

**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
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： 中国银行股份有限公司

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 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系列基金的招募说明书。

本系列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。

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

第一章 基金简介	1
第二章 主要财务指标和基金净值表现	4
第三章 管理人报告	8
第一节 基金管理人及基金经理情况	8
第二节 基金运作的合规守信情况说明	9
第三节 基金业绩表现及投资策略说明和宏观经济、证券市场及行业走势展望	9
第四章 托管人报告	12
第五章 财务会计报告	12
第一节 基金会计报表	12
第二节 半年度会计报表附注	19
第六章 投资组合报告	29
第七章 基金份额持有人情况	43
第八章 开放式基金份额变动情况	43
第九章 重大事件揭示	43
第十章 备查文件目录	48

第一章 基金简介

一、嘉实增长证券投资基金

(一) 基金基本资料

1、基金名称	嘉实增长证券投资基金
2、基金简称	嘉实增长
3、基金交易代码	070002（深交所净值揭示代码：160702）
4、基金运作方式	契约型开放式
5、基金合同生效日	2003 年 7 月 9 日
6、报告期末基金份额总额	878,833,874.01 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

(二) 基金产品说明

1、投资目标	投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司，以获取未来资本增值的机会，并谋求基金资产的中长期稳定增值，同时通过分散投资提高基金资产的流动性。
2、投资策略	从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票，重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
3、业绩比较基准	巨潮 500（小盘）指数
4、风险收益特征	本基金属于中高风险证券投资基金。本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。

二、嘉实稳健证券投资基金

(一) 基金基本资料

1、基金名称	嘉实稳健证券投资基金
2、基金简称	嘉实稳健

3、基金交易代码	070003（深交所净值揭示代码：160703）
4、基金运作方式	契约型开放式
5、基金合同生效日	2003 年 7 月 9 日
6、报告期末基金份额总额	16,669,057,887.85 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

（二）基金产品说明

1、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。
2、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。在正常市场状况下，投资组合比例范围：股票 40%-75%，债券 20%-55%，现金 5%左右。
3、业绩比较基准	巨潮 200（大盘）指数
4、风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金。本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。

三、嘉实债券证券投资基金

（一）基金基本资料

1、基金名称	嘉实债券证券投资基金
2、基金简称	嘉实债券
3、基金交易代码	070005（深交所净值揭示代码：160704）
4、基金运作方式	契约型开放式
5、基金合同生效日	2003 年 7 月 9 日
6、报告期末基金份额总额	2,812,223,013.00 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

(二) 基金产品说明

1、投资目标	以本金安全为前提，追求较高的组合回报。
2、投资策略	采取主动的自上而下的投资策略，通过对投资组合的相对价值分析，充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会；应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合，实现基金的保值增值。
3、业绩比较基准	中央国债登记结算公司的中国债券指数
4、风险收益特征	本基金属于低风险证券投资基金，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金。

四、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	http://www.jsfund.cn
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

五、基金托管人

1、名称	中国银行股份有限公司
2、注册地址	北京西城区复兴门内大街 1 号
3、办公地址	北京西城区复兴门内大街 1 号
4、邮政编码	100818
5、国际互联网址	http://www.boc.cn

6、法定代表人	肖钢
7、托管部门总经理	秦立儒
8、信息披露负责人	宁敏
9、联系电话	(010) 66594977
10、传真	(010) 66594942
11、电子邮箱	tgxxpl@bank-of-china.com

六、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

七、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

第二章 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。

一、嘉实增长基金

(一) 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	1, 087, 337, 020. 82
2	基金份额本期净收益	1. 1022
3	期末可供分配基金收益	1, 565, 498, 440. 05
4	期末可供分配基金份额收益	1. 7813
5	期末基金资产净值	3, 286, 414, 528. 08
6	期末基金份额净值	3. 740
7	基金加权平均净值收益率	36. 77%
8	本期基金份额净值增长率	64. 47%
9	基金份额累计净值增长率	373. 16%

(二) 基金净值表现

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	3.69%	2.19%	-16.10%	4.22%	19.79%	-2.03%
过去三个月	34.97%	1.86%	20.12%	3.36%	14.85%	-1.50%
过去六个月	64.47%	1.83%	109.22%	2.97%	-44.75%	-1.14%
过去一年	123.30%	1.53%	137.27%	2.35%	-13.97%	-0.82%
过去三年	307.15%	1.19%	205.90%	1.93%	101.25%	-0.74%
自基金合同生效起至今	373.16%	1.10%	144.35%	1.79%	228.81%	-0.69%

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 1: 嘉实增长基金累计份额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 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已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。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但应在 10 个工作日内进行调整，并符合相应的规定。

二、嘉实稳健基金

（一）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	2,252,497,124.16
2	基金份额本期净收益	0.5148
3	期末可供分配基金收益	7,176,511,741.95
4	期末可供分配基金份额收益	0.4305
5	期末基金资产净值	16,830,136,894.21
6	期末基金份额净值	1.010
7	基金加权平均净值收益率	39.96%
8	本期基金份额净值增长率	63.17%
9	基金份额累计净值增长率	268.59%

(二) 基金净值表现

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	4.58%	1.84%	-2.28%	2.99%	6.86%	-1.15%
过去三个月	40.78%	1.68%	36.91%	2.46%	3.87%	-0.78%
过去六个月	63.17%	1.85%	83.93%	2.47%	-20.76%	-0.62%
过去一年	123.99%	1.52%	174.87%	1.99%	-50.88%	-0.47%
过去三年	246.31%	1.16%	251.67%	1.59%	-5.36%	-0.43%
自基金合同生效起至今	268.59%	1.08%	206.59%	1.49%	62.00%	-0.41%

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

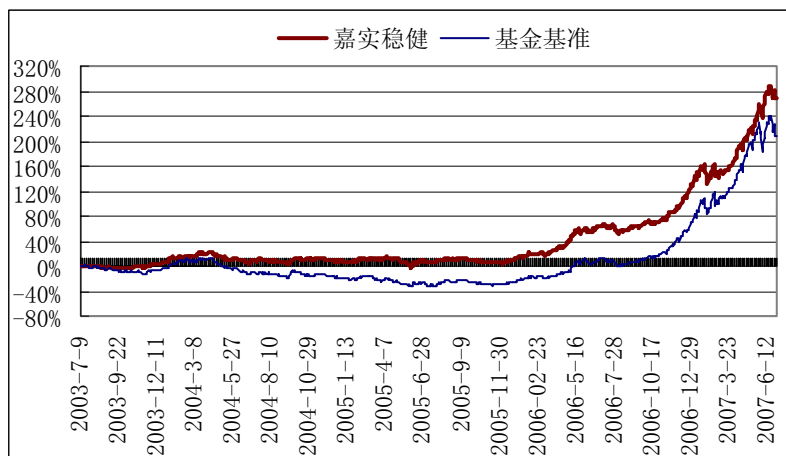


图 3: 嘉实稳健基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 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已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

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。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但应在 10 个工作日内进行调整,并符合相应的规定。

三、嘉实债券基金

(一) 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	103,824,910.60
2	基金份额本期净收益	0.0833
3	期末可供分配基金收益	85,110,845.64
4	期末可供分配基金份额收益	0.0303
5	期末基金资产净值	3,346,158,099.72
6	期末基金份额净值	1.190
7	基金加权平均净值收益率	7.11%
8	本期基金份额净值增长率	16.26%
9	基金份额累计净值增长率	55.90%

(二) 基金净值表现

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	-0.42%	0.52%	-1.22%	0.07%	0.80%	0.45%
过去三个月	8.91%	0.45%	-2.47%	0.07%	11.38%	0.38%
过去六个月	16.26%	0.44%	-2.64%	0.06%	18.90%	0.38%
过去一年	25.57%	0.37%	-0.61%	0.06%	26.18%	0.31%
过去三年	62.06%	0.39%	11.02%	0.19%	51.04%	0.20%
自基金合同生效起至今	55.90%	0.36%	6.45%	0.23%	49.45%	0.13%

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

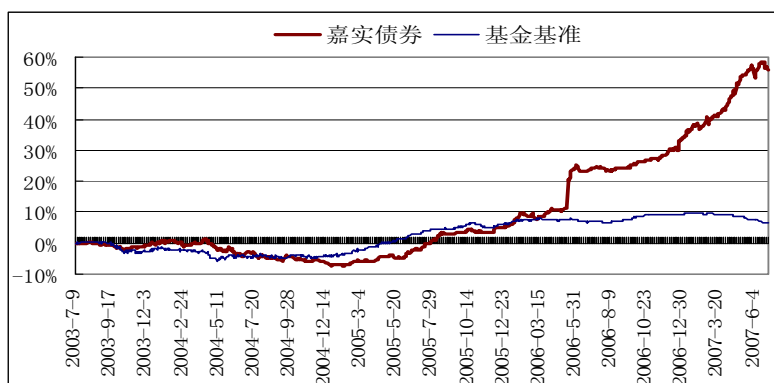


图 5：嘉实债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 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已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）投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（3）投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上（或者有高信用等级机构或相当优质资产担保）的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级；（4）本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月；（5）新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过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。

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、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 基金经理小组简介

(1) 嘉实增长基金经理

邵健先生，经济学硕士。8 年证券从业经历。1998 年-2003 年任职于国泰君安证券研究所，历任研究员、行业投资策略组组长、行业公司部副经理，从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003 年 7 月加入嘉实基金负责嘉实增长基金的管理工作。

(2) 嘉实稳健基金经理

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 月至今任嘉实稳健基金基金经理。

忻怡先生，硕士研究生，CFA，5 年证券从业经历。曾任职于上海银行、渣打银行上海分行，2002 年至 2003 年任国泰君安证券香港公司研究员，2003 年 9 月至 2006 年 8 月任博时基金管理有限公司研究员，2006 年 9 月至今任嘉实基金管理有限公司研究员，2006 年 12 月至今任嘉实稳健基金基金经理。

(3) 嘉实债券基金经理

刘夫先生，硕士研究生，12 年证券投资经验。曾就职于深圳人民银行外汇经纪中心，平安保险集团投资管理中心，宝盈基金管理有限公司。2005 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司从事债券投资管理工作，2005 年 4 月至今任嘉实债券基金基金经理。

第二节 基金运作合规守信情况说明

在报告期内，本系列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《嘉实理财通系列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。2007 年 4 月 11 日，因恒生系统计算误差，嘉实增长基金持有的股票市值占基金资产净值比例为 74.99%，经重新核算后该比例为 75.0029%；4 月 6 日至 4 月 19 日因市场因素影响该比例被动稍微超过 75%，4 月 20 日该比例为 74.69%。

第三节 基金业绩表现及投资策略说明和宏观经济、证券市场及行业走势展望

一、嘉实增长基金

(一) 基金业绩表现和投资策略说明

截至报告期末本基金份额净值为 3.740 元，本报告期份额净值增长率为 64.47%，同期业绩比较基准增长率为 109.22%。

报告期内，中国 A 股市场在企业良好的盈利增长与强大的流动性的推动下继续大幅上扬。但随着指数的上涨，估值的快速提升，A 股市场的安全边际显著降低，并在其间多次出现大幅波动。

从结构上来看，市场在 5.30 前后表现出显著的差别。此前，由于投资者结构快速的变化，绩差股的表现远远超越基金重仓持有的绩优股板块，但在 5.30 之后，随着绩差股巨大风险的凸显，绩优股的表现重新胜出。

报告期内，本基金总体采取了仓位稳定、精选个股、长线投资、持续优化的策略，这一策略在上半年的牛市氛围、快速轮动及低价与重组板块鸡犬升天的环境下虽非最优策略，但我们相信从长期来看将是有助于持有人利益的。在行业上，上半年我们重点增持了房地产、医药、金融等行业，重点减持的行业是金属与前期超配的商业行业。目前，本基金持仓比例相对较大的主要是医药、机械、商业、房地产等行业。由于基金合同的限制，本基金无法对一些相对看好的大盘股为主的行业（如银行、保险等）进行大规模配置。

（二）宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望未来一段时间的市场，我们认为尽管中国的经济与企业盈利前景依然较好，一些制度性的变革也将有助于 A 股市场投资价值的提升，但市场面临的估值高企、国内投资者投资渠道拓宽、中国与美日经济的潜在紧缩等风险正在进一步加大。在这一情况下，我们将采用关注成长、强化防御的投资策略，重点持有消费、地产、长周期的装备制造等行业具备竞争优势与动态估值优势的企业，力争为基金份额持有人创造长期的良好回报。

二、嘉实稳健基金

（一）基金业绩表现和投资策略说明

截至报告期末本基金份额净值为 1.010 元，本报告期份额净值增长率为 63.17%，同期业绩比较基准增长率为 83.93%。2007 年 5 月 30 日，本基金进行了基金份额拆分并将基金份额净值调整为 1.000 元；6 月 28 日，每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元。

报告期内，经济增长连续两个季度快速增长，GDP 增速超越 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。股票市场在个人投资者不断入市的推动自下，不断创出新高，期间沪深 300 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。报告期内，本基金的配置主要集中在银行、地产业和资源类（包括有色金属和煤炭）的投资。

（二）宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望未来，我们认为，中国经济将继续保持高增长，2007 下半年 GDP 将会加速增长。但同时消费价格指数也会继续上升，而且这不仅仅是粮食、猪肉禽蛋的涨价的季节性因素，

未来中国经济将进入温和的通货膨胀期。我们在估计今年第 4 季度政府将会果断地采取调控措施。另外，人民币的升值速度也将超过上半年。

我们认为，在温和通货膨胀（不是恶性通胀）和经济高速增长的环境下，获益的行业应该是基础行业、工业制品、耐久消费品（最典型的汽车）和房地产。然而基础行业中的一部分因为国家控制价格而实际上成了受害者，比如电力和成品油，煤炭公司也是因为这两年国家放松价格管制才表现出价值。另外一些高端的消费品也将收益于经济高速增长。

在资产配置上，本基金在保持原来配置的基础上将增加钢铁，同时在自下而上增加个股选择。

三、嘉实债券基金

（一）基金业绩表现和投资策略说明

截至报告期末本基金份额净值为 1.190 元，本报告期份额净值增长率为 16.26%，同期业绩比较基准增长率为 -2.64%。

报告期内宏观经济形势与上年同期十分类似，表现在：GDP 增长强劲，固定资产投资居高不下，银行贷款超标增长，外贸顺差超常规增长，货币供应持续高温，宏观经济整体出现了过热的倾向，同时房地产价格在一系列调控措施出台后依旧持续上涨；与上年同期不同的是，今年上半年以猪肉为代表的食品价格由于生产成本及流通体制的原因连续大幅上涨，导致消费物价指数出现了明显的上升，并且保持了继续上升的趋势。在市场流动性泛滥、经济面临过热的形势下，央行在上半年实施了一系列紧缩性的货币政策，包括提高存贷款利率、向商业银行发行定向票据、提高法定准备金率以及加大公开市场回收流动性的力度等，尤其是 5 月份央行在加息的同时调高了人民币对外汇交易的日间波动幅度，隐含着放弃或者修正以前“压利率保汇率”的货币政策原则的可能性，从而引发了市场对今后更多次数加息的担忧；此外，国家外汇投资公司的成立和即将发行特殊国债，虽然发行方式有不确定性，但未来债券供应尤其是长期债券的供应将大量增加，从而加大债券市场的压力。上半年债券市场在众多不利因素的影响下，出现了以中长期债券为主的大幅下跌，收益率曲线上移并明显陡峭化。报告期内由于本基金维持了债券组合较低的久期，因此本基金组合的净值没有因为债券市场的下跌而受到明显的影响。

另一方面，股票市场在流动性过剩、基础环境改善、上市公司业绩提升、资产注入预期等一系列利好因素的重合影响下，走出了一波持续上涨的行情。本基金在今年 1 季度比较大幅的提高了权益类资产的投资比例，包括买入可转债以及继续持有上市流通后的优质新

股，同时非常注重随着市场的演变及上市公司价值的新近挖掘来动态调整权益类资产的结构，从而较好地把握了上半年股票市场带来的机会。2 季度末在股票市场经历了连续大幅上涨面临波动加大的阶段，本基金适时调低了权益类资产的投资比例，从而规避了一部分市场风险。此外，本基金还积极参加一级市场新股和新转债的发行，获得了良好的收益。

（二）宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望下半年，物价形势和国家外汇投资公司巨额长期债券的发行，将很可能是对整个资本市场最具影响的两件大事。物价形势将决定央行在下半年加息的频率及幅度，而巨额国债的发行不仅将完全改变债券市场的供求关系，更重要的是可能明显改变整个流动性过剩的局面。我们将会密切关注宏观经济形势下一步的可能变化，在追求投资收益的同时，更加关注基金资产的安全性和流动性。同时本基金仍将继续积极参与新股及新转债的发行，争取在一级市场当中寻找更多的低风险收益。

第四章 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”）在对嘉实理财通系列证券投资基金（以下称“本系列基金”）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，2007年4月6日至4月19日，因市场因素影响嘉实增长基金持有的股票市值占基金资产净值比例超过75%，4月20日该比例调整为74.69%。

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、准确和完整。

第五章 财务会计报告

第一节 基金会计报表

一、嘉实增长证券投资基金

1. 资产负债表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)			
项 目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资 产			
银行存款		534,558,443.09	311,961,584.60
清算备付金		8,420,186.08	6,029,821.99
交易保证金		902,701.35	661,941.77
应收证券交易清算款		70,554,151.10	175,612,784.00
应收股利			
应收利息	四、1	12,257,536.66	5,392,279.32
应收申购款			5,618,397.07
其他应收款		85,663.20	
股票投资市值		2,236,433,617.96	1,622,158,618.98
其中: 股票投资成本		1,260,767,165.20	963,245,773.42
债券投资市值		727,919,362.98	598,160,111.80
其中: 债券投资成本		721,771,116.89	595,124,349.88
权证投资市值		36,618,891.26	24,295,484.80
其中: 权证投资成本			
买入返售证券			
待摊费用	四、2		
资产合计		3,627,750,553.68	2,749,891,024.33
负债与持有人权益			
负 债			
应付证券清算款			
应付赎回款		2,800,534.16	8,636,325.30
应付赎回费		6,675.29	18,037.76
应付管理人报酬		4,134,591.32	2,956,091.91
应付托管费		689,098.57	492,682.00
应付佣金	四、4	2,335,939.54	1,526,993.70
应付利息		58,013.80	488,920.00
其他应付款	四、5	384,724.20	384,724.20
卖出回购证券款		330,860,000.00	300,000,000.00
预提费用	四、6	66,448.72	165,600.00
负债合计		341,336,025.60	314,669,374.87
持有人权益			
实收基金	四、7	878,833,874.01	1,070,671,701.03
未实现利得/(损失)	四、8	842,082,214.02	682,672,066.00
未分配收益		1,565,498,440.05	681,877,882.43
持有人权益合计		3,286,414,528.08	2,435,221,649.46
负债及持有人权益总计		3,627,750,553.68	2,749,891,024.33
附注: 基金份额净值		3.740	2.274

2、经营业绩表及收益分配表

(1) 经营业绩表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)			
项目	附注	本期	上年同期
收入			
股票差价收入	四、9	1,086,348,749.27	477,770,572.60
债券差价收入	四、10	423,644.03	565,389.69
债券利息收入		8,854,922.99	5,367,428.46
存款利息收入		873,670.35	352,250.51
股利收入		7,121,705.76	8,250,084.50
买入返售证券收入			
权证差价收入	四、11	11,747,710.71	8,860,652.22
其他收入	四、12	911,784.23	1,326,299.08
收入合计		1,116,282,187.34	502,492,677.06
费用			
基金管理人报酬		21,929,804.66	13,284,579.74
基金托管费		3,654,967.50	2,214,096.64
卖出回购证券支出		3,256,040.46	63,563.70
其他费用	四、13	104,353.90	152,946.77
其中: 审计费用		24,795.19	43,639.10
信息披露费		41,653.53	96,697.44
费用合计		28,945,166.52	15,715,186.85
基金净收益		1,087,337,020.82	486,777,490.21
加: 未实现估值增值/(减值)变动数		332,189,497.83	325,621,671.01
基金经营业绩		1,419,526,518.65	812,399,161.22

(2) 收益分配表

项目	附注	本期	上年同期
基金净收益		1,087,337,020.82	486,777,490.21
加: 期初基金净收益		681,877,882.43	-450,322.17
本期申购基金单位的损益平准金		119,622,564.98	117,617,558.43
本期赎回基金单位的损益平准金		-323,339,028.18	-110,655,964.60
可供分配基金净收益		1,565,498,440.05	493,288,761.87
减: 本期已分配基金净收益	四、14		176,896,958.16
未分配基金净收益		1,565,498,440.05	316,391,803.71

3. 基金净值变动表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)			
项目		本期	上年同期
一、期初基金净值		2,435,221,649.46	1,833,216,246.30
二、本期经营活动			
基金净收益		1,087,337,020.82	486,777,490.21
未实现估值增值/(减值)变动数		332,189,497.83	325,621,671.01

经营活动产生的基金净值变动数		1,419,526,518.65	812,399,161.22
三、本期基金份额交易			
基金申购款		432,470,320.13	1,077,043,963.03
其中：分红再投资			58,776,260.74
基金赎回款		-1,000,803,960.16	-1,462,935,049.01
基金份额交易产生的基金净值变动数		-568,333,640.03	-385,891,085.98
四、本期向持有人分配收益	四、14		176,896,958.16
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数			-176,896,958.16
五、期末基金净值		3,286,414,528.08	2,082,827,363.38

二、嘉实稳健证券投资基金

1. 资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项 目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资 产			
银行存款		528,984,993.37	441,345,106.92
清算备付金		30,089,123.39	37,479,175.70
交易保证金		3,819,632.56	644,380.19
应收证券清算款		0.00	130,585,040.31
应收股利		20,471.60	
应收利息	四、1	33,127,293.54	11,191,460.16
应收申购款		5,074,496,836.47	25,558,853.18
其他应收款		0.00	
股票投资市值		9,274,648,590.36	4,179,915,462.31
其中：股票投资成本		8,246,434,025.36	3,151,582,745.88
债券投资市值		2,468,929,856.84	1,313,370,756.46
其中：债券投资成本		2,463,536,890.74	1,313,138,280.08
权证投资市值			
其中：权证投资成本			
买入返售证券			
待摊费用	四、2		
资产合计		17,414,116,798.13	6,140,090,235.23
负债与持有人权益			
负 债			
应付证券清算款		485,462,384.17	
应付赎回款		18,365,046.32	68,505,071.95
应付赎回费		68,498.10	258,423.60
应付管理人报酬		15,269,003.07	7,289,412.13
应付托管费		2,544,833.83	1,214,902.04
应付佣金	四、4	11,754,707.54	5,393,600.02
应付利息		2,500.00	

其他应付款	四、5	350,774.80	333,633.30
卖出回购证券款		50,000,000.00	
预提费用	四、6	162,156.09	101,600.00
负债合计		583,979,903.92	83,096,643.04
持有人权益			
实收基金	四、7	8,237,357,797.53	4,609,029,342.38
未实现利得/(损失)	四、8	1,416,267,354.73	992,297,293.21
未分配收益		7,176,511,741.95	455,666,956.60
持有人权益合计		16,830,136,894.21	6,056,993,592.19
负债及持有人权益总计		17,414,116,798.13	6,140,090,235.23
附注：基金份额净值		1.010	1.314

2. 经营业绩表及收益分配表

(1) 经营业绩表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项目	附注	本期	上年同期
收入			
股票差价收入	四、9	2,267,907,150.67	226,183,459.89
债券差价收入	四、10	-560,358.50	220,219.32
债券利息收入		15,598,149.18	2,280,519.40
存款利息收入		2,825,070.55	153,881.65
股利收入		11,050,708.47	3,409,005.96
买入返售证券收入			
权证差价收入	四、11	367,798.27	12,623,120.49
其他收入	四、12	6,325,427.20	419,481.58
收入合计		2,303,513,945.84	245,289,688.29
费用			
基金管理人报酬		40,675,781.72	5,426,606.91
基金托管费		6,779,296.96	904,434.53
卖出回购证券支出		3,361,214.25	20,854.79
其他费用	四、13	200,528.75	75,987.89
其中：审计费用		60,995.19	20,331.73
信息披露费		101,160.90	44,629.17
费用合计		51,016,821.68	6,427,884.12
基金净收益		2,252,497,124.16	238,861,804.17
加：未实现估值增值/(减值)变动数		5,042,338.29	48,783,306.62
基金经营业绩		2,257,539,462.45	287,645,110.79

(2) 收益分配表

项目	附注	本期	上年同期
基金净收益		2,252,497,124.16	238,861,804.17
加：期初基金净收益		455,666,956.60	-23,288,181.13

本期申购基金份额的损益平准金		6,524,105,339.78	24,393,770.07
本期赎回基金份额的损益平准金		-1,487,443,839.76	-39,532,177.87
可供分配基金净收益		7,744,825,580.78	200,435,215.24
减：本期已分配基金净收益	四、14	568,313,838.83	54,761,895.44
未分配基金净收益		7,176,511,741.95	145,673,319.80

3. 基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项目	附注	本期	上年同期
一、期初基金净值		6,056,993,592.19	840,295,344.68
二、本期经营活动			
基金净收益		2,252,497,124.16	238,861,804.17
未实现估值增值/(减值)变动数		5,042,338.29	48,783,306.62
经营活动产生的基金净值变动数		2,257,539,462.45	287,645,110.79
三、本期基金份额交易			
基金申购款		14,989,349,161.30	318,588,718.82
其中：分红再投资		357,612,878.14	8,094,757.56
基金赎回款		-5,905,431,482.90	-674,324,692.87
基金份额交易产生的基金净值变动数		9,083,917,678.40	-355,735,974.05
四、本期向持有人分配收益	四、14	568,313,838.83	54,761,895.44
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-568,313,838.83	-54,761,895.44
五、期末基金净值		16,830,136,894.21	717,442,585.98

三、嘉实债券证券投资基金

1. 资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资 产			
银行存款		249,222,438.99	19,916,652.04
清算备付金		38,254,230.98	3,672,698.45
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		770,014.46	973,524.08
应收股利			
应收利息	四、1	38,343,492.51	2,687,968.01
应收申购款		13,897,987.44	4,511,122.87
其他应收款		117,784.80	
股票投资市值		274,068,225.87	38,136,023.18
其中：股票投资成本		195,947,485.30	21,641,243.03
债券投资市值		2,839,835,570.09	293,372,561.90
其中：债券投资成本		2,850,092,525.17	292,754,875.51
权证投资市值			

其中：权证投资成本			
买入返售证券			
待摊费用	四、2		
资产合计		3,454,759,745.14	363,520,550.53
负债与持有人权益			
负 债			
应付证券清算款		64,393,948.15	4,121,904.72
应付赎回款		41,139,046.48	2,194,064.73
应付赎回费		153,820.17	4,357.35
应付管理人报酬		1,582,713.60	172,112.07
应付托管费		527,571.20	57,370.68
应付佣金	四、4	260,561.46	20,754.73
应付利息			
其他应付款	四、5	530,134.58	515,069.88
卖出回购证券款			
预提费用	四、6	13,849.78	17,335.64
负债合计		108,601,645.42	7,102,969.80
持有人权益			
实收基金	四、7	2,812,223,013.00	334,132,310.62
未实现利得/(损失)	四、8	448,824,241.08	18,053,785.75
未分配收益		85,110,845.64	4,231,484.36
持有人权益合计		3,346,158,099.72	356,417,580.73
负债及持有人权益总计		3,454,759,745.14	363,520,550.53
附注：基金份额净值		1.190	1.067

2. 经营业绩表及收益分配表

(1) 经营业绩表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项目	附注	本期	上年同期
收入			
股票差价收入	四、9	81,763,239.90	10,251,015.61
债券差价收入	四、10	10,616,018.56	5,838,893.90
债券利息收入		16,484,025.23	1,678,277.91
存款利息收入		926,795.46	76,241.46
股利收入		656,619.96	
买入返售证券收入		0.00	
权证差价收入	四、11	3,757,537.25	5,841,757.65
其他收入	四、12	592,822.05	86,498.16
收入合计		114,797,058.41	23,772,684.69
费用			
基金管理人报酬		4,177,160.54	451,701.89
基金托管费		1,392,386.83	150,567.32

卖出回购证券支出		5,230,679.10	35,298.88
其他费用	四、13	171,921.34	72,603.64
其中：审计费用		3,471.58	2,975.64
信息披露费		5,951.28	7,439.10
费用合计		10,972,147.81	710,171.73
基金净收益		103,824,910.60	23,062,512.96
加：未实现估值增值/(减值)变动数		50,751,318.95	973,257.84
基金经营业绩		154,576,229.55	24,035,770.80

(2) 收益分配表

项目	附注	本期	上年同期
基金净收益		103,824,910.60	23,062,512.96
加：期初基金净收益		4,231,484.36	3,981,746.91
本期申购基金份额的损益平准金		68,313,761.51	26,676,517.27
本期赎回基金份额的损益平准金		-23,722,905.91	-18,049,266.47
可供分配基金净收益		152,647,250.56	35,671,510.67
减：本期已分配基金净收益	四、14	67,536,404.92	9,410,789.42
未分配基金净收益		85,110,845.64	26,260,721.25

3. 基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)			
项目	附注	本期	上年同期
一、期初基金净值		356,417,580.73	121,740,676.58
二、本期经营活动			
基金净收益		103,824,910.60	23,062,512.96
未实现估值增值/(减值)变动数		50,751,318.95	973,257.84
经营活动产生的基金净值变动数		154,576,229.55	24,035,770.80
三、本期基金份额交易			
基金申购款		4,198,395,181.20	246,270,336.67
其中：分红再投资		39,007,291.21	6,089,291.00
基金赎回款		-1,295,694,486.84	-174,410,777.26
基金份额交易产生的基金净值变动数		2,902,700,694.36	71,859,559.41
四、本期向持有人分配收益	四、14	67,536,404.92	9,410,789.42
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-67,536,404.92	-9,410,789.42
五、期末基金净值		3,346,158,099.72	208,225,217.37

第二节 年度会计报表附注

一、会计政策、会计估计及其变更

1. 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。
2. 基金份额拆分的主要会计政策

2007 年 5 月 30 日，嘉实稳健基金进行了基金份额拆分，基金拆分日（5 月 30 日）日终，基金管理人将根据基金份额拆分比例对基金份额持有人拆分日登记在册的基金份额实施拆分。拆分后，基金份额持有人持有的基金份额数按照拆分比例相应增加，实收基金账面金额保持不变，拆分日基金份额净值调整为 1.000 元。拆分公式为：

拆分后基金份额数 = 拆分前基金份额 × 基金份额拆分比例

基金份额拆分比例 = 拆分日基金资产净值 / 拆分日拆分前发售在外的基金份额总数

嘉实稳健基金基金份额拆分后，基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额均相应调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总数的比例不发生变化。基金份额拆分对基金份额持有人的权益无实质性影响，只是基金份额面值不再是人民币 1 元。

之后的会计处理和上年度一致，没有变更相应会计政策。

二、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。

三、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	基金发起人、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
北京证券有限责任公司	基金管理人原股东、基金代销机构
吉林省信托投资有限责任公司	基金管理人原股东
国都证券有限责任公司	基金管理人控股股东的子公司、基金代销机构
中诚期货经纪有限责任公司	基金管理人控股股东的子公司

（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

本报告期本系列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

嘉实增长基金、嘉实稳健基金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 1.5% 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 $\times$ 1.5% / 当年天数。

嘉实债券基金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 0.6% 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 $\times$ 0.6% / 当年天数。

支付基金管理费如下：

基金简称	本期	上年同期
嘉实增长基金	21,929,804.66	13,284,579.74
嘉实稳健基金	40,675,781.72	5,426,606.91
嘉实债券基金	4,177,160.54	451,701.89

(2) 基金托管费

嘉实增长基金、嘉实稳健基金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 0.25% 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 $\times$ 0.25% / 当年天数。

嘉实债券基金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 0.20% 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 $\times$ 0.20% / 当年天数。

支付基金托管费如下：

基金简称	本期	上年同期
嘉实增长基金	3,654,967.50	2,214,096.64
嘉实稳健基金	6,779,296.96	904,434.53
嘉实债券基金	1,392,386.83	150,567.32

3. 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本系列基金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：

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
成交金额	793,353,517.66	2,785,388,166.71	1,807,489,640.68
回购利息收入			
回购利息支出	433,979.18	802,921.32	161,058.99

上年同期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
成交金额	19,841,600.00	60,465,880.00	29,882,560.00
回购利息收入			
回购利息支出			1,043.84

4. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

基金简称	银行存款余额	利息收入
------	--------	------

	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日	本期	上年同期
嘉实增长基金	534,558,443.09	80,150,072.62	816,481.29	329,806.38
嘉实稳健基金	528,984,993.37	23,266,694.39	2,726,079.13	140,236.96
嘉实债券基金	249,222,438.99	13,815,072.35	815,300.50	65,544.05

5. 关联方投资本基金情况

(1) 嘉实增长基金

关联方名称	2007 年 6 月 30 日		2006 年 12 月 31 日	
	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例
立信投资有限责任公司			1,390,250.52	0.12%
合计			1,390,250.52	0.12%

(2) 嘉实稳健基金

关联方名称	2007 年 6 月 30 日		2006 年 12 月 31 日	
	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例
立信投资有限责任公司	4,985,967.37	0.03%		
合计	4,985,967.37	0.03%		

(3) 嘉实债券基金

关联方名称	2007 年 6 月 30 日		2006 年 12 月 31 日	
	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例	持有基金份额 (份)	占基金份额 的比例
嘉实基金管理有限公司	34,122,230.69	1.21%	20,349,044.29	6.09%
合计	34,122,230.69	1.21%	20,349,044.29	6.09%

注：2007 年 2 月 5 日通过嘉实理财通系列证券投资基金代销机构申购嘉实债券基金 1500 万元，申购费为 1000 元。

6. 报告期末基金管理人基金从业人员持有本系列基金/基金情况：无

四、本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

2007 年 6 月 30 日			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
应收债券利息	12,211,457.60	32,948,082.61	38,266,971.29
应收银行存款利息	42,612.89	166,968.77	61,028.26
应收买入返售证券利息			
应收清算备付金利息	3,410.10	12,186.09	15,492.96
应收权证保证金利息	56.07	56.07	
合计	12,257,536.66	33,127,293.54	38,343,492.51

(2) 待摊费用：无

(3) 投资估值增值

2007 年 6 月 30 日			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
股票投资	975,666,452.76	1,028,214,565.00	78,120,740.57
债券投资	6,148,246.09	5,392,966.10	-10,256,955.08
权证投资	36,618,891.26		
合计	1,018,433,590.11	1,033,607,531.10	67,863,785.49

(4) 应付佣金

2007 年 6 月 30 日				
序号	证券公司名称	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
1	中信证券股份有限公司	488,589.05		230,645.91
2	中信建投证券有限责任公司		883,323.98	
3	招商证券股份有限公司	154,087.46		
4	渤海证券有限责任公司	640,673.23		
5	联合证券有限责任公司		3,390,350.44	29,915.55
6	国泰君安证券股份有限公司	922,139.64	1,793,861.16	
7	申银万国证券股份有限公司		2,070,809.30	
8	海通证券股份有限公司		2,686,181.76	
9	中国国际金融有限公司			
10	国信证券有限责任公司		382,741.30	
11	东吴证券有限责任公司	130,450.16		
12	中国国际金融有限公司			
13	中国银河证券股份有限公司		229,509.85	
14	湘财证券有限责任公司		317,929.75	
合计		2,335,939.54	11,754,707.54	260,561.46

(5) 其他应付款

2007 年 6 月 30 日			
	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
应付红利利息税	134,724.20	83,274.80	262,688.37
应付深圳证券交易所席位保证金	250,000.00	250,000.00	250,000.00
应付债券结算服务费			7,380.00
应付外汇交易中心手续费			10,066.21
应付席位通讯费		17,500.00	
合计	384,724.20	350,774.80	530,134.58

(6) 预提费用

2007 年 6 月 30 日			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
审计费用	24,795.19	60,995.19	3,471.58
信息披露费	41,653.53	101,160.90	5,951.28
银行间账户维护费			4,426.92
合计	66,448.72	162,156.09	13,849.78

(7) 实收基金

项目	本期
----	----

	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	基金份额 (份)	实收基金	基金份额 (份)	实收基金	基金份额 (份)	实收基金
期初数	1,070,671,701.03	1,070,671,701.03	4,609,029,342.38	4,609,029,342.38	334,132,310.62	334,132,310.62
本期申购	171,709,870.83	171,709,870.83	16,140,143,881.72	7,483,892,071.07	3,591,827,011.85	3,591,827,011.85
其中：红利再投资			342,212,407.31	169,156,969.12	33,169,411.84	33,169,411.84
本期赎回	363,547,697.85	363,547,697.85	4,080,115,336.25	3,855,563,615.92	1,113,736,309.47	1,113,736,309.47
本期末数	878,833,874.01	878,833,874.01	16,669,057,887.85	8,237,357,797.53	2,812,223,013.00	2,812,223,013.00

(8) 未实现利得

①嘉实增长证券投资基金

项目	未实现估值增值	未实现利得平准金	未实现利得-权证	合计
2006 年 12 月 31 日	661,948,607.48	-3,572,026.28	24,295,484.80	682,672,066.00
本期净变动数	319,866,091.37		12,323,406.46	332,189,497.83
本期申购基金份额		141,137,884.32		141,137,884.32
其中：红利再投资				
本期赎回基金份额		-313,917,234.13		-313,917,234.13
2007 年 6 月 30 日	981,814,698.85	-176,351,376.09	36,618,891.26	842,082,214.02

②嘉实稳健证券投资基金

项目	未实现估值增值	未实现利得平准金	未实现利得-权证	合计
2006 年 12 月 31 日	1,028,565,192.81	-36,267,899.60		992,297,293.21
本期净变动数	5,042,338.29			5,042,338.29
本期申购基金份额		981,351,750.45		981,351,750.45
其中：红利再投资		40,922,315.80		40,922,315.80
本期赎回基金份额		-562,424,027.22		-562,424,027.22
2007 年 6 月 30 日	1,033,607,531.10	382,659,823.63		1,416,267,354.73

③嘉实债券证券投资基金

项目	未实现估值增值	未实现利得平准金	未实现利得-权证	合计
2006 年 12 月 31 日	17,112,466.54	941,319.21		18,053,785.75
本期净变动数	50,751,318.95			50,751,318.95
本期申购基金份额		538,254,407.84		538,254,407.84
其中：红利再投资		5,808,217.93		5,808,217.93
本期赎回基金份额		-158,235,271.46		-158,235,271.46
2007 年 6 月 30 日	67,863,785.49	380,960,455.59		448,824,241.08

(9) 股票差价收入

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
卖出股票成交总额	2,582,487,955.92	8,953,736,424.87	307,908,176.64
卖出股票成本总额	1,493,964,915.32	6,678,331,732.44	225,884,157.06

应付佣金	2,174,291.33	7,497,541.76	260,779.68
股票差价收入	1,086,348,749.27	2,267,907,150.67	81,763,239.90

(10) 债券差价收入

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
卖出债券成交总额	101,118,182.77	1,010,291,499.59	1,227,990,972.34
卖出债券成本总额	98,888,600.68	996,147,867.40	1,208,840,978.66
应收利息总额	1,805,938.06	14,703,990.69	8,533,975.12
债券差价收入	423,644.03	-560,358.50	10,616,018.56

(11) 权证差价收入

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
卖出权证成交总额	11,747,710.71	598,195.82	6,537,368.01
卖出权证成本总额		230,397.55	2,779,830.76
权证差价收入	11,747,710.71	367,798.27	3,757,537.25

(12) 其他收入

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
新股申购手续费返还			
赎回手续费	836,336.13	5,960,629.63	515,888.10
配股手续费返还			
印花税返还			
转换手续费	75,448.10	364,797.57	76,933.95
其他			
合计	911,784.23	6,325,427.20	592,822.05

(13) 其他费用

本期			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
信息披露费	41,653.53	101,160.90	5,951.28
审计费用	24,795.19	60,995.19	3,471.58
银行费用	9,054.64	8,800.02	17,688.06
其他	28,850.54	29,572.64	144,810.42
合计	104,353.90	200,528.75	171,921.34

(14) 本期已分配基金净收益

本期			
红利派发时间	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
2007.05.14			67,536,404.92
2007.06.28		568,313,838.83	
累计收益分配金额		568,313,838.83	67,536,404.92

(15) 银行存款

2007 年 6 月 30 日			
项目	嘉实增长	嘉实稳健	嘉实债券
活期存款	534,558,443.09	528,984,993.37	249,222,438.99

定期存款			
合计	534,558,443.09	528,984,993.37	249,222,438.99

(16) 报告期内本系列基金因股权分置改革而获得非流通股东支付的现金对价, 对股票投资成本的累计影响金额: 无

五、报告期末流通转让受到限制的基金资产

以下各项除特别注明外, 金额单位为人民币元。

(一) 嘉实增长基金

(1) 报告期末本基金持有因股权分置改革而暂时停牌的股票: 无

(2) 报告期末本基金持有非公开发行的股票: 无

(3) 报告期末持有因认购新股而流通受限制的股票

序号	股票简称	股票代码	数量 (股)	总成本	总市值	估值 方法	转让受限 原因	转让受限 期限
1	金陵饭店	601007	106,196	451,333.00	1,531,346.32	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.6-2007.7.9
2	连云港	601008	138,007	687,274.86	2,014,902.20	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.26-2007.7.25
3	中国远洋	601919	503,328	4,268,221.44	9,190,769.28	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.26-2007.9.26
4	露天煤业	002128	87,837	860,802.60	3,170,915.70	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.18-2007.7.17
5	中环股份	002129	98,899	574,603.19	1,534,912.48	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.20-2007.7.19
6	利欧股份	002131	19,284	263,997.96	584,498.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
7	恒星科技	002132	44,423	355,384.00	835,152.40	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
8	东南网架	002135	46,891	450,153.60	1,089,746.84	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
9	安纳达	002136	14,784	119,454.72	337,223.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
10	实益达	002137	25,390	261,517.00	1,198,154.10	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
11	顺络电子	002138	19,675	267,580.00	675,049.25	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
合计				8,560,322.37	22,162,669.65			

(4) 报告期末本基金持有流通受限制不能自由转让的债券: 无

(二) 嘉实稳健基金

(1) 报告期末本基金持有因股权分置改革而暂时停牌的股票: 无

(2) 报告期末本基金持有非公开发行的股票: 无

(3) 报告期末持有因认购新股而流通受限制的股票

序号	股票简称	股票代码	数量 (股)	总成本	总市值	估值 方法	转让受限 原因	转让受限 期限
1	金陵饭店	601007	106,196	451,333.00	1,531,346.32	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.6-2007.7.9
2	连云港	601008	138,007	687,274.86	2,014,902.20	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.26-2007.7.25
3	交通银行	601328	1,026,088	8,106,095.20	11,276,707.12	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.15-2007.8.15
4	中国远洋	601919	1,500,996	12,728,446.08	27,408,186.96	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.26-2007.9.26

5	露天煤业	002128	87,837	860,802.60	3,170,915.70	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.18-2007.7.17
6	中环股份	002129	98,899	574,603.19	1,534,912.48	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.20-2007.7.19
7	利欧股份	002131	19,284	263,997.96	584,498.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
8	恒星科技	002132	44,423	355,384.00	835,152.40	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
9	东南网架	002135	46,891	450,153.60	1,089,746.84	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
10	安纳达	002136	14,784	119,454.72	337,223.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
11	实益达	002137	25,390	261,517.00	1,198,154.10	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
12	顺络电子	002138	19,675	267,580.00	675,049.25	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
合计				25,126,642.21	51,656,794.45			

(4) 报告期末本基金持有的流通受限制不能自由转让的债券：无

(三) 嘉实债券基金

(1) 报告期末本基金持有因股权分置改革而暂时停牌的股票：无

(2) 报告期末本基金持有非公开发行的股票：无

(3) 报告期末本基金因认购新股而流通受限的股票

序号	股票简称	股票代码	数量 (股)	总成本	总市值	估值 方法	转让受限 原因	转让受限 期限
1	金陵饭店	601007	106,196	451,333.00	1,531,346.32	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.6-2007.7.9
2	连云港	601008	138,007	687,274.86	2,014,902.20	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.26-2007.7.25
3	交通银行	601328	1,665,082	13,154,147.80	18,299,251.18	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.15-2007.8.15
4	中国远洋	601919	1,324,232	11,229,487.36	24,180,476.32	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.26-2007.9.26
5	中信银行	601998	712,528	4,132,662.40	6,555,257.60	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.27
6	天邦股份	002124	26,954	276,278.50	562,799.52	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.3-2007.7.2
7	湘潭电化	002125	38,467	250,035.50	685,866.61	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.3-2007.7.2
8	露天煤业	002128	87,837	860,802.60	3,170,915.70	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.18-2007.7.17
9	中环股份	002129	98,899	574,603.19	1,534,912.48	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.20-2007.7.19
10	利欧股份	002131	19,284	263,997.96	584,498.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
11	恒星科技	002132	44,423	355,384.00	835,152.40	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.26
12	广宇集团	002133	119,692	1,292,673.60	2,129,320.68	市价	自上市日起冻结三个月	2007.4.27-2007.7.27
13	天津普林	002134	95,400	789,912.00	1,670,454.00	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.16-2007.8.16
14	东南网架	002135	46,891	450,153.60	1,089,746.84	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
15	安纳达	002136	14,784	119,454.72	337,223.04	市价	自上市日起冻结三个月	2007.5.30-2007.8.29
16	实益达	002137	25,390	261,517.00	1,198,154.10	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
17	顺络电子	002138	19,675	267,580.00	675,049.25	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.13-2007.9.12
18	拓邦电子	002139	17,838	186,942.24	1,070,280.00	市价	自上市日起冻结三个月	2007.6.29-2007.10.8
19	三房巷	600370	5,320,499	53,204,990.00	45,064,626.53	市价	网下增发冻结一个月	2007.6.15-2007.7.15
合计				88,809,230.33	113,190,232.81			

(4) 报告期末本基金持有的流通受限制不能自由转让的债券：无

九、税项说明

(一) 印花税

基金管理人运用基金买卖股票按照2%的税率征收印花税。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。

(二) 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。

(三) 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〔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。

第六章 投资组合报告

一、嘉实增长基金

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	2,236,433,617.96	61.65%
债券	727,919,362.98	20.07%
权证	36,618,891.26	1.01%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	542,978,629.17	14.97%
其他资产	83,800,052.31	2.30%
资产合计	3,627,750,553.68	100%

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	112,021,719.42	3.41%
C 制造业	1,180,719,272.34	35.92%
C0 食品、饮料	180,093,158.58	5.48%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	44,541,382.60	1.35%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	99,569,855.22	3.03%
C5 电子	10,433,823.08	0.31%
C6 金属、非金属	39,719,450.35	1.21%
C7 机械、设备、仪表	384,168,697.76	11.69%
C8 医药、生物制品	417,306,726.75	12.70%
C99 其他制造业	4,886,178.00	0.15%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	3,119,361.07	0.09%
E 建筑业	14,328,746.76	0.44%
F 交通运输、仓储业	53,771,968.76	1.64%
G 信息技术业	177,533,193.82	5.40%
H 批发和零售贸易	284,838,502.84	8.66%
I 金融、保险业	161,016,769.79	4.90%
J 房地产业	211,181,137.49	6.43%
K 社会服务业	35,050,700.54	1.07%
L 传播与文化产业	2,852,245.13	0.09%
M 综合类		
合计	2,236,433,617.96	68.05%

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	000848	承德露露	6,005,568	174,161,472.00	5.30%
2	600479	千金药业	6,756,754	155,405,342.00	4.73%

3	600859	王府井	2,964,304	145,695,541.60	4.43%
4	002097	山河智能	1,937,927	136,430,060.80	4.15%
5	000423	东阿阿胶	4,795,505	125,258,590.60	3.81%
6	601166	兴业银行	3,078,070	108,009,476.30	3.29%
7	600583	海油工程	2,585,453	93,593,398.60	2.85%
8	600118	中国卫星	2,901,123	90,602,071.29	2.76%
9	600675	中华企业	3,549,851	80,617,116.21	2.45%
10	600588	用友软件	1,649,341	80,537,321.03	2.45%
11	000402	金融街	2,299,911	66,697,419.00	2.03%
12	000538	云南白药	1,733,016	62,041,972.80	1.89%
13	600315	上海家化	1,421,523	58,097,645.01	1.77%
14	002028	思源电气	913,056	57,412,961.28	1.75%
15	600383	金地集团	1,579,834	54,061,919.48	1.65%
16	600036	招商银行	2,078,582	51,091,545.56	1.55%
17	600150	沪东重机	332,044	45,901,762.56	1.40%
18	000718	苏宁环球	1,327,612	44,541,382.60	1.36%
19	600361	华联综超	1,570,000	43,473,300.00	1.32%
20	600386	*ST 北巴	2,407,596	42,566,297.28	1.30%
21	600299	星新材料	903,867	41,134,987.17	1.25%
22	000410	沈阳机床	1,639,285	39,342,840.00	1.20%
23	600713	南京医药	2,902,162	36,828,435.78	1.12%
24	002024	苏宁电器	741,530	34,822,248.80	1.06%
25	000777	中核科技	1,397,638	28,302,169.50	0.86%
26	000852	江钻股份	1,037,056	26,444,928.00	0.80%
27	600258	首旅股份	618,950	24,176,187.00	0.74%
28	600161	天坛生物	721,137	23,155,709.07	0.70%
29	000709	唐钢股份	1,529,854	19,551,534.12	0.59%
30	600616	第一食品	732,213	18,393,190.56	0.56%
31	002080	中材科技	582,852	17,380,646.64	0.53%
32	600761	安徽合力	565,696	16,122,336.00	0.49%
33	002009	天奇股份	843,742	15,921,411.54	0.48%
34	600085	同仁堂	379,950	14,616,676.50	0.44%
35	600511	国药股份	350,000	13,608,000.00	0.41%
36	000987	广州友谊	372,542	13,281,122.30	0.40%
37	600067	冠城大通	599,893	12,927,694.15	0.39%
38	000419	通程控股	499,911	10,503,130.11	0.32%
39	600138	中青旅	379,958	9,343,167.22	0.28%
40	601919	中国远洋	503,328	9,190,769.28	0.28%
41	000983	西山煤电	279,974	7,903,666.02	0.24%
42	002081	金螳螂	186,846	7,570,999.92	0.23%
43	601699	潞安环能	179,930	7,353,739.10	0.22%
44	600584	长电科技	599,975	7,025,707.25	0.21%
45	002095	网盛科技	99,950	6,393,801.50	0.19%

46	000031	中粮地产	260,000	5,881,200.00	0.18%
47	600266	北京城建	200,000	5,668,000.00	0.17%
48	600059	古越龙山	221,688	5,433,572.88	0.17%
49	600628	新世界	263,507	5,061,969.47	0.15%
50	002003	伟星股份	222,099	4,886,178.00	0.15%
51	000024	招商地产	79,908	3,923,482.80	0.12%
52	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.10%
53	600995	文山电力	396,361	3,119,361.07	0.09%
54	600088	中视传媒	93,793	2,852,245.13	0.09%
55	002122	天马股份	34,709	2,644,478.71	0.08%
56	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.06%
57	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.05%
58	601007	金陵饭店	106,196	1,531,346.32	0.05%
59	601318	中国平安	21,336	1,525,737.36	0.05%
60	600456	宝钛股份	30,000	1,281,300.00	0.04%
61	002123	荣信股份	15,147	1,257,201.00	0.04%
62	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.04%
63	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.03%
64	600482	风帆股份	39,998	876,356.18	0.03%
65	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.03%
66	002138	顺络电子	19,675	675,049.25	0.02%
67	600529	山东药玻	53,113	670,817.19	0.02%
68	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.02%
69	000895	双汇发展	8,603	498,113.70	0.02%
70	601628	中国人寿	9,487	390,010.57	0.01%
71	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.01%
股票投资合计				2,236,433,617.96	68.05%

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	601166	兴业银行	136,863,496.90	5.62%
2	000410	沈阳机床	122,347,104.35	5.02%
3	600067	冠城大通	109,327,151.57	4.49%
4	002097	山河智能	102,616,159.44	4.21%
5	600479	千金药业	95,993,261.61	3.94%
6	600675	中华企业	86,024,098.17	3.53%
7	000852	江钻股份	76,448,294.06	3.14%
8	600588	用友软件	75,322,000.77	3.09%
9	601628	中国人寿	67,707,319.32	2.78%
10	000402	金融街	67,045,581.76	2.75%
11	600383	金地集团	59,305,970.50	2.44%
12	600019	宝钢股份	50,545,810.57	2.08%
13	000987	广州友谊	38,743,104.29	1.59%

14	600299	星新材料	37,214,110.84	1.53%
15	600616	第一食品	36,148,379.67	1.48%
16	000718	苏宁环球	35,106,523.24	1.44%
17	600809	山西汾酒	30,891,209.49	1.27%
18	600036	招商银行	30,263,471.84	1.24%
19	600150	沪东重机	29,737,707.28	1.22%
20	002028	思源电气	29,284,520.24	1.20%

(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	000410	沈阳机床	183,538,923.91	7.54%
2	600859	王府井	168,325,213.93	6.91%
3	600150	沪东重机	143,137,858.35	5.88%
4	600019	宝钢股份	120,632,413.92	4.95%
5	600067	冠城大通	120,498,914.25	4.95%
6	600118	中国卫星	116,329,858.86	4.78%
7	600713	南京医药	100,583,495.40	4.13%
8	601628	中国人寿	89,875,242.11	3.69%
9	600022	济南钢铁	78,497,401.71	3.22%
10	600529	山东药玻	60,410,409.68	2.48%
11	600036	招商银行	56,732,465.60	2.33%
12	600161	天坛生物	55,736,716.92	2.29%
13	601166	兴业银行	54,947,239.90	2.26%
14	600809	山西汾酒	50,597,393.67	2.08%
15	600059	古越龙山	49,507,245.76	2.03%
16	000777	中核科技	47,170,024.05	1.94%
17	601318	中国平安	44,742,087.68	1.84%
18	000709	唐钢股份	43,087,313.66	1.77%
19	000852	江钻股份	42,009,288.56	1.73%
20	000987	广州友谊	41,707,311.80	1.71%

(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)
1,791,486,307.10	2,582,487,955.92

5、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	384,309,408.60	11.70%
2	央行票据		
3	金融债券	332,331,727.38	10.11%
4	企业债券		
5	可转换债券	11,278,227.00	0.34%
6	资产支持证券		
合计		727,919,362.98	22.15%

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	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	20 国债(10)	109,619,516.50	3.34%
2	21 国债(15)	86,460,305.40	2.63%
3	03 进出 01	69,818,830.00	2.12%
4	99 国债(8)	65,644,232.40	2.00%
5	02 国债(14)	63,675,792.50	1.94%

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	权证名称	数量(份)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	031001	侨城 HQC1	1,289,216	36,618,891.26	1.11%
合计			1,289,216	36,618,891.26	1.11%

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

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备选股票库之外的股票。

(3) 基金其他资产的构成

项 目	期末余额(元)
交易保证金	902,701.35
应收利息	12,257,536.66
应收申购款	
待摊费用	
应收证券清算款	70,554,151.10
其他应收款	85,663.20
合计	83,800,052.31

(4) 基金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	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	100236	桂冠转债	10,876,167.00	0.33%
2	110398	凯诺转债	402,060.00	0.01%

(5) 报告期内获得的权证资产：无

二、嘉实稳健基金

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	9,274,648,590.36	53.26%
债券	2,468,929,856.84	14.18%
权证		

资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	559,074,116.76	3.21%
其他资产	5,111,464,234.17	29.35%
资产合计	17,414,116,798.13	100%

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	763,298,767.09	4.53%
C 制造业	3,970,038,975.24	23.59%
C0 食品、饮料	403,111,426.86	2.39%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具	135,758,860.80	0.81%
C3 造纸、印刷	169,436,528.65	1.01%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	164,196,347.91	0.98%
C5 电子	3,408,115.83	0.02%
C6 金属、非金属	1,905,914,006.49	11.32%
C7 机械、设备、仪表	1,092,721,637.15	6.49%
C8 医药、生物制品	95,492,051.55	0.57%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	537,910,246.36	3.20%
E 建筑业	241,843,834.56	1.44%
F 交通运输、仓储业	487,454,769.68	2.90%
G 信息技术业	160,196,083.36	0.95%
H 批发和零售贸易	130,274,204.05	0.77%
I 金融、保险业	1,785,706,701.57	10.61%
J 房地产业	1,104,009,451.55	6.56%
K 社会服务业	86,063,494.22	0.51%
L 传播与文化产业	7,852,062.68	0.05%
M 综合类		
合计	9,274,648,590.36	55.11%

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	000878	云南铜业	34,364,548	1,185,576,906.00	7.04%
2	600036	招商银行	39,330,750	966,749,835.00	5.74%
3	000002	万科A	27,797,134	531,481,202.08	3.16%
4	600900	长江电力	30,718,353	464,461,497.36	2.76%
5	600104	上海汽车	26,168,087	451,922,862.49	2.69%
6	600150	沪东重机	3,005,311	415,454,192.64	2.47%
7	600000	浦发银行	9,979,164	365,137,610.76	2.17%
8	601699	潞安环能	8,797,821	359,566,944.27	2.14%
9	600569	安阳钢铁	41,717,277	352,093,817.88	2.09%
10	600325	华发股份	10,494,430	318,296,061.90	1.89%

11	600266	北京城建	8,316,658	235,694,087.72	1.40%
12	000960	锡业股份	7,209,698	234,387,281.98	1.39%
13	600004	白云机场	12,020,289	223,577,375.40	1.33%
14	600879	火箭股份	5,949,841	158,206,272.19	0.94%
15	600675	中华企业	6,849,900	155,561,229.00	0.92%
16	600015	华夏银行	12,618,967	151,932,362.68	0.90%
17	000858	五 粮 液	4,749,867	149,430,815.82	0.89%
18	600887	伊利股份	4,601,064	143,369,154.24	0.85%
19	600030	中信证券	2,699,902	143,013,808.94	0.85%
20	600337	美克股份	6,115,264	135,758,860.80	0.81%
21	600997	开滦股份	5,650,684	124,315,048.00	0.74%
22	000063	中兴通讯	2,281,171	124,095,702.40	0.74%
23	600308	华泰股份	4,790,363	117,795,026.17	0.70%
24	600717	天津港	4,499,864	113,261,576.88	0.67%
25	600016	民生银行	9,363,973	107,030,211.39	0.63%
26	600519	贵州茅台	849,903	101,716,391.04	0.60%
27	600694	大商股份	1,572,798	96,805,716.90	0.58%
28	000401	冀东水泥	6,354,902	87,443,451.52	0.52%
29	000983	西山煤电	2,999,891	84,686,922.93	0.50%
30	000069	华侨城 A	1,772,330	70,538,734.00	0.42%
31	601006	大秦铁路	4,649,936	70,400,031.04	0.42%
32	000423	东阿阿胶	2,052,648	53,615,165.76	0.32%
33	002078	太阳纸业	1,985,448	51,641,502.48	0.31%
34	600309	烟台万华	949,947	50,879,161.32	0.30%
35	000046	泛海建设	1,443,871	49,799,110.79	0.30%
36	600649	原水股份	3,499,844	49,102,811.32	0.29%
37	600331	宏达股份	999,914	48,445,833.30	0.29%
38	600123	兰花科创	1,499,967	44,879,012.64	0.27%
39	000402	金 融 街	1,499,963	43,498,927.00	0.26%
40	600497	驰宏锌锗	647,725	42,769,281.75	0.25%
41	600713	南京医药	3,299,991	41,876,885.79	0.25%
42	600009	上海机场	1,080,600	41,073,606.00	0.24%
43	600423	柳化股份	2,249,850	39,934,837.50	0.24%
44	600583	海油工程	1,099,959	39,818,515.80	0.24%
45	000001	深发展 A	1,434,534	39,478,375.68	0.23%
46	600118	中国卫星	1,155,952	36,100,380.96	0.21%
47	600089	特变电工	1,151,540	35,409,855.00	0.21%
48	600348	国阳新能	900,952	33,299,185.92	0.20%
49	600547	山东黄金	420,152	30,792,940.08	0.18%
50	601919	中国远洋	1,500,996	27,408,186.96	0.16%
51	600282	南钢股份	2,033,160	27,122,354.40	0.16%
52	600299	星新材料	540,525	24,599,292.75	0.15%
53	000690	宝新能源	1,544,793	24,345,937.68	0.14%

54	600361	华联综超	764,970	21,182,019.30	0.13%
55	600268	国电南自	999,924	15,738,803.76	0.09%
56	600007	中国国贸	749,915	13,993,413.90	0.08%
57	600859	王府井	249,979	12,286,467.85	0.07%
58	601328	交通银行	1,026,088	11,276,707.12	0.07%
59	600456	宝钛股份	249,961	10,675,834.31	0.06%
60	600600	青岛啤酒	331,984	8,595,065.76	0.05%
61	000927	一汽夏利	999,937	8,359,473.32	0.05%
62	600037	歌华有线	299,926	7,852,062.68	0.05%
63	601003	柳钢股份	511,790	7,779,208.00	0.05%
64	600386	*ST 北巴	379,208	6,704,397.44	0.04%
65	000758	中色股份	200,000	5,060,000.00	0.03%
66	600383	金地集团	133,774	4,577,746.28	0.03%
67	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.02%
68	002028	思源电气	50,000	3,144,000.00	0.02%
69	600591	上海航空	483,124	3,014,693.76	0.02%
70	002122	天马股份	34,709	2,644,478.71	0.02%
71	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.01%
72	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.01%
73	601007	金陵饭店	106,196	1,531,346.32	0.01%
74	002123	荣信股份	15,147	1,257,201.00	0.01%
75	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.01%
76	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.01%
77	601166	兴业银行	31,000	1,087,790.00	0.01%
78	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.01%
79	000024	招商地产	16,195	795,174.50	0.00%
80	002138	顺络电子	19,675	675,049.25	0.00%
81	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.00%
82	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.00%
股票投资合计				9,274,648,590.36	55.11%

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超出期初基金资产净值 2% 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	600036	招商银行	1,023,264,740.01	16.89%
2	000878	云南铜业	988,960,823.03	16.33%
3	000002	万科A	583,676,223.80	9.64%
4	600030	中信证券	558,081,148.00	9.21%
5	600900	长江电力	457,627,572.07	7.56%
6	600104	上海汽车	396,669,152.21	6.55%
7	600266	北京城建	379,626,827.63	6.27%
8	000063	中兴通讯	363,760,439.17	6.01%
9	600325	华发股份	355,038,572.06	5.86%

10	600000	浦发银行	353,179,504.76	5.83%
11	601699	潞安环能	346,292,514.28	5.72%
12	000001	深发展 A	316,061,695.09	5.22%
13	600004	白云机场	312,545,888.08	5.16%
14	600569	安阳钢铁	288,970,584.57	4.77%
15	000960	锡业股份	273,225,249.85	4.51%
16	600150	沪东重机	256,205,873.98	4.23%
17	600879	火箭股份	230,866,716.62	3.81%
18	000858	五 粮 液	203,926,096.15	3.37%
19	600015	华夏银行	189,600,356.24	3.13%
20	600600	青岛啤酒	178,100,831.96	2.94%
21	601006	大秦铁路	174,191,254.45	2.88%
22	000069	华侨城 A	169,564,929.32	2.80%
23	600887	伊利股份	146,836,767.96	2.42%
24	000401	冀东水泥	131,662,715.19	2.17%
25	600675	中华企业	131,056,159.76	2.16%
26	600997	开滦股份	125,014,611.08	2.06%
27	600337	美克股份	123,363,906.75	2.04%

(2) 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 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	600036	招商银行	749,385,706.40	12.37%
2	600019	宝钢股份	616,344,525.99	10.18%
3	000002	万 科 A	560,728,939.09	9.26%
4	600028	中国石化	502,101,873.69	8.29%
5	000063	中兴通讯	498,336,450.12	8.23%
6	000858	五 粮 液	469,910,190.61	7.76%
7	600030	中信证券	432,708,146.34	7.14%
8	000898	鞍钢股份	375,427,711.56	6.20%
9	000001	深发展 A	343,421,513.89	5.67%
10	600009	上海机场	335,053,316.03	5.53%
11	600690	青岛海尔	333,995,324.23	5.51%
12	600016	民生银行	295,212,072.31	4.87%
13	000970	中科三环	291,939,731.92	4.82%
14	601006	大秦铁路	198,499,727.37	3.28%
15	000069	华侨城 A	181,279,246.75	2.99%
16	600348	国阳新能	163,826,579.27	2.70%
17	600004	白云机场	158,700,117.30	2.62%
18	600266	北京城建	148,665,746.21	2.45%
19	600600	青岛啤酒	144,625,317.13	2.39%
20	600005	武钢股份	126,394,836.04	2.09%

(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)
--------------	--------------

11,773,183,011.92	8,953,736,424.87
-------------------	------------------

5、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	212,224,713.10	1.26%
2	央行票据		
3	金融债券	2,240,528,240.28	13.31%
4	企业债券	865,100.00	0.01%
5	可转换债券	15,311,803.46	0.09%
6	资产支持证券		
合计		2,468,929,856.84	14.67%

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	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	07进出04	429,640,850.00	2.55%
2	07进出02	357,857,000.00	2.13%
3	07农发02	209,590,290.00	1.25%
4	06进出01	208,644,240.00	1.24%
5	07进出01	195,250,403.92	1.16%

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：无

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

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备选股票库之外的股票。

(3) 基金其他资产的构成

项目	期末余额(元)
交易保证金	3,819,632.56
应收证券清算款	
应收股利	20,471.60
应收利息	33,127,293.54
应收申购款	5,074,496,836.47
其他应收款	
待摊费用	
买入返售证券	
合计	5,111,464,234.17

(4) 基金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	权证名称	数量(份)	成本总额	类别(被动持有或主动投资)
1	580013	武钢 CWB1	99,425	230,397.55	被动投资

注：报告期内，本基金认购武钢股份分离交易可转债而获派的权证武钢 CWB1，按权证公允价值占该转债全部公允价值的比例，将认购该转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本，本基金获得的武钢 CWB1 成本为 230,397.55 元。

三、嘉实债券基金

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	274,068,225.87	7.93%
债券	2,839,835,570.09	82.20%
权证		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	287,476,669.97	8.32%
其他资产	53,379,279.21	1.55%
资产合计	3,454,759,745.14	100%

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	4,416,365.70	0.13%
C 制造业	76,390,615.68	2.29%
C0 食品、饮料	562,799.52	0.02%
C1 纺织、服装、皮毛	45,064,626.53	1.35%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	18,773,089.65	0.56%
C5 电子	6,668,769.83	0.20%
C6 金属、非金属	835,152.40	0.03%
C7 机械、设备、仪表	4,486,177.75	0.13%
C8 医药、生物制品		
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	1,554,546.84	0.05%
F 交通运输、仓储业	40,613,662.92	1.21%
G 信息技术业		
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业	46,307,508.78	1.38%
J 房地产业	85,575,556.28	2.56%
K 社会服务业	19,209,969.67	0.57%
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	274,068,225.87	8.19%

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	000024	招商地产	1,699,516	83,446,235.60	2.49%
2	600370	三房巷	5,320,499	45,064,626.53	1.35%
3	601919	中国远洋	1,324,232	24,180,476.32	0.72%
4	601318	中国平安	300,000	21,453,000.00	0.64%
5	601328	交通银行	1,665,082	18,299,251.18	0.55%
6	600423	柳化股份	1,000,000	17,750,000.00	0.53%
7	600874	创业环保	1,759,067	17,678,623.35	0.53%
8	601006	大秦铁路	549,510	8,319,581.40	0.25%
9	601998	中信银行	712,528	6,555,257.60	0.20%
10	600087	南京水运	469,131	6,098,703.00	0.18%
11	002128	露天煤业	122,337	4,416,365.70	0.13%
12	002122	天马股份	34,709	2,644,478.71	0.08%
13	002133	广宇集团	119,692	2,129,320.68	0.06%
14	002129	中环股份	132,399	2,054,832.48	0.06%
15	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.06%
16	002134	天津普林	95,400	1,670,454.00	0.05%
17	002135	东南网架	66,891	1,554,546.84	0.05%
18	601007	金陵饭店	106,196	1,531,346.32	0.05%
19	002123	荣信股份	15,147	1,257,201.00	0.04%
20	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.04%
21	002139	N拓邦	17,838	1,070,280.00	0.03%
22	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.03%
23	002125	湘潭电化	38,467	685,866.61	0.02%
24	002138	顺络电子	19,675	675,049.25	0.02%
25	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.02%
26	002124	天邦股份	26,954	562,799.52	0.02%
27	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.01%
股票投资合计				274,068,225.87	8.19%

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	000024	招商地产	59,010,853.99	16.56%
2	600370	三房巷	53,204,990.00	14.93%
3	600488	天药股份	43,422,304.36	12.18%
4	600795	国电电力	40,065,445.37	11.24%
5	600001	邯郸钢铁	29,252,797.87	8.21%
6	000488	晨鸣纸业	23,641,836.13	6.63%
7	600317	营口港	20,988,347.59	5.89%
8	600726	华电能源	19,132,357.90	5.37%
9	600423	柳化股份	18,358,406.44	5.15%

10	600874	创业环保	16,044,526.74	4.50%
11	601318	中国平安	14,917,156.80	4.19%
12	601328	交通银行	13,154,147.80	3.69%
13	601919	中国远洋	11,229,487.36	3.15%
14	601998	中信银行	6,417,862.40	1.80%
15	601166	兴业银行	5,241,440.00	1.47%
16	600087	南京水运	5,097,701.99	1.43%
17	600117	西宁特钢	4,158,851.63	1.17%
18	600527	江南高纤	2,494,820.00	0.70%
19	601002	晋亿实业	1,672,778.46	0.47%
20	601003	柳钢股份	1,563,827.00	0.44%

(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	600795	国电电力	51,053,693.68	14.32%
2	600488	天药股份	45,729,825.77	12.83%
3	600001	邯郸钢铁	35,785,805.80	10.04%
4	600726	华电能源	26,512,436.09	7.44%
5	000488	晨鸣纸业	25,831,618.83	7.25%
6	600317	营口港	22,850,776.84	6.41%
7	601333	广深铁路	15,573,974.15	4.37%
8	601166	兴业银行	9,642,178.90	2.71%
9	601318	中国平安	9,636,318.76	2.70%
10	601628	中国人寿	7,531,381.78	2.11%
11	601006	大秦铁路	7,342,940.05	2.06%
12	600423	柳化股份	5,358,566.15	1.50%
13	601002	晋亿实业	4,903,864.62	1.38%
14	601003	柳钢股份	4,662,955.33	1.31%
15	601998	中信银行	4,564,946.98	1.28%
16	600874	创业环保	4,145,080.66	1.16%
17	600117	西宁特钢	3,365,236.09	0.94%
18	600527	江南高纤	2,816,663.29	0.79%
19	600017	日照港	2,578,437.87	0.72%
20	601588	北辰实业	1,942,119.38	0.54%

(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)
400,190,399.33	307,908,176.64

5、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	1,202,073,342.90	35.93%
央行票据	1,440,275,330.13	43.04%
企业债券	4,788,000.00	0.14%
金融债券	99,850,000.00	2.98%

可转换债券	92,848,897.06	2.78%
资产支持证券		
合计	2,839,835,570.09	84.87%

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	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	02 国债(10)	269,550,162.00	8.06%
2	99 国债(8)	266,846,000.40	7.97%
3	21 国债(15)	221,273,656.80	6.61%
4	07 央行票据 22	194,066,095.89	5.80%
5	07 央行票据 13	188,252,000.00	5.63%

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：无

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

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备选股票库之外的股票。

(3) 基金其他资产的构成

项目名称	期末余额(元)
交易保证金	250,000.00
应收证券清算款	770,014.46
应收股利	
应收利息	38,343,492.51
应收申购款	13,897,987.44
其他应收款	117,784.80
待摊费用	
买入返售证券	
合计	53,379,279.21

(4) 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	100236	桂冠转债	14,954,463.00	0.45%
2	100021	上电转债	48,167,837.20	1.44%
3	110398	凯诺转债	2,217,360.90	0.07%
4	110874	创业转债	14,370,320.00	0.43%

(5) 报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	580013	武钢 CWB1	1,199,599	27,779,830.76	被动投资

注：报告期内，本基金认购武钢股份分离交易可转债而获派的权证武钢 CWB1，按权证公允价值占该转债全部公允价值的比例，将认购该转债实际支付全部价款的一部分确认为权证

成本，本基金获得的武钢 CWB1 成本为 27,779,830.76 元。

第七章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

项目	嘉实增长基金	嘉实稳健基金	嘉实债券基金
报告期末基金份额持有人户数（户）	9,458	454,826	25,401
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	92,919.63	36,649.31	110,713.08

二、报告期末基金份额持有人结构

单位：份

项目		嘉实增长基金	嘉实稳健基金	嘉实债券基金
报告期末基金份额总额		878,833,874.01	16,669,057,887.85	2,812,223,013.00
机构	持有基金份额	692,919,112.56	555,598,627.05	1,094,196,730.47
投资者	持有基金份额占总份额的比例	78.85%	3.33%	38.91%
个人	持有基金份额	185,914,761.45	16,113,459,260.80	1,718,026,282.53
投资者	持有基金份额占总份额的比例	21.15%	96.67%	61.09%

第八章 开放式基金份额变动情况

本系列基金份额变动情况如下：

单位：份

项目	嘉实增长基金	嘉实稳健基金	嘉实债券基金
基金合同生效日的基金份额总额	945,335,227.25	1,030,248,511.17	586,521,597.17
报告期期初基金份额总额	1,070,671,701.03	4,609,029,342.38	334,132,310.62
报告期间基金总申购份额	171,709,870.83	16,140,143,881.72	3,591,827,011.85
报告期间基金总赎回份额	363,547,697.85	4,080,115,336.25	1,113,736,309.47
报告期期末基金份额总额	878,833,874.01	16,669,057,887.85	2,812,223,013.00

第九章 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 5 月 14 日，嘉实债券基金收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元，合计派发现金红利 67,536,404.92 元；

2007 年 6 月 28 日，嘉实稳健基金收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元，合计派发现金红利 568,313,838.83 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）嘉实增长基金

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
国泰君安证券股份有限公司	1	1,806,011,587.01	41.67%	1,474,213.69	42.15%
中信证券股份有限公司	1	965,553,630.82	22.28%	755,551.08	21.60%
东吴证券有限责任公司	1	159,086,401.25	3.67%	130,450.16	3.73%
中信建投证券有限责任公司	1	265,100,917.19	6.12%	217,170.30	6.21%
招商证券股份有限公司	1	283,761,169.55	6.55%	222,043.41	6.35%
渤海证券有限责任公司	1	854,467,936.68	19.71%	697,863.36	19.96%
合计	6	4,333,981,642.50	100%	3,497,292.00	100%

② 债券交易情况

证券公司名称	债券成交金额(元)	占债券成交总额比例
国泰君安证券股份有限公司	13,313,668.20	51.00%
中信证券股份有限公司	1,041,625.00	3.99%
东吴证券有限责任公司	724,500.00	2.78%

中信建投证券有限责任公司	3,023,500.00	11.58%
渤海证券有限责任公司	8,000,659.70	30.65%
合计	26,103,952.90	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
国泰君安证券股份有限公司	1,315,000,000.00	69.43%
中信建投证券有限责任公司	36,000,000.00	1.90%
渤海证券有限责任公司	543,000,000.00	28.67%
合计	1,894,000,000.00	100%

④权证交易情况

证券公司名称	权证成交金额(元)	占权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	11,748,885.60	100%
合计	11,748,885.60	100%

⑤报告期内本基金未变更租用的证券公司专用席位

(2) 嘉实稳健基金

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)	占股票成交总金额比例	佣金(元)	占佣金总量比例
联合证券有限责任公司	1	4,556,960,361.38	22.08%	3,736,665.93	22.43%
国泰君安证券股份有限公司	1	3,136,458,493.85	15.19%	2,454,299.08	14.74%
海通证券股份有限公司	1	3,646,221,281.57	17.67%	2,989,364.52	17.95%
中国国际金融有限公司	1	1,032,973,641.35	5.00%	847,032.95	5.09%
中国银河证券有限责任公司	1	280,109,491.78	1.36%	229,509.85	1.38%
申银万国证券股份有限公司	1	3,972,427,768.71	19.25%	3,108,450.39	18.66%
国信证券有限责任公司	1	718,241,979.13	3.48%	588,658.09	3.53%
湘财证券有限责任公司	1	1,283,731,893.85	6.22%	1,052,655.66	6.32%
中信建投证券有限责任公司	1	2,012,826,171.74	9.75%	1,649,690.98	9.90%
合计	9	20,639,951,083.36	100%	16,656,327.45	100%

② 债券交易情况

证券公司名称	债券成交金额(元)	占债券成交总额比例
中信建投证券有限责任公司	18,120,885.50	100%
合计	18,120,885.50	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
联合证券有限责任公司	50,000,000.00	6.85%
海通证券股份有限公司	276,000,000.00	37.81%
中国银河证券有限责任公司	36,000,000.00	4.93%

国信证券有限责任公司	240,000,000.00	32.88%
中信建投证券有限责任公司	128,000,000.00	17.53%
合计	730,000,000.00	100.00%

④权证交易情况

证券公司名称	权证成交金额(元)	占权证成交总额的比例
中信建投证券有限责任公司	598,242.23	100%
合计	598,242.23	100%

⑤本报告期内，本基金新增租用中信建投证券有限责任公司 1 个专用交易席位。

(3) 嘉实债券基金

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)	占股票成交总金额比例	佣金	占佣金总量比例
中信证券股份有限公司	1	268,011,950.13	86.85%	219,763.84	87.37%
联合证券有限责任公司	1	40,584,370.40	13.15%	31,757.94	12.63%
合计	2	308,596,320.53	100%	251,521.78	100%

②债券交易情况

证券公司名称	债券成交金额(元)	占债券成交总额比例	席位使用费(元)	占席位使用费总额比例
中信证券股份有限公司	1,607,833,097.06	91.03%	52,846.50	87.30%
联合证券有限责任公司	158,372,180.42	8.97%	7,688.04	12.70%
合计	1,766,205,277.48	100%	60,534.54	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比例
中信证券股份有限公司	7,849,000,000.00	100%
合计	7,849,000,000.00	100%

④权证交易情况

证券公司名称	权证成交金额(元)	占权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	6,537,874.70	100%
合计	6,537,874.70	100%

⑤报告期内本基金未变更租用的证券公司专用席位

(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	含本系列基金

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	含本系列基金
4	关于运用公司自有资金申购嘉实债券基金的公告	2007 年 2 月 1 日	
5	关于嘉实策略、嘉实成长及嘉实增长基金暂停申购和转入业务的公告	2007 年 2 月 3 日	
6	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	含本系列基金
7	关于旗下开放式基金通过招商银行开办定期定额投资业务的公告	2007 年 3 月 26 日	含本系列基金
8	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	含本系列基金
9	关于旗下开放式基金通过浦发银行网上银行开办定期定投业务的公告	2007 年 4 月 3 日	含嘉实增长、稳健基金
10	关于增加北京银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 4 月 13 日	含本系列基金
11	嘉实债券证券投资基金 2007 年第一次收益分配公告	2007 年 5 月 10 日	派发现金红利 0.50 元/10 份
12	嘉实稳健证券投资基金修改基金合同的公告	2007 年 5 月 25 日	
13	关于嘉实稳健证券投资基金实施基金份额拆分和限量持续销售的公告	2007 年 5 月 25 日	
14	关于嘉实稳健证券投资基金基金份额拆分比例与暂停申购及转入业务的公告	2007 年 5 月 31 日	
15	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	含本系列基金
16	关于恢复嘉实稳健基金申购和转入业务的公告	2007 年 6 月 22 日	
17	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	含本系列基金
18	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	含本系列基金
19	嘉实稳健证券投资基金 2007 年第一次收益分配预告	2007 年 6 月 26 日	
20	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	含本系列基金
21	关于增加中国建设银行为嘉实稳健基金代销机构的公告	2007 年 6 月 27 日	

22	嘉实稳健证券投资基金 2007 年第一次收益分配公告	2007 年 6 月 28 日	
----	----------------------------	-----------------	--

第十章 备查文件目录

一、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、营业执照和公司章程；
- 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。

二、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

三、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