研究部工作，2006 年 8 月至今任本基金基金经理。

### 3.2 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《嘉实浦安保本混合型开放式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。

### 3.3 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 1.545 元，本报告期份额净值增长率为 24.10%，同期业绩比较基准增长率为 1.56%，本基金净值增长率超越业绩比较基准收益率 22.54 个百分点。

报告期内，经济增长连续两个季度超越 11%，上市公司因此受益，银行、地产等诸多行业的中报超越市场预期。股票市场在是否存在泡沫的争论下，不断创出新高，期间沪深 300 指数最高涨幅达到了 108%，但是 5 月底以来，市场没能延续单边上扬的走势，出现大幅震荡，期间市场结构性泡沫开始破裂，题材股全面退潮，基金重仓的蓝筹股重新战胜市场。从行业表现来看，报告期内贸易、化纤、纺织服装、交通仓储、有色等跑赢大盘，而通信、传媒、金融、石化、铁路运输表现不佳。

### 3.4 宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

展望未来，我们认为，经济将继续运行在上升通道中，并且由于消费对经济增长的贡献度增加，经济结构进一步改善，经济增长的质量将得到提升，虽然未来调控措施还将继续，但是我们相信不会改变经济长期运行趋势，下半年仍将维持高增长、温和通涨的格局，但是否能够再次大幅超越预期还有待观察。

下半年，政府仍可能采取一系列措施来抑制过剩的流动性，例如上调基准利率、提高存款准备金率、设立国家投资公司、减免利息税等，鉴于当前估值水平已经反映了宏观经济的良好预期，我们认为，短期内市场仍将维持震荡格局。在股票投资方面，本基金将重点关注消费升级、资产注入、节能降耗、技术进步、人民币升值五大类投资机会。

## §4 托管人报告

上海浦东发展银行股份有限公司依据《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金合同》与《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金托管协议》，托管嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金。

2007 年上半年，在对嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

2007 年上半年，上海浦东发展银行股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等进行了认真的复核，未发现基金管理人损害基金份额持有人利益的行为。

经上海浦东发展银行股份有限公司资产托管部复核，由嘉实基金管理有限公司编制的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、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §5 财务会计报告

### 5.1 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。

#### 5.1.1 资产负债表

项目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
<b>资 产</b>			
银行存款		67,779,195.84	1,801,996.72
清算备付金		223,263.74	820,190.44
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券交易清算款			
应收股利			
应收利息	5.2.4(1)	5,589,355.34	2,701,863.20
应收申购款		359,548.12	121,968.40
其他应收款			
股票投资市值	5.2.4(3)	102,889,097.87	123,410,131.85
其中：股票投资成本		73,647,418.04	68,829,484.17
债券投资市值	5.2.4(3)	198,509,825.70	245,485,127.20
其中：债券投资成本		197,110,081.25	242,934,568.01
权证投资市值	5.2.4(3)	129,434.25	
其中：权证投资成本			
买入返售证券			
待摊费用	5.2.4(2)		
<b>资产合计</b>		<b>375,729,720.86</b>	<b>374,591,277.81</b>
<b>负债及持有人权益</b>			
<b>负 债</b>			
应付证券清算款		1,044,845.20	
应付赎回款		623,852.51	868,857.21
应付赎回费		8,841.70	7,643.49
应付管理人报酬		298,040.52	312,152.38

应付托管费		59,608.10	62,430.47
应付佣金	5.2.4(4)	155,309.35	60,799.51
应付利息			
应付收益			
未交税金			
其他应付款	5.2.4(5)	250,786.45	251,900.00
卖出回购证券款			
短期借款			
预提费用	5.2.4(6)	198,354.28	100,000.00
其他负债			
<b>负债合计</b>		<b>2,639,638.11</b>	<b>1,663,783.06</b>
<b>持有人权益</b>			
实收基金	5.2.4(7)	241,420,888.58	286,702,861.95
未实现利得	5.2.4(8)	5,597,719.17	38,983,453.77
未分配收益		126,071,475.00	47,241,179.03
<b>持有人权益合计</b>		<b>373,090,082.75</b>	<b>372,927,494.75</b>
<b>负债与持有人权益总计</b>		<b>375,729,720.86</b>	<b>374,591,277.81</b>
附注：基金份额净值		1.545	1.301

### 5.1.2 经营业绩表及收益分配表

#### (1) 经营业绩表

项目	附注	本期	去年同期
<b>收入</b>			
股票差价收入	5.2.4(9)	100,112,059.81	9,632,921.10
债券差价收入	5.2.4(10)	-13,135.94	6,144,799.94
权证差价收入	5.2.4(11)		2,212,484.89
债券利息收入		4,017,046.34	6,509,578.01
存款利息收入		187,794.17	236,892.06
股利收入		479,971.63	805,928.02
买入返售证券收入			
其他收入	5.2.4(12)	330,743.96	827,306.41
<b>收入合计</b>		<b>105,114,479.97</b>	<b>26,369,910.43</b>
<b>费用</b>			
基金管理人报酬		1,764,092.94	2,462,390.75
基金托管费		352,818.54	492,478.16
卖出回购证券支出		493,442.24	
利息支出			
其他费用	5.2.4(13)	215,239.34	215,623.09
其中：上市年费			
信息披露费		148,765.71	148,765.71
审计费用		49,588.57	49,588.57
<b>费用合计</b>		<b>2,825,593.06</b>	<b>3,170,492.00</b>

基金净收益		102,288,886.91	23,199,418.43
加：未实现估值增值/(减值)变动数		-26,360,348.34	26,821,048.75
基金经营业绩		75,928,538.57	50,020,467.18

## (2) 收益分配表

项目	附注	本期	去年同期
本期基金净收益		102,288,886.91	23,199,418.43
加：期初基金净收益		47,241,179.03	12,804,164.58
加：本期申购损益平准金		17,093,424.33	255,469.56
减：本期赎回损益平准金		25,173,698.09	7,971,659.96
可供分配基金净收益		141,449,792.18	28,287,392.61
减：本期已分配基金净收益		15,378,317.18	
期末基金净收益		126,071,475.00	28,287,392.61

### 5.1.3 基金净值变动表

项目	本期	去年同期
一、期初基金净值	372,927,494.75	578,788,401.97
二、本期经营活动		
基金净收益	102,288,886.91	23,199,418.43
未实现估值增值/(减值)变动数	-26,360,348.34	26,821,048.75
经营活动产生的基金净值变动数	75,928,538.57	50,020,467.18
三、本期基金份额交易		
基金申购款	69,485,260.49	6,785,720.35
基金赎回款	-129,872,893.88	-215,689,722.85
基金份额交易产生的基金净值变动数	-60,387,633.39	-208,904,002.50
四、本期向基金份额持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-15,378,317.18	
五、期末基金净值	373,090,082.75	419,904,866.65

## 5.2 半年度会计报表附注

### 5.2.1 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、会计估计与上年度会计报表一致。

### 5.2.2 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。

### 5.2.3 关联方关系及关联方交易

#### (一) 关联方关系

关联方名称	与本系列基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构

上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中诚信托投资有限责任公司	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
国都证券有限责任公司	控股股东的子公司、基金代销机构
中诚期货经纪有限责任公司	控股股东的子公司

## （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

报告期内本基金未通过关联方交易席位进行证券交易。

### 2. 关联方报酬

#### （1）基金管理费

支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.0% 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：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

本基金本报告期需支付基金管理费 1,764,092.94 元（2006 年上半年：2,462,390.75 元），其中从基金管理费收入中列支的担保费 352,818.54 元（2006 年上半年：492,478.16 元）。

#### （2）基金托管费

支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

本基金本报告期需支付基金托管费 352,818.54 元（2006 年上半年：492,478.16 元）。

### 3. 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：无

### 4. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 67,779,195.84 元（2006 年 6 月 30 日：28,862,933.06 元）。本报告期内本基金由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 184,894.14 元（2006 年上半年：235,322.06 元）。

## 5 关联方投资本基金情况

本报告期及上年同期，无涉及关联方投资于本基金份额。

### 6. 报告期末本基金管理人基金从业人员持有本基金情况：无

## 5.2.4 基金会计报表重要项目说明

以下各项除特别注明外，金额单位为人民币元。

### (1) 应收利息

项目	2007 年 6 月 30 日
应收债券利息	5,549,937.17
应收银行存款利息	39,327.72
应收清算备付金利息	90.45
合计	5,589,355.34

### (2) 待摊费用：无

### (3) 投资估值增值

项目	2007 年 6 月 30 日
股票投资	29,241,679.83
债券投资	1,399,744.45
权证投资	129,434.25
合计	30,770,858.53

### (4) 应付佣金

证券公司名称	2007 年 6 月 30 日
中国银河证券有限责任公司	67,521.31
山西证券有限责任公司	87,788.04
合计	155,309.35

### (5) 其他应付款

项目	2007 年 6 月 30 日
应付结算服务费	550.00
应付交易手续费	236.45
应付深圳交易所席位保证金	250,000.00
合计	250,786.45

### (6) 预提费用

项目	2007 年 6 月 30 日
预提审计费用	49,588.57
预提信息披露费	148,765.71
其中：预提中证报信息披露费	49,588.57
预提上证报信息披露费	49,588.57
预提时报信息披露费	49,588.57
合计	198,354.28

### (7) 实收基金

项目	本期	
	基金份额（份）	实收基金
期初数	286,702,861.95	286,702,861.95
本期因申购的增加数	47,329,501.46	47,329,501.46
其中：红利再投资		
本期因赎回的减少数	92,611,474.83	92,611,474.83
2007 年 6 月 30 日	241,420,888.58	241,420,888.58

**(8) 未实现利得**

项目	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	57,131,206.87	-18,147,753.10	38,983,453.77
本期净变动数	-26,360,348.34	-7,025,386.26	-33,385,734.60
本期申购基金份额		5,062,334.70	5,062,334.70
其中：红利再投资			
本期赎回基金份额		-12,087,720.96	-12,087,720.96
2007 年 6 月 30 日	30,770,858.53	-25,173,139.36	5,597,719.17

**(9) 股票差价收入**

项目	本期
卖出股票成交总额	181,024,908.98
减：应付佣金总额	151,990.16
减：卖出股票成本总额	80,760,859.01
股票差价收入	100,112,059.81

**(10) 债券差价收入**

项目	本期
卖出及到期兑付债券结算金额	46,968,509.08
减：应收利息总额	1,157,158.26
减：卖出及到期兑付债券成本总额	45,824,486.76
债券差价收入	-13,135.94

**(11) 权证差价收入：无****(12) 其他收入**

项目	本期
赎回基金补偿收入	304,030.94
增发手续费返还	
新股申购手续费返还	
转换费收入	26,713.02
合计	330,743.96

**(13) 其他费用**

项目	本期
银行费用	4,413.54
信息披露费	148,765.71
审计费用	49,588.57
交易所回购交易费用	3,134.02
银行间交易费用	37.50
银行间帐户维护费	9,000.00
银行间结算服务费	300.00
其他	
合计	215,239.34

**(14) 本期已分配基金净收益**

权益登记日	收益分配金额	累计收益分配金额
2007 年 3 月 16 日	每 10 份基金份额派发现金红利 0.60 元	15,378,317.18
合计		15,378,317.18

**(15) 银行存款**

项目	2007年6月30日
活期存款	67,779,195.84
定期存款	
合计	67,779,195.84

(16) 报告期内本基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价为 55.25 元 (2006 年上半年: 788,367.50 元), 已全额冲减股票投资成本。

### 5.2.5 报告期末流通转让受到限制的基金资产

- (1) 截至2007年6月30日本基金持有因股权分置改革而暂时停牌的股票: 无
- (2) 截至 2007 年 6 月 30 日本基金持有非公开发行的股票: 无
- (3) 截至2007年6月30日本基金因认购新股 (IPO及增发) 而流通受限的股票: 无
- (4) 截至 2007 年 6 月 30 日本基金持有的流通受限制不能自由转让的债券: 无

### 5.2.6 税项说明

#### 1. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》, 自2005年1月24日起, 按1%的税率缴纳证券(股票)印花税。

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》, 自2005年6月13日起, 对于基金从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获得的股权转让, 暂免征收印花税。

根据财政部、国家税务总局财税字 [2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定, 从2007年5月30日起, 按3%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

#### 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》, 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》, 自2005年6月13日起, 对于基金从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、现金等而获得的收入, 暂免征收企业所得税。

#### 3. 个人所得税

对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入, 由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的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，按照财税字[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》的规定，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》，自2005年6月13日起，对于基金从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、现金等而获得的收入，暂免征收个人所得税。

## §6 投资组合报告

### 6.1 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	102,889,097.87	27.38%
债券	198,509,825.70	52.83%
权证	129,434.25	0.04%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	68,002,459.58	18.10%
其他资产	6,198,903.46	1.65%
合计	375,729,720.86	100.00%

### 6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业		
B 采掘业	3,572,707.20	0.96%
C 制造业	48,738,550.86	13.07%
C0 食品、饮料	4,919,600.00	1.32%
C1 纺织、服装、皮毛	1,119,000.00	0.30%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	5,562,860.00	1.49%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	6,625,622.60	1.78%
C5 电子	1,798,530.00	0.48%
C6 金属、非金属	9,480,550.00	2.54%
C7 机械、设备、仪表	15,176,388.26	4.07%
C8 医药、生物制品	4,056,000.00	1.09%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	1,965,252.24	0.53%
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	13,144,220.20	3.52%
G 信息技术业	4,073,500.00	1.09%
H 批发和零售贸易	8,105,223.40	2.17%

I 金融、保险业	13,281,404.72	3.56%
J 房地产业	1,912,000.00	0.51%
K 社会服务业	3,955,300.00	1.06%
L 传播与文化产业	4,140,939.25	1.11%
M 综合类		
合计	102,889,097.87	27.58%

### 6.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	293,724	7,219,735.92	1.94%
2	600386	*ST 北巴	214,390	3,790,415.20	1.02%
3	000718	苏宁环球	100,000	3,355,000.00	0.90%
4	000419	通程控股	150,000	3,151,500.00	0.84%
5	000423	东阿阿胶	120,000	3,134,400.00	0.84%
6	600880	博瑞传播	110,000	2,698,300.00	0.72%
7	600009	上海机场	70,000	2,660,700.00	0.71%
8	000568	泸州老窖	60,000	2,526,000.00	0.68%
9	600588	用友软件	50,000	2,441,500.00	0.65%
10	600519	贵州茅台	20,000	2,393,600.00	0.64%
11	601166	兴业银行	67,000	2,351,030.00	0.63%
12	600016	民生银行	195,160	2,230,678.80	0.60%
13	600150	沪东重机	15,534	2,147,420.16	0.58%
14	600269	赣粤高速	151,500	2,101,305.00	0.56%
15	600028	中国石化	153,760	2,032,707.20	0.54%
16	600761	安徽合力	69,966	1,994,031.00	0.53%
17	600900	长江电力	129,977	1,965,252.24	0.53%
18	000002	万科A	100,000	1,912,000.00	0.51%
19	600423	柳化股份	107,700	1,911,675.00	0.51%
20	600529	山东药玻	150,000	1,894,500.00	0.51%
21	600697	欧亚集团	90,000	1,827,900.00	0.49%
22	601006	大秦铁路	120,000	1,816,800.00	0.49%
23	600590	泰豪科技	97,050	1,796,395.50	0.48%
24	000898	鞍钢股份	100,000	1,769,000.00	0.47%
25	600693	东百集团	99,990	1,765,823.40	0.47%
26	600352	浙江龙盛	160,000	1,724,800.00	0.46%
27	600138	中青旅	70,000	1,721,300.00	0.46%
28	600143	金发科技	43,940	1,693,447.60	0.45%
29	000709	唐钢股份	130,000	1,661,400.00	0.45%
30	000625	长安汽车	100,000	1,648,000.00	0.44%
31	000063	中兴通讯	30,000	1,632,000.00	0.44%
32	600690	青岛海尔	100,000	1,600,000.00	0.43%
33	600312	平高电气	70,000	1,595,300.00	0.43%

34	002028	思源电气	24,945	1,568,541.60	0.42%
35	600997	开滦股份	70,000	1,540,000.00	0.41%
36	600456	宝钛股份	35,000	1,494,850.00	0.40%
37	600004	白云机场	80,000	1,488,000.00	0.40%
38	601628	中国人寿	36,000	1,479,960.00	0.40%
39	600831	广电网络	59,985	1,442,639.25	0.39%
40	600360	华微电子	70,000	1,408,400.00	0.38%
41	000401	冀东水泥	100,000	1,376,000.00	0.37%
42	000759	武汉中百	100,000	1,360,000.00	0.36%
43	600596	新安股份	30,000	1,295,700.00	0.35%
44	600029	南方航空	150,000	1,287,000.00	0.35%
45	600888	新疆众和	40,000	1,284,800.00	0.34%
46	600963	岳阳纸业	50,000	1,271,500.00	0.34%
47	000069	华侨城 A	30,000	1,194,000.00	0.32%
48	600582	天地科技	20,000	1,193,000.00	0.32%
49	600086	东方金钰	100,000	1,119,000.00	0.30%
50	600650	锦江投资	80,000	1,040,000.00	0.28%
51	002078	太阳纸业	36,000	936,360.00	0.25%
52	600557	康缘药业	60,000	921,600.00	0.25%
53	000927	一汽夏利	100,000	836,000.00	0.22%
54	600879	火箭股份	30,000	797,700.00	0.21%
55	002106	莱宝高科	13,000	390,130.00	0.10%
股票投资合计				102,889,097.87	27.58%

#### 6.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### (1) 报告期内累计买入价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600880	博瑞传播	2,759,736.31	0.74%
2	000718	苏宁环球	2,600,193.34	0.70%
3	600690	青岛海尔	2,588,404.34	0.69%
4	000419	通程控股	2,380,625.67	0.64%
5	600761	安徽合力	2,378,090.64	0.64%
6	600529	山东药玻	2,219,437.09	0.60%
7	600588	用友软件	2,168,144.66	0.58%
8	000401	冀东水泥	2,132,612.08	0.57%
9	600423	柳化股份	2,066,867.58	0.55%
10	600269	赣粤高速	2,061,605.01	0.55%
11	600697	欧亚集团	2,044,143.53	0.55%
12	600352	浙江龙盛	1,978,010.23	0.53%
13	000709	唐钢股份	1,941,876.01	0.52%
14	000927	一汽夏利	1,929,557.35	0.52%
15	600693	东百集团	1,925,170.59	0.52%

16	600978	宜华木业	1,923,810.09	0.52%
17	600456	宝钛股份	1,886,050.05	0.51%
18	600963	岳阳纸业	1,849,138.44	0.50%
19	000898	鞍钢股份	1,830,945.63	0.49%
20	600312	平高电气	1,728,276.43	0.46%

## (2) 报告期内累计卖出价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600859	王府井	12,937,744.60	3.47%
2	000423	东阿阿胶	10,398,514.33	2.79%
3	600900	长江电力	9,918,934.40	2.66%
4	600122	宏图高科	8,609,580.80	2.31%
5	600361	华联综超	7,916,965.94	2.12%
6	600019	宝钢股份	7,298,715.13	1.96%
7	600037	歌华有线	6,411,121.53	1.72%
8	000858	五粮液	6,349,003.43	1.70%
9	600118	中国卫星	5,885,790.67	1.58%
10	600028	中国石化	5,566,277.32	1.49%
11	000410	沈阳机床	5,201,685.67	1.39%
12	600150	沪东重机	5,080,738.56	1.36%
13	600583	海油工程	4,339,398.07	1.16%
14	000568	泸州老窖	3,903,741.94	1.05%
15	000729	燕京啤酒	3,801,302.06	1.02%
16	601628	中国人寿	3,673,106.45	0.98%
17	601006	大秦铁路	3,595,025.47	0.96%
18	000538	云南白药	3,261,917.56	0.87%
19	000002	万科A	3,235,399.25	0.87%
20	000698	沈阳化工	3,174,435.22	0.85%

## (3) 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
85,578,848.13	181,024,908.98

## 6.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	73,309,325.70	19.65%
金融债	125,200,500.00	33.56%
央行票据		
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
合计	198,509,825.70	53.21%

## 6.6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券简称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	040215	04 国开 15	55,148,500.00	14.78%
2	040302	04 进出 02	50,110,000.00	13.43%
3	010214	02 国债(4)	46,962,112.50	12.59%
4	009905	99 国债(5)	26,347,213.20	7.06%
5	050209	05 国开 09	19,942,000.00	5.35%

#### 6.7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证简称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	031003	深发 SFC1	83,820.00	0.02%
2	031004	深发 SFC2	45,614.25	0.01%

#### 6.8 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细：无

#### 6.9 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名股票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和处罚。

(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。

(3) 其他资产的构成

项目	期末余额(元)
交易保证金	250,000.00
应收证券交易清算款	
应收利息	5,589,355.34
应收申购款	359,548.12
合计	6,198,903.46

(4) 持有的处于转股期的可转换债券明细：无

(5) 报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	031003	深发 SFC1	5500	0.00	被动持有
2	031004	深发 SFC2	2750	0.00	被动持有

## §7 基金份额持有人情况

#### 7.1 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)	5624
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	42,926.90

#### 7.2 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	241,420,888.58	100%
其中：机构投资者持有的基金份额	59,453,715.22	24.63%
个人投资者持有的基金份额	181,967,173.36	75.37%

## §8 开放式基金份额变动情况

项 目	基金份额总额 (份)
基金合同生效日的基金份额总额	1,296,361,260.94
报告期期初基金份额总额	286,702,861.95
报告期期间总申购份额	47,329,501.46
报告期期间总赎回份额	92,611,474.83
报告期期末基金份额总额	241,420,888.58

## §9 重大事件揭示

(一) 报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二) 报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

1. 基金管理人重大人事变动情况

2007 年 1 月 16 日, 基金管理人发布了《关于张峰先生改任公司副总经理、王炜女士任公司督察长的公告》。

2. 基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况: 无

(三) 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。

(四) 报告期内本基金投资策略未发生改变。

(五) 基金收益分配

2007 年 3 月 19 日, 基金管理人实施了本基金 2006 年度收益分配, 每 10 份基金份额派发现金红利 0.60 元。

(六) 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

(七) 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。

(八) 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证券公司的选择。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的股票、债券、债券回购情况

### (1) 股票交易量及佣金情况

证券公司名称	租用席位数量 (个)	股票成交金额 (元)	占股票总成交金额的比例	佣金 (元)	占佣金总量比例
中国银河证券有限责任公司	2	123,515,196.06	46.78%	97,771.46	46.08%
山西证券有限责任公司	1	140,508,153.15	53.22%	114,388.19	53.92%
合计	3	264,023,349.21	100%	212,159.65	100%

### (2) 债券交易情况

证券公司名称	债券成交金额 (元)	占债券成交总额的比例
中国银河证券有限责任公司	2,004,400.00	18.70%
山西证券有限责任公司	8,712,233.50	81.30%
合计	10,716,633.50	100%

### (3) 债券回购交易情况

证券公司名称	债券回购成交金额 (元)	占债券回购成交总额的比例
中国银河证券有限责任公司	76,000,000.00	33.93%
山西证券有限责任公司	148,000,000.00	66.07%
合计	224,000,000.00	100%

### (4) 权证交易情况：无

## 3. 报告期内租用证券公司席位的变更情况：无

### (九) 报告期内刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的其他临时报告

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于张峰先生改任公司副总经理、王炜女士任公司督察长的公告	2007年1月16日	
2	关于通过深圳发展银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	2007年1月23日	含本基金
3	关于增加广州证券为旗下开放式证券投资基金代销机构的公告	2007年1月23日	含本基金
4	嘉实浦安保本证券投资基金 2006 年度收益分配公告	2007年3月14日	派发现金红利 0.60 元/10 份
5	关于增加南京证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2007年3月15日	含本基金

6	关于旗下开放式基金通过海通证券开办定期定投业务的公告	2007年4月3日	含本基金
7	关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	2007年5月31日	含本基金
8	关于旗下开放式基金通过北京银行开办定期定投业务的公告	2007年6月22日	含本基金
9	关于对招商银行借记卡持卡人开通嘉实基金网上直销交易业务的公告	2007年6月26日	含本基金
10	关于旗下基金增加交通银行代销机构和通过交通银行开办定投及网上交易业务的公告	2007年6月27日	含本基金

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金合同》；
- (3) 《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- (6) 《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；
- (7) 报告期内嘉实浦安保本混合型开放式证券基金公告的各项原稿。

### 10.2 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

### 10.3 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、(010)65185566，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2007年8月28日