

嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

2007 年年度报告

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：2008 年 3 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 2008 年 3 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。

本报告中的财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留审计意见的审计报告，请投资者注意阅读。

目 录

§1	基金简介.....	1
§2	主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	3
§3	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.....	5
	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等简要展望.....	6
	3.5 基金内部监察报告	6
§4	托管人报告.....	7
§5	审计报告	7
§6	财务会计报告.....	8
	6.1 基金会计报表.....	8
	6.2 年度会计报表附注.....	10
§7	投资组合报告.....	27
§8	基金份额持有人情况.....	52
§9	开放式基金份额变动情况.....	52
§10	重大事件揭示.....	53
§11	备查文件目录.....	56

§1 基金简介

1.1 基金基本资料

(1) 基金名称	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
(2) 基金简称	嘉实 300
(3) 基金交易代码	160706
(4) 基金运作方式	上市契约型开放式
(5) 基金合同生效日	2005 年 8 月 29 日
(6) 报告期末基金份额总额	29,655,949,371.86 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	深圳证券交易所
(9) 上市日期	2005 年 10 月 17 日

1.2 基金产品说明

(1) 投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。
(2) 投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。
(3) 业绩比较基准	沪深 300 指数增长率 × 95% + 银行同业存款收益率 × 5%
(4) 风险收益特征	本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资，力争控制本基金净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%。

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	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

1.4 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) 互联网网址	http://www.boc.cn
(6) 法定代表人	肖钢
(7) 托管部总经理	董杰
(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

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) 登载年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
(3) 基金年度报告置备地点	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 其他有关资料

(1) 聘请的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

(2) 基金注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§2 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

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

序号	项目	2007 年	2006 年	2005 年
1	本期利润	8,659,555,318.53	364,909,576.48	-10,526,585.44
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	6,473,744,002.20	162,890,516.63	-2,442,484.98
3	加权平均基金份额本期利润	0.6207	1.0876	-0.0114
4	期末可供分配利润	620,934,352.58	77,466,774.33	-18,513,607.85
5	期末可供分配基金份额利润	0.0209	0.2394	-0.0192
6	期末基金资产净值	39,342,015,612.47	560,358,003.96	945,519,524.98
7	期末基金份额净值	1.327	1.732	0.981
8	加权平均净值利润率	45.8930%	91.8474%	-1.1884%
9	本期基金份额净值增长率	130.3192%	120.1930%	-1.9000%
10	份额累计净值增长率	397.5109%	116.0093%	-1.9000%

注: 1. 本基金合同生效日为 2005 年 8 月 29 日, 2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 8 月 29 日至 2005 年 12 月 31 日。

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 (
$$E + \frac{P}{\sum_{i=0}^{n-1} \Delta E_i \times (n-i)}$$
) 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。

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
过去三个月	-4.12%	1.88%	-4.07%	1.88%	-0.05%	0.00%
过去六个月	36.68%	1.96%	39.59%	1.97%	-2.91%	-0.01%
过去一年	130.32%	2.18%	150.20%	2.18%	-19.88%	0.01%
自基金合同生效 起至今	397.51%	1.70%	429.96%	1.70%	-32.45%	0.00%

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

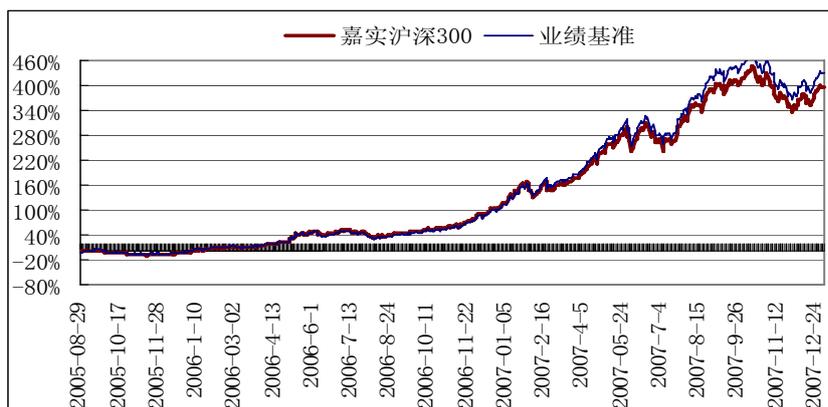


图 1：嘉实 300 基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005 年 8 月 29 日至 2007 年 12 月 31 日)

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制）的规定：（1）基金财产参与股票发行申购，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；（2）原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。（3）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 个交易日内进行调整，并符合相应的规定。

2.2.3 本基金基金合同生效以来每年的净值增长率，并与同期业绩比较基准的收益率比较

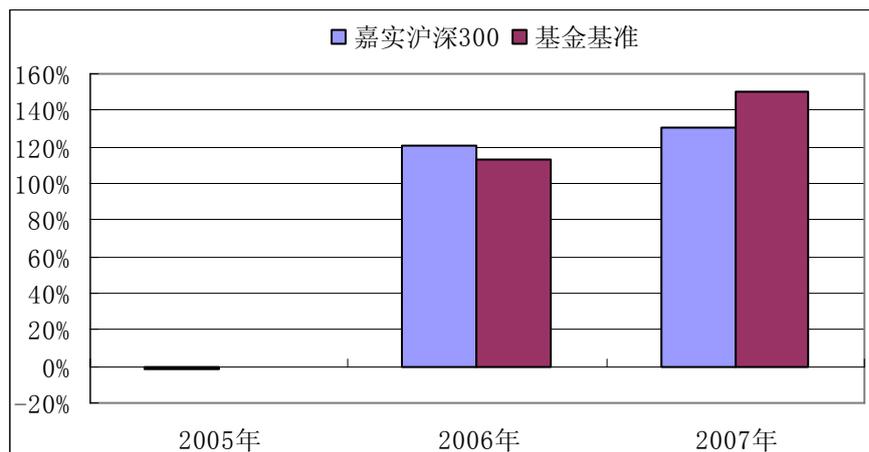


图 2: 嘉实 300 基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率对比图

2.3 过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数 (元)	备注
2007 年	16.180	2007 年分配四次
2006 年	2.500	2006 年分配三次
2005 年	无	2005 年未分配
合计	18.680	

§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，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、QDII 和特定资产管理业务资格。

截止 2007 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、12 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 300 指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金和嘉实海外中国股票基金，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

杨宇先生，南开大学经济学硕士，9 年证券从业经验。曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理兼基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司结构产品投资部总监。2005 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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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 1.327 元，本报告期份额净值增长率为 130.32%，同期业绩比较基准收益率为 150.20%。

报告期内本基金日均跟踪误差为 0.13%，年度化拟合偏离度为 2.05%，符合基金合同约定的年度化跟踪误差不超过 3%的限制。2007 年本基金规模不断扩大，申购资金 T+2 日才能到帐，到帐时间延迟是本基金跟踪误差的主要来源，长期累积下来形成了较大的负偏差。部分股票长时期停牌则是本基金跟踪误差的另一重要来源，股票停牌后本基金无法买入，成份股复牌后大幅上涨又给本基金带来了较大负偏差。另外，非流通股解禁也影响到本基金的跟踪误差，由于股改产生的非流通股解禁比较集中，特别是中国石化等指数主要权重股的非流通股解禁对指数权重影响较大，这会影响到本基金的跟踪效果。

3.4 宏观经济、证券市场及行业走势等简要展望

展望 2008 年，尽管存在宏观调控和周边股市的压力，但基于对中国经济高速稳定增长的信心，我们仍然看好中国 A 股市场的长期发展前景，对 2008 年 A 股表现充满信心。特别是 2008 年第一季度 A 股市场经历了一波较大幅度的调整，估值压力得到了一定的释放，系统性风险明显降低。

沪深 300 指数成份股集中了中国 A 股市场最优质的蓝筹公司，成份股业绩优良、市场代表性强，是中国 A 股市场的中坚力量。特别是随着沪深 300 指数被确定为中国第一只股指期货的标的指数，这将奠定沪深 300 指数的主流指数地位。

作为一个被动型指数基金的投资管理人，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力图进一步降低基金的跟踪误差，为投资者提供一个分享指数成长的有效投资工具。

3.5 基金内部监察报告

报告期内，基金管理人重点开展合规监控、内部审计、风险管理、制度建设、法律支持等内部监察稽核方面工作，合理确保了公司各项业务运作管理的合法合规和审慎经营。

采取的主要措施如下：

(1) 继续完善监察稽核工具和流程、强化内部合规的执行检查

按照法律、行政法规、规章的最新规定和公司各项业务规则、程序的要求，制订或修订了合规管理、风险控制、QDII 基金日常监控手册等风险控制制度。

严格执行内部合规检查程序，包括事前防范、事中控制和事后监督 3 个阶段，合理确保公司各项业务运作合法合规、审慎经营。

(2) 加强中后台业务的风险导向型内审工作

公司引入内审岗位，加强中后台业务内审工作。重点对 IT、TA、基金会计、电子商务、客户服务、公司财务、人力资源等中后台业务部门开展风险导向型内部审计，采用风险控制自我评估方法识别和评估风险，定期测试和评估公司内控制度、流程的有效性，对重大项目进行内部审计等。报告期内上述中后台业务部门未发生违规行为、未发现重大潜在风险。

(3) 为新产品、新业务提供法律支持、积极推进公司管理制度建设

全程参与 QDII 资格申请材料的撰写和申报，参与撰写特定资产管理业务资格申请材料，参与起草、审核新基金、年金投资管理、投资咨询服务等业务法律文件，为公司开展新业务、设计新产品提供了强有力的法律支持。

深入研究法律法规及证监会的监管规则，积极推进公司管理制度建设。参照国际先进的管理经验，制订或修订各项公司管理制度、部门规则和流程。

§4 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”）在对嘉实沪深 300 指数证券投资基金（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。

§5 审计报告

普华永道中天审字(2008)第 20337 号

嘉实沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深 300 指数基金”)的财务报表,包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

(一) 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是嘉实沪深 300 指数基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

(二) 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

(三) 审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了嘉实沪深 300 指数基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所有限公司
中国上海市

许 康 玮
陈 宇

2008 年 3 月 26 日

§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	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
资 产			
银行存款		1,082,622,526.58	7,512,014.31
结算备付金		22,161,146.65	1,127,521.47
存出保证金		18,886,086.27	316,700.00
交易性金融资产	6.2.7(1)	37,887,502,405.58	552,030,797.49
其中：股票投资	6.2.7(1)	36,964,474,405.58	532,149,027.49
债券投资	6.2.7(1)	923,028,000.00	19,881,770.00
资产支持证券投资			
衍生金融资产	6.2.7(2)	280,851,083.18	843,000.00
买入返售金融资产			
应收证券清算款		183,031,142.77	
应收利息	6.2.7(3)	22,551,795.29	115,880.31
应收股利			
应收申购款		102,516,845.40	2,039,977.91
其他资产			
资产总计		39,600,123,031.72	563,985,891.49
负债及持有人权益			
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			
应付证券清算款		29,489,677.43	233,771.44
应付赎回款		196,771,558.76	2,509,243.12
应付管理人报酬		15,507,388.24	210,410.81
应付托管费		3,101,477.64	42,082.16
应付销售服务费			
应付交易费用	6.2.7(4)	11,579,134.62	289,778.77
应交税费			

应付利息	6.2.7 (5)		
应付利润			
其他负债	6.2.7 (6)	1,658,182.56	342,601.23
负债合计		258,107,419.25	3,627,887.53
所有者权益			
实收基金	6.2.7 (7)	29,655,949,371.86	323,536,756.55
未分配利润		9,686,066,240.61	236,821,247.41
所有者权益合计		39,342,015,612.47	560,358,003.96
负债和所有者权益总计		39,600,123,031.72	563,985,891.49

附注：基金份额净值1.327元，基金份额总额29,655,949,371.86份。

6.1.2 利润表

项目	附注	2007 年度	2006 年度
收入			
利息收入		19,552,827.50	338,525.85
其中：存款利息收入		7,532,956.62	229,236.15
债券利息收入		11,798,621.16	109,289.70
买入返售金融资产收入		221,249.72	
投资收益		6,823,250,045.29	167,131,457.74
其中：股票投资收益	6.2.7 (8)	6,715,191,278.31	150,126,895.18
债券投资收益	6.2.7 (9)	263,171.92	68,506.05
衍生工具收益	6.2.7 (10)	9,957,117.39	10,563,353.00
股利收益		97,838,477.67	6,372,703.51
公允价值变动收益	6.2.7 (11)	2,185,811,316.33	202,019,059.85
其他收入	6.2.7 (12)	33,068,831.60	1,773,766.39
收入合计		9,061,683,020.72	371,262,809.83
费用			
管理人报酬		93,346,239.67	2,054,450.31
托管费		18,669,247.93	410,890.00
交易费用	6.2.7 (13)	283,483,701.94	3,339,425.75
利息支出		6,089,510.85	61,281.03
其中：卖出回购金融资产支出		6,089,510.85	61,281.03
其他费用	6.2.7 (14)	539,001.80	487,186.26
费用合计		402,127,702.19	6,353,233.35
利润总额		8,659,555,318.53	364,909,576.48

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

项目	2007 年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	323,536,756.55	236,821,247.41	560,358,003.96
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)		8,659,555,318.53	8,659,555,318.53
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	29,332,412,615.31	8,122,900,093.55	37,455,312,708.86

其中：基金申购款	48,222,050,874.10	15,689,075,469.74	63,911,126,343.83
基金赎回款	18,889,638,258.79	7,566,175,376.19	26,455,813,634.97
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		-7,333,210,418.88	-7,333,210,418.88
年末所有者权益(基金净值)	29,655,949,371.86	9,686,066,240.61	39,342,015,612.47
项目	2006 年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	964,033,132.83	-18,513,607.85	945,519,524.98
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)		364,909,576.48	364,909,576.48
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	-640,496,376.28	-36,124,026.92	-676,620,403.20
其中：基金申购款	625,100,313.78	120,596,521.16	745,696,834.94
基金赎回款	1,265,596,690.06	156,720,548.08	1,422,317,238.14
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		-73,450,694.30	-73,450,694.30
年末所有者权益(基金净值)	323,536,756.55	236,821,247.41	560,358,003.96

6.2 年度会计报表附注

6.2.1 本基金的基本情况

嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 103 号《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 866,926,792.65 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2005 年 8 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 867,126,900.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 200,107.42 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第93号文审核同意,本基金 344,534,887.00 份基金份额于 2005 年 10 月 17 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股,一级市场初次发行或增发的新股,以及不低于基金资产净值 5%的现金或

者到期日在一年以内的政府债券。本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以运用衍生金融产品进行风险管理。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×95% + 银行同业存款收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司于 2008 年 3 月 26 日批准报出。

6.2.2 会计报表编制遵守基本会计假设和企业会计准则情况

本基金年度报告中会计报表的编制遵守基本会计假设，遵循企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.3 重要会计政策和会计估计

(一) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金原以 2006 年 2 月 15 日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》（以下合称“原会计准则和制度”）、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起，本基金开始执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。本财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制的年度财务报表。

在编制本财务报表时，2006 年度的相关比较数字及以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则重新列报。按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净收益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及利润总额的金额调节过程列示如下：

项 目	2006 年年初 所有者权益	2006 年度 净损益	2006 年年末 所有者权益
按原会计准则列报的金额	945,519,524.98	162,890,516.63	560,358,003.96
金融资产公允价值变动的调整数		202,019,059.85	
按新会计准则列报的金额	945,519,524.98	364,909,576.48	560,358,003.96

项 目	2007 年年初 所有者权益	2007 年上半年 净损益	2007 年上半年末 所有者权益
按原会计准则列报的金额	560,358,003.96	1,038,351,632.84	14,188,796,772.36
金融资产公允价值变动的调整数		2,294,748,738.25	
按新会计准则列报的金额	560,358,003.96	3,333,100,371.09	14,188,796,772.36

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算,相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

(二) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(三) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(四) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。股票投资、债券投资、权证投资和资产支持证券为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值,且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

(五) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,其他金融资产划分为贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融

负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

(六) 基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

1. 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

2006 年 11 月 13 日之前取得的非公开发行股票，在锁定期内按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。自 2006 年 11 月 13 日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

2. 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易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估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易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估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

3. 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

(七) 证券投资的成本计价方法

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

a. 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期

损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

b. 债券投资

2007 年 7 月 1 日之前, 买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资; 买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认, 取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自 2007 年 7 月 1 日起, 买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认, 取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益, 上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007 年 7 月 1 日之前, 卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失); 自 2007 年 7 月 1 日起, 卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

c. 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007 年 7 月 1 日之前, 权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认, 取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额; 自 2007 年 7 月 1 日起, 权证投资成本按交易日权证的公允价值确认, 取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。获赠权证(包括配股权证)在除权日, 按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

2. 贷款和应收账款

2007 年 7 月 1 日之前, 贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账, 并采用名义利率法确认相关的利息收入, 其中买入返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额; 自 2007 年 7 月 1 日起, 贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额, 采用实际利率法以摊余成本进行后续计量, 终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益, 直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法, 其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的

总额作为初始确认金额。

3. 其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自 2007 年 7 月 1 日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

(八) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在实际受益期限内逐日摊销。

(九) 收入的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。自 2007 年 7 月 1 日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(十) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

(十一) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。在符合有关分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当期收益先弥补以前年度亏损后方可进行当年收益分配。基金当年亏损则不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

(十二) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

(十三) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

(十四) 重大会计差错的内容和更正金额

报告期内，本基金无涉及重大会计差错事项。

6.2.4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代

缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3%的税率缴纳。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.2.5 资产负债表日后事项：无

6.2.6 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
中诚信托投资有限责任公司	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
国都证券有限责任公司	同受重大影响的公司
中诚期货经纪有限责任公司	同受重大影响的公司

(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。(以下各项除特别注明外，金额单位为人民币元)。

1. 通过关联方席位进行的交易

本基金本年度未通过关联方席位进行证券交易。

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人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 93,346,239.67 元(2006 年：2,054,450.31 元)。

(2) 基金托管费

支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 $\times 0.10\%$ / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 18,669,247.93 元(2006 年: 410,890.00 元)。

3.与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金与基金托管人中国银行股份有限公司通过银行间市场进行的债券交易如下:

项目	2007 年	2006 年
买入债券结算金额	692,559,175.10	19,874,834.11
卖出债券结算金额	30,133,835.62	9,991,300.00
卖出回购金融资产协议金额	2,922,510,000.00	
卖出回购金融资产支出	2,320,287.78	

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保管,按约定利率计息。基金托管人于2007年12月31日保管的银行存款余额为1,082,622,526.58元(2006年12月31日: 7,512,014.31元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为6,426,751.61元(2006年: 218,950.75元)。

5 关联方投资本基金情况

关联方	2007 年 12 月 31 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	20,000,800.00	0.07%	20,000,800	6.18%
国都证券有限责任公司	5,000,000.00	0.02%	5,000,000	1.55%
中诚期货经纪有限责任公司			843,600	0.26%
立信投资有限责任公司			2,887,792.46	0.89%
合计	25,000,800.00	0.09%	28,732,192.46	8.88%

6.2.7 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) 交易性金融资产

项目	2007-12-31			2006-12-31		
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值
股票投资	34,608,864,956.13	36,964,474,405.58	2,355,609,449.45	339,057,068.10	532,149,027.49	193,091,959.39
债券投资	交易所市场					
	银行间市场	921,930,165.34	923,028,000.00	1,097,834.66	19,881,770.00	
	合计	921,930,165.34	923,028,000.00	1,097,834.66	19,881,770.00	
资产支持证券投资						

(2) 衍生金融资产

项目	2007-12-31			2006-12-31		
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值
权证投资	257,812,091.57	280,851,083.18	23,038,991.61	0	843,000.00	843,000.00

(3) 应收利息

项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应收债券利息	22,269,383.74	111,780.82
应收银行存款利息	266,557.23	3,562.19
应收结算备付金利息	9,972.50	507.30
应收申购款利息	5,851.82	-
应收权证利息	30.00	30.00
合计	22,551,795.29	115,880.31

(4) 应付交易费用

项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付交易所交易佣金	11,569,909.50	289,778.77
应付银行间市场交易费用	9,225.12	
合计	11,579,134.62	289,778.77

(5) 应付利息：无**(6) 其他负债**

项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付券商席位保证金	750,000.00	250,000.00
预提费用	150,000.00	83,330.27
应付赎回费	741,570.14	9,060.96
其他应付款	16,612.42	210.00
合计	1,658,182.56	342,601.23

(7) 实收基金

项目	2007 年度		2006 年度	
	基金份额数	基金面值	基金份额数	基金面值
本期期初数	323,536,756.55	323,536,756.55	964,033,132.83	964,033,132.83
加：本期申购	48,222,050,874.10	48,222,050,874.10	625,100,313.78	625,100,313.78
减：本期赎回	18,889,638,258.79	18,889,638,258.79	1,265,596,690.06	1,265,596,690.06
本期期末数	29,655,949,371.86	29,655,949,371.86	323,536,756.55	323,536,756.55

(8) 股票投资收益

项目	2007 年度	2006 年度
卖出股票成交总额	25,255,388,245.59	1,168,201,613.60
减：卖出股票成本总额	18,540,196,967.28	1,018,074,718.42
股票差价收入	6,715,191,278.31	150,126,895.18

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 97,359.24 元（2006 年度：2,254,844.80 元），已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券投资收益

项目	2007 年度	2006 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	841,566,835.62	10,360,180.00
减：应收利息总额	15,569,835.62	103,807.29
减：卖出及到期兑付债券成本总额	825,733,828.08	10,187,866.66

债券差价收入	263,171.92	68,506.05
--------	------------	-----------

(10) 衍生工具收益

项目	2007 年度	2006 年度
卖出权证成交总额	221,319,465.92	10,563,353.00
减：卖出权证成本总额	211,362,348.53	
	9,957,117.39	10,563,353.00

(11) 公允价值变动收益/损失

项目	2007 年度	2006 年度
交易性金融资产		
——股票投资	2,162,517,490.06	201,176,059.85
——债券投资	1,097,834.66	-
——资产支持证券投资		
衍生工具		
——权证投资	22,195,991.61	843,000.00
交易性金融负债		
合计	2,185,811,316.33	202,019,059.85

(12) 其他收入

项目	2007 年度	2006 年度
赎回基金补偿收入	33,043,831.60	1,772,784.69
其他	25,000.00	981.70
合计	33,068,831.60	1,773,766.39

(13) 交易费用

项目	2007 年度	2006 年度
交易所市场	283,477,576.94	3,339,325.75
银行间市场	6,125.00	100.00
合计	283,483,701.94	3,339,425.75

(14) 其他费用

项目	2007 年度	2006 年度
信息披露费	266,669.73	297,594.99
审计费用	150,000.00	50,000.00
上市年费	60,000.00	105,000.00
银行汇划费用	44,332.07	15,961.27
银行间账户维护费	18,000.00	18,630.00
合计	539,001.80	487,186.26

(15) 收益分配

项目	2007 年度	2006 年度
第一次收益分配	447,345,831.38	20,447,956.60
第二次收益分配	239,243,447.50	9,383,905.17
第三次收益分配	1,745,633,399.02	43,618,832.53
第四次收益分配	4,900,987,740.98	

累计收益分配	7,333,210,418.88	73,450,694.30
--------	------------------	---------------

6.2.8 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。

(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

股票代码	股票简称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
方案沟通协商阶段停牌:								
600643	S 爱建	07-12-20	28.39	08-01-29	17.90	1,750,741	36,560,065.69	49,703,735.72
方案实施阶段停牌:								
000068	S 三星	07-11-01	10.30	08-01-14	8.65	1,267,911	10,242,343.46	13,059,977.70
合计							46,802,409.15	62,763,713.42

(2) 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的证券

序号	证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
1	601088	中国神华	07-09-27	08-01-09	新股流通受限	36.99	65.61	1,284,282	47,505,591.18	84,261,742.02
2	601601	中国太保	07-12-18	08-03-26	新股流通受限	30.00	49.45	760,104	22,803,120.00	37,587,142.80
3	601857	中国石油	07-10-30	08-02-05	新股流通受限	16.70	30.96	2,250,853	37,589,245.10	69,686,408.88
4	601918	国投新集	07-12-07	08-03-20	新股流通受限	5.88	15.92	445,632	2,620,316.16	7,094,461.44
5	600125	铁龙物流	07-12-24	08-02-19	增发流通受限	11.67	13.14	324,757	3,789,914.19	4,267,306.98
6	600832	东方明珠	07-12-20	08-01-04	增发流通受限	16.59	18.25	172,565	2,862,853.35	3,149,311.25
7	600118	中国卫星	07-12-28	08-01-08	增发流通受限	18.19	38.45	185,199	3,368,769.81	7,120,901.55
8	002177	御银股份	07-10-24	08-02-01	新股流通受限	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
9	002178	延华智能	07-10-24	08-02-01	新股流通受限	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
10	002179	中航光电	07-10-22	08-02-01	新股流通受限	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10
11	002189	利达光电	07-11-19	08-03-03	新股流通受限	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
12	002190	成飞集成	07-11-19	08-03-03	新股流通受限	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
13	002193	山东如意	07-11-28	08-03-07	新股流通受限	13.07	24.10	15,044	196,625.08	362,560.40
14	002194	武汉凡谷	07-11-28	08-03-07	新股流通受限	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
15	002195	海隆软件	07-12-04	08-03-12	新股流通受限	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
16	002196	方正电机	07-12-04	08-03-12	新股流通受限	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
17	002199	东晶电子	07-12-12	08-03-21	新股流通受限	8.80	25.50	9,645	84,876.00	245,947.50
18	002200	绿大地	07-12-11	08-03-21	新股流通受限	16.49	49.70	16,647	274,509.03	827,355.90
19	002201	九鼎新材	07-12-13	08-03-26	新股流通受限	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
20	002181	粤传媒	07-11-07	08-02-18	新股流通受限	7.49	26.68	12,422	93,040.78	331,418.96
21	002182	云海金属	07-11-02	08-02-13	新股流通受限	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
22	002183	怡亚通	07-11-02	08-02-13	新股流通受限	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20
23	002184	海得控制	07-11-07	08-02-18	新股流通受限	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
24	002186	全聚德	07-11-07	08-02-20	新股流通受限	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
25	002187	广百股份	07-11-12	08-02-22	新股流通受限	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
26	002188	新嘉联	07-11-12	08-02-22	新股流通受限	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
27	601600	中国铝业	07-12-28	08-01-04	换股吸收合并	35.01	39.39	1,731,448	60,624,062.54	68,201,736.72

合计									185,161,646.16	293,105,097.75
----	--	--	--	--	--	--	--	--	----------------	----------------

(3) 报告期末本基金持有的暂时停牌股票

序号	股票代码	股票简称	停牌日期	期末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
1	600236	桂冠电力	07-11-23	11.95	重大事项尚未公告	08-01-03	13.15	3,098,222	39,234,981.98	37,023,752.90
2	600316	洪都航空	07-11-02	38.19	筹划非公开发行股票	08-01-03	42.01	670,401	22,792,803.95	25,602,614.19
3	600331	宏达股份	07-09-27	80.20	筹划非公开发行股票	未知	未知	1,483,547	101,764,677.56	118,980,469.40
4	600415	小商品城	07-12-11	86.59	筹划定向增发	08-03-05	95.25	474,961	45,097,487.24	41,126,872.99
5	601991	大唐发电	07-12-28	20.62	参与重整计划	08-01-10	20.62	9,289,291	180,937,857.99	191,545,180.42
6	000400	许继电气	07-09-10	18.90	引进战略投资者	08-01-07	20.79	1,469,629	22,125,576.73	27,775,988.10
7	000937	金牛能源	07-12-21	28.11	对沧州化工进行重组	08-01-02	29.99	2,138,715	47,858,017.07	60,119,278.65
8	000962	东方铝业	07-10-15	30.36	专项活动整改	08-01-29	27.32	1,166,142	17,903,980.15	35,404,071.12
9	600428	中远航运	07-12-28	38.95	发行分离交易可转债	08-01-02	37.60	2,128,446	68,744,088.93	82,902,971.70
10	000046	泛海建设	07-12-28	45.50	审核发行股份收购资产	08-01-03	48.88	1,223,908	59,963,104.42	55,687,814.00
11	000063	中兴通讯	07-12-28	63.69	审核发行分离交易可转债	08-01-02	62.70	3,037,748	173,436,589.96	193,474,170.12
12	000089	深圳机场	07-12-28	12.72	向特定对象发行股份购买资产	08-01-03	13.29	3,907,860	44,252,694.18	49,707,979.20
	合计								824,111,860.16	919,351,162.79

(4) 报告期末债券正回购交易中作为质押的债券：无

6.2.9 风险管理

(1) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了

充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本公司建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

(2) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且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的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

(3) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，因此除在 6.2.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(4) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金原则上将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

项目	2007 年 12 月 31 日		2006 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	公允价值	占基金资产净值的比例
交易性金融资产				
- 股票投资	36,964,474,405.58	93.96%	532,149,027.49	94.97%
- 债券投资	923,028,000.00	2.35%	19,881,770.00	3.55%
衍生金融资产				
- 权证投资	280,851,083.18	0.71%	843,000.00	0.15%
合计	38,168,353,488.76	97.02%	552,873,797.49	98.66%

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准(见 6.2.1)的公允价值上升 5% 且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 19.48 亿元 (2006 年 12 月 31 日：0.28 亿元)；反之，若本基金业绩比较基准(见 6.2.11)且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 19.48 亿元 (2006 年 12 月 31 日：0.28 亿元)。

(ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率风险敞口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2007 年 12 月 31 日	6 个月至 1 年	不计息	合计
资产			
银行存款	1,082,622,526.58	-	1,082,622,526.58

结算备付金	22,161,146.65	-	-	22,161,146.65
存出保证金	-	-	18,886,086.27	18,886,086.27
交易性金融资产	923,028,000.00	-	36,964,474,405.58	37,887,502,405.58
衍生金融资产	-	-	280,851,083.18	280,851,083.18
应收证券清算款	-	-	183,031,142.77	183,031,142.77
应收利息	-	-	22,551,795.29	22,551,795.29
应收申购款	6,063,503.81	-	96,453,341.59	102,516,845.40
资产总计	2,033,875,177.04	-	37,566,247,854.68	39,600,123,031.72
负债				
应付证券清算款	-	-	29,489,677.43	29,489,677.43
应付赎回款	-	-	196,771,558.76	196,771,558.76
应付管理人报酬	-	-	15,507,388.24	15,507,388.24
应付托管费	-	-	3,101,477.64	3,101,477.64
应付交易费用	-	-	11,579,134.62	11,579,134.62
其他负债	-	-	1,658,182.56	1,658,182.56
负债总计	-	-	258,107,419.25	258,107,419.25
利率风险敞口	2,033,875,177.04	-	37,308,140,435.43	39,342,015,612.47

2006 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	不计息	合计
资产				
银行存款	7,512,014.31	-	-	7,512,014.31
结算备付金	1,127,521.47	-	-	1,127,521.47
存出保证金	-	-	316,700.00	316,700.00
交易性金融资产	-	19,881,770.00	532,149,027.49	552,030,797.49
衍生金融资产	-	-	843,000.00	843,000.00
应收利息	-	-	115,880.31	115,880.31
应收申购款	-	-	2,039,977.91	2,039,977.91
资产总计	8,639,535.78	19,881,770.00	535,464,585.71	563,985,891.49
负债				
应付证券清算款	-	-	233,771.44	233,771.44
应付赎回款	-	-	2,509,243.12	2,509,243.12
应付管理人报酬	-	-	210,410.81	210,410.81
应付托管费	-	-	42,082.16	42,082.16
应付交易费用	-	-	289,778.77	289,778.77
其他负债	-	-	342,601.23	342,601.23
负债总计	-	-	3,627,887.53	3,627,887.53
利率风险敞口	8,639,535.78	19,881,770.00	531,836,698.18	560,358,003.96

于 2007 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例约为 2.35%(2006 年 12 月 31 日：3.55%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

(iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.10 其他事项说明：无

§7 投资组合报告

7.1 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	36,964,474,405.58	93.34%
债券	923,028,000.00	2.33%
权证	280,851,083.18	0.71%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	1,104,783,673.23	2.79%
其他资产	326,985,869.73	0.83%
合计	39,600,123,031.72	100.00%

7.2 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	165,733,896.62	0.42%
B 采掘业	4,390,797,483.71	11.16%
C 制造业	11,548,103,984.60	29.35%
C0 食品、饮料	1,298,438,146.65	3.30%
C1 纺织、服装、皮毛	298,296,749.36	0.76%
C2 木材、家具	27,297,680.25	0.07%
C3 造纸、印刷	160,573,849.19	0.41%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	944,425,188.59	2.40%
C5 电子	154,472,012.00	0.39%
C6 金属、非金属	4,914,528,660.63	12.49%
C7 机械、设备、仪表	3,181,780,098.57	8.09%
C8 医药、生物制品	406,751,254.85	1.03%
C99 其他制造业	161,540,344.51	0.41%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	2,054,721,716.43	5.22%
E 建筑业	312,832,523.09	0.80%
F 交通运输、仓储业	3,543,574,669.47	9.01%
G 信息技术业	1,440,931,278.94	3.66%
H 批发和零售贸易	1,296,427,703.77	3.30%
I 金融、保险业	8,259,041,332.39	20.99%
J 房地产业	2,206,692,457.14	5.61%
K 社会服务业	689,215,970.30	1.75%
L 传播与文化产业	168,378,197.04	0.43%
M 综合类	888,023,192.08	2.26%
合计	36,964,474,405.58	93.96%

7.3 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	600028	中国石化	75,917,685	1,778,751,359.55	4.52%
2	600030	中信证券	17,997,565	1,606,642,627.55	4.08%
3	600000	浦发银行	23,619,327	1,247,100,465.60	3.17%
4	600036	招商银行	31,064,053	1,231,068,420.39	3.13%
5	600016	民生银行	78,603,412	1,164,902,565.84	2.96%
6	000002	万科A	32,844,813	947,244,406.92	2.41%
7	600050	中国联通	57,535,564	695,029,613.12	1.77%
8	600019	宝钢股份	38,027,356	663,197,088.64	1.69%
9	600900	长江电力	30,657,526	597,515,181.74	1.52%
10	600519	贵州茅台	2,561,895	589,235,850.00	1.50%
11	601318	中国平安	5,196,906	551,391,726.60	1.40%
12	601006	大秦铁路	21,134,355	541,462,175.10	1.38%
13	601398	工商银行	65,499,960	532,514,674.80	1.35%
14	601857	中国石油	16,286,279	504,223,197.84	1.28%
15	601600	中国铝业	11,440,951	450,659,059.89	1.15%
16	601088	中国神华	6,840,282	448,790,902.02	1.14%
17	600018	上港集团	45,581,336	414,334,344.24	1.05%
18	002024	苏宁电器	5,477,910	393,587,833.50	1.00%
19	000001	深发展A	9,062,787	349,823,578.20	0.89%
20	600005	武钢股份	17,020,285	335,299,614.50	0.85%
21	601919	中国远洋	7,820,648	333,628,843.68	0.85%
22	000898	鞍钢股份	10,014,472	302,236,764.96	0.77%
23	600011	华能国际	19,543,547	289,830,802.01	0.74%
24	601628	中国人寿	4,885,885	283,088,176.90	0.72%
25	601166	兴业银行	5,428,784	281,536,738.24	0.72%
26	600104	上海汽车	10,669,171	280,492,505.59	0.71%
27	600150	中国船舶	1,079,097	269,493,684.78	0.69%
28	600739	辽宁成大	4,870,733	241,198,698.16	0.61%
29	600009	上海机场	6,276,640	235,499,532.80	0.60%
30	601111	中国国航	8,518,496	233,747,530.24	0.59%
31	600015	华夏银行	11,400,406	218,431,778.96	0.56%
32	600048	保利地产	3,328,362	215,744,424.84	0.55%
33	600320	振华港机	8,297,442	210,589,077.96	0.54%
34	000983	西山煤电	3,289,905	208,810,270.35	0.53%
35	000568	泸州老窖	2,835,276	208,392,786.00	0.53%
36	000527	美的电器	5,475,315	203,188,939.65	0.52%
37	000792	盐湖钾肥	2,500,169	194,713,161.72	0.49%
38	600029	南方航空	6,948,864	194,151,260.16	0.49%
39	000063	中兴通讯	3,037,748	193,474,170.12	0.49%
40	601991	大唐发电	9,289,291	191,545,180.42	0.49%
41	601328	交通银行	12,123,767	189,373,240.54	0.48%

42	600795	国电电力	10,351,166	180,524,335.04	0.46%
43	000069	华侨城 A	3,577,046	179,746,561.50	0.46%
44	600177	雅戈尔	7,252,656	177,907,651.68	0.45%
45	600309	烟台万华	4,514,993	171,795,483.65	0.44%
46	000651	格力电器	3,284,781	162,103,942.35	0.41%
47	600583	海油工程	3,095,767	161,227,545.36	0.41%
48	000709	唐钢股份	6,151,627	153,667,642.46	0.39%
49	600031	三一重工	2,692,746	153,594,231.84	0.39%
50	600383	金地集团	3,644,195	148,683,156.00	0.38%
51	000629	攀钢钢钒	10,694,863	144,915,393.65	0.37%
52	600881	亚泰集团	6,857,363	143,730,328.48	0.37%
53	601333	广深铁路	15,273,787	143,573,597.80	0.36%
54	000157	中联重科	2,477,156	142,312,612.20	0.36%
55	000825	太钢不锈	5,632,658	139,520,938.66	0.35%
56	000039	中集集团	5,350,225	138,463,823.00	0.35%
57	600642	申能股份	7,843,599	138,125,778.39	0.35%
58	601169	北京银行	6,758,658	137,606,276.88	0.35%
59	600010	包钢股份	17,435,227	137,040,884.22	0.35%
60	601666	平煤天安	2,917,244	135,418,466.48	0.34%
61	600585	海螺水泥	1,845,679	134,402,344.78	0.34%
62	600717	天津港	4,719,147	129,304,627.80	0.33%
63	000562	宏源证券	3,173,025	124,382,580.00	0.32%
64	600001	邯郸钢铁	15,289,879	124,000,918.69	0.32%
65	000060	中金岭南	2,779,039	123,500,493.16	0.31%
66	600649	原水股份	6,137,969	123,434,556.59	0.31%
67	601588	北辰实业	8,664,309	122,686,615.44	0.31%
68	600026	中海发展	3,306,161	122,394,080.22	0.31%
69	601872	招商轮船	9,291,652	119,583,561.24	0.30%
70	000024	招商地产	2,015,115	119,294,808.00	0.30%
71	600331	宏达股份	1,483,547	118,980,469.40	0.30%
72	000402	金融街	4,098,278	115,981,267.40	0.29%
73	600550	天威保变	1,987,680	113,715,172.80	0.29%
74	601808	中海油服	3,274,182	112,435,409.88	0.29%
75	000878	云南铜业	2,046,743	112,181,983.83	0.29%
76	600100	同方股份	2,388,816	109,909,424.16	0.28%
77	600037	歌华有线	3,453,245	108,570,022.80	0.28%
78	601168	西部矿业	2,587,279	107,915,407.09	0.27%
79	600887	伊利股份	3,615,836	106,052,469.88	0.27%
80	600655	豫园商城	3,284,033	105,318,938.31	0.27%
81	600489	中金黄金	912,077	104,113,589.55	0.26%
82	600089	特变电工	3,199,920	103,453,413.60	0.26%
83	600008	首创股份	4,777,338	101,088,472.08	0.26%
84	601699	潞安环能	1,388,022	99,618,338.94	0.25%

85	000933	神火股份	1,900,108	99,413,650.56	0.25%
86	600832	东方明珠	5,401,806	98,582,959.50	0.25%
87	601998	中信银行	9,688,697	98,340,274.55	0.25%
88	600690	青岛海尔	4,359,908	97,923,533.68	0.25%
89	600660	福耀玻璃	2,718,490	97,485,051.40	0.25%
90	000895	双汇发展	1,639,876	96,736,285.24	0.25%
91	600631	百联股份	4,184,115	96,318,327.30	0.24%
92	000960	锡业股份	1,457,229	96,264,547.74	0.24%
93	600811	东方集团	4,640,426	94,711,094.66	0.24%
94	000897	津滨发展	6,271,335	94,446,305.10	0.24%
95	600221	海南航空	7,264,844	93,571,190.72	0.24%
96	600635	大众公用	5,411,879	92,921,962.43	0.24%
97	000338	潍柴动力	1,069,753	92,640,609.80	0.24%
98	600362	江西铜业	1,775,590	90,484,066.40	0.23%
99	000652	泰达股份	4,005,278	90,439,177.24	0.23%
100	000630	铜陵有色	3,513,434	89,100,686.24	0.23%
101	600688	S 上石化	5,287,605	88,937,516.10	0.23%
102	000839	中信国安	2,540,710	87,654,495.00	0.22%
103	000027	深圳能源	3,586,907	87,305,316.38	0.22%
104	000768	西飞国际	2,380,433	87,123,847.80	0.22%
105	600500	中化国际	3,902,059	86,157,462.72	0.22%
106	000758	中色股份	2,207,176	85,219,065.36	0.22%
107	600497	驰宏锌锗	1,058,669	84,397,092.68	0.21%
108	000800	一汽轿车	4,417,682	84,377,726.20	0.21%
109	600428	中远航运	2,128,446	82,902,971.70	0.21%
110	600808	马钢股份	8,127,326	81,598,353.04	0.21%
111	600058	五矿发展	1,795,791	79,338,046.38	0.20%
112	600694	大商股份	1,594,529	77,940,577.52	0.20%
113	600219	南山铝业	2,863,830	76,435,622.70	0.19%
114	600271	航天信息	1,169,748	76,185,687.24	0.19%
115	601009	南京银行	3,988,432	76,179,051.20	0.19%
116	000793	华闻传媒	7,383,894	75,832,591.38	0.19%
117	000031	中粮地产	2,953,928	75,443,321.12	0.19%
118	600685	广船国际	915,518	74,861,906.86	0.19%
119	600456	宝钛股份	1,103,734	74,634,493.08	0.19%
120	600675	中华企业	3,445,578	74,079,927.00	0.19%
121	000423	东阿阿胶	2,274,643	74,062,376.08	0.19%
122	600748	上实发展	1,594,860	74,001,504.00	0.19%
123	600786	东方锅炉	871,700	73,615,065.00	0.19%
124	600547	山东黄金	434,340	73,399,116.60	0.19%
125	000751	锌业股份	4,218,700	73,236,632.00	0.19%
126	600596	新安股份	1,089,837	73,160,757.81	0.19%
127	000932	华菱管线	6,019,539	71,873,295.66	0.18%

128	600601	方正科技	9,372,696	71,326,216.56	0.18%
129	600188	兖州煤业	3,213,890	70,834,135.60	0.18%
130	600027	华电国际	7,475,530	70,793,269.10	0.18%
131	000488	晨鸣纸业	4,365,833	70,508,202.95	0.18%
132	600432	吉恩镍业	690,749	70,242,265.81	0.18%
133	000612	焦作万方	1,564,145	70,120,620.35	0.18%
134	000959	首钢股份	8,052,285	69,974,356.65	0.18%
135	600348	国阳新能	1,305,708	69,881,492.16	0.18%
136	600269	赣粤高速	3,803,392	69,868,311.04	0.18%
137	600068	葛洲坝	4,520,589	69,526,658.82	0.18%
138	600143	金发科技	1,791,602	69,245,417.30	0.18%
139	600115	东方航空	3,199,979	68,127,552.91	0.17%
140	000422	湖北宜化	2,944,520	67,753,405.20	0.17%
141	600997	开滦股份	1,523,371	66,875,986.90	0.17%
142	600886	国投电力	4,007,787	66,729,653.55	0.17%
143	600569	安阳钢铁	5,478,255	65,793,842.55	0.17%
144	000401	冀东水泥	3,136,032	65,072,664.00	0.17%
145	600868	梅雁水电	10,304,599	64,918,973.70	0.17%
146	600004	白云机场	3,080,649	64,632,016.02	0.16%
147	000528	柳 工	1,538,936	64,065,905.68	0.16%
148	600108	亚盛集团	7,848,616	63,887,734.24	0.16%
149	600638	新黄浦	2,437,122	62,877,747.60	0.16%
150	000729	燕京啤酒	2,986,522	62,866,288.10	0.16%
151	600875	东方电气	702,506	62,523,034.00	0.16%
152	600123	兰花科创	1,328,987	62,382,649.78	0.16%
153	000539	粤电力A	4,330,174	62,267,902.12	0.16%
154	600839	四川长虹	7,213,510	62,252,591.30	0.16%
155	600591	上海航空	3,522,793	61,543,193.71	0.16%
156	600357	承德钒钛	3,194,350	60,884,311.00	0.15%
157	600210	紫江企业	6,239,812	60,463,778.28	0.15%
158	000829	天音控股	2,293,418	60,454,498.48	0.15%
159	000937	金牛能源	2,138,715	60,119,278.65	0.15%
160	600098	广州控股	4,471,598	60,008,845.16	0.15%
161	600308	华泰股份	2,084,994	59,860,177.74	0.15%
162	600022	济南钢铁	2,939,430	59,670,429.00	0.15%
163	600196	复星医药	4,031,825	59,509,737.00	0.15%
164	002142	宁波银行	2,712,101	59,476,374.93	0.15%
165	600895	张江高科	3,299,839	58,968,122.93	0.15%
166	000625	长安汽车	3,129,229	58,704,336.04	0.15%
167	000900	现代投资	1,733,659	58,701,693.74	0.15%
168	000680	山推股份	3,007,630	58,498,403.50	0.15%
169	601001	大同煤业	1,817,311	58,153,952.00	0.15%
170	000807	云铝股份	2,371,372	58,146,041.44	0.15%

171	000009	S 深宝安 A	3,643,617	57,933,510.30	0.15%
172	600183	生益科技	3,636,875	57,826,312.50	0.15%
173	600087	南京水运	2,428,801	57,756,887.78	0.15%
174	600096	云天化	1,164,372	57,322,033.56	0.15%
175	600879	火箭股份	2,054,790	56,794,395.60	0.14%
176	000778	新兴铸管	4,462,759	56,632,411.71	0.14%
177	000046	泛海建设	1,223,908	55,687,814.00	0.14%
178	600600	青岛啤酒	1,418,396	55,516,019.44	0.14%
179	600835	上海机电	1,824,381	54,494,260.47	0.14%
180	600663	陆家嘴	2,211,845	54,234,439.40	0.14%
181	600307	酒钢宏兴	1,897,037	53,648,206.36	0.14%
182	600282	南钢股份	2,540,705	52,694,221.70	0.13%
183	600117	西宁特钢	2,414,375	52,681,662.50	0.13%
184	600797	浙大网新	4,413,838	52,657,087.34	0.13%
185	600066	宇通客车	1,519,775	52,371,446.50	0.13%
186	600779	水井坊	1,856,577	52,336,905.63	0.13%
187	600741	巴士股份	5,329,486	51,696,014.20	0.13%
188	000012	南玻 A	2,408,367	51,298,217.10	0.13%
189	600761	安徽合力	1,356,562	50,857,509.38	0.13%
190	000717	韶钢松山	4,368,396	50,411,289.84	0.13%
191	600325	华发股份	1,372,500	50,109,975.00	0.13%
192	600812	华北制药	4,467,200	50,077,312.00	0.13%
193	000089	深圳机场	3,907,860	49,707,979.20	0.13%
194	600643	S 爱建	1,750,748	49,703,735.72	0.13%
195	600508	上海能源	1,569,427	48,887,651.05	0.12%
196	600153	建发股份	1,874,755	48,612,397.15	0.12%
197	600653	申华控股	7,900,568	48,430,481.84	0.12%
198	000822	山东海化	2,794,521	47,926,035.15	0.12%
199	600528	中铁二局	1,965,365	47,247,374.60	0.12%
200	600611	大众交通	2,199,780	47,009,298.60	0.12%
201	600780	通宝能源	3,791,256	46,784,099.04	0.12%
202	600266	北京城建	1,609,176	46,633,920.48	0.12%
203	000951	中国重汽	699,852	46,400,187.60	0.12%
204	600256	广汇股份	2,350,900	46,030,622.00	0.12%
205	000088	盐田港	2,703,558	45,906,414.84	0.12%
206	000538	云南白药	1,313,921	45,566,780.28	0.12%
207	600770	综艺股份	1,539,059	45,386,849.91	0.12%
208	600851	海欣股份	3,206,100	44,821,278.00	0.11%
209	600418	江淮汽车	4,897,415	44,321,605.75	0.11%
210	600595	中孚实业	1,419,866	44,200,428.58	0.11%
211	600111	包钢稀土	899,902	43,897,219.56	0.11%
212	600125	铁龙物流	3,277,092	43,060,988.88	0.11%
213	600718	东软股份	916,815	42,732,747.15	0.11%

214	600110	中科英华	2,476,029	42,637,219.38	0.11%
215	000061	农产品	1,473,265	42,547,893.20	0.11%
216	600161	天坛生物	883,597	42,147,576.90	0.11%
217	600158	中体产业	1,099,995	41,700,810.45	0.11%
218	000503	海虹控股	3,253,006	41,671,006.86	0.11%
219	600415	小商品城	474,961	41,126,872.99	0.10%
220	600085	同仁堂	1,178,186	41,118,691.40	0.10%
221	600747	大显股份	4,044,589	40,769,457.12	0.10%
222	600598	北大荒	2,661,700	40,564,308.00	0.10%
223	600220	江苏阳光	3,663,258	40,295,838.00	0.10%
224	600549	厦门钨业	1,423,986	40,113,685.62	0.10%
225	000021	长城开发	2,387,429	40,084,932.91	0.10%
226	000425	徐工科技	1,775,575	39,506,543.75	0.10%
227	600961	株冶集团	1,431,808	38,844,951.04	0.10%
228	600270	外运发展	1,966,276	38,794,625.48	0.10%
229	000559	万向钱潮	2,783,859	38,639,962.92	0.10%
230	600628	新世界	2,309,631	38,178,200.43	0.10%
231	600616	第一食品	1,389,171	37,938,260.01	0.10%
232	000927	一汽夏利	2,598,010	37,671,145.00	0.10%
233	600006	东风汽车	4,343,000	37,653,810.00	0.10%
234	601601	中国太保	760,104	37,587,142.80	0.10%
235	600021	上海电力	3,872,113	37,404,611.58	0.10%
236	000682	东方电子	5,310,230	37,384,019.20	0.10%
237	600236	桂冠电力	3,098,222	37,023,752.90	0.09%
238	000581	威孚高科	1,964,670	36,758,975.70	0.09%
239	600132	重庆啤酒	1,212,646	36,718,920.88	0.09%
240	000636	风华高科	2,914,064	36,629,784.48	0.09%
241	600350	山东高速	3,652,293	36,486,407.07	0.09%
242	000917	电广传媒	1,470,845	36,476,956.00	0.09%
243	000410	沈阳机床	1,776,757	36,299,145.51	0.09%
244	000541	佛山照明	1,558,048	35,881,845.44	0.09%
245	000767	漳泽电力	2,874,526	35,471,650.84	0.09%
246	000962	东方铝业	1,166,142	35,404,071.12	0.09%
247	600380	健康元	1,324,344	35,307,011.04	0.09%
248	002128	露天煤业	709,917	35,147,990.67	0.09%
249	600837	海通证券	634,852	34,866,071.84	0.09%
250	000036	华联控股	4,270,994	34,680,471.28	0.09%
251	600809	山西汾酒	940,101	34,595,716.80	0.09%
252	000876	新希望	1,711,676	34,199,286.48	0.09%
253	600820	隧道股份	2,246,397	34,077,842.49	0.09%
254	002122	天马股份	221,422	33,188,943.58	0.08%
255	000912	泸天化	1,587,970	31,997,595.50	0.08%
256	600020	中原高速	4,001,531	31,852,186.76	0.08%

257	600118	XR 中国卫	802,527	30,857,163.15	0.08%
258	600208	新湖中宝	1,914,896	30,580,889.12	0.08%
259	600033	福建高速	3,213,027	30,523,756.50	0.08%
260	000718	苏宁环球	1,059,841	30,205,468.50	0.08%
261	600170	上海建工	1,952,538	30,127,661.34	0.08%
262	600102	莱钢股份	1,502,076	29,831,229.36	0.08%
263	600849	上海医药	2,162,931	29,805,189.18	0.08%
264	600535	天士力	1,324,697	29,156,580.97	0.07%
265	600639	浦东金桥	1,296,293	29,140,666.64	0.07%
266	000828	东莞控股	2,257,383	29,075,093.04	0.07%
267	000969	安泰科技	1,506,677	27,858,457.73	0.07%
268	601003	柳钢股份	1,545,721	27,776,606.37	0.07%
269	000400	许继电气	1,469,629	27,775,988.10	0.07%
270	600190	锦州港	3,305,435	27,468,164.85	0.07%
271	600978	宜华木业	1,454,325	27,297,680.25	0.07%
272	600787	中储股份	2,000,437	26,685,829.58	0.07%
273	600662	强生控股	2,378,135	26,159,485.00	0.07%
274	600863	内蒙华电	3,226,672	26,103,776.48	0.07%
275	000543	皖能电力	1,678,559	25,933,736.55	0.07%
276	600316	洪都航空	670,401	25,602,614.19	0.07%
277	600754	锦江股份	1,214,062	24,609,036.74	0.06%
278	000572	海马股份	1,333,806	23,808,437.10	0.06%
279	000550	江铃汽车	1,127,480	23,598,156.40	0.06%
280	600874	创业环保	2,360,991	23,350,200.99	0.06%
281	600012	皖通高速	2,531,140	23,337,110.80	0.06%
282	000786	北新建材	1,873,492	23,156,361.12	0.06%
283	600088	中视传媒	642,632	22,999,799.28	0.06%
284	600007	中国国贸	1,093,690	22,978,426.90	0.06%
285	000059	辽通化工	1,800,264	22,593,313.20	0.06%
286	000970	中科三环	1,653,411	22,469,855.49	0.06%
287	600597	光明乳业	1,696,855	21,787,618.20	0.06%
288	600017	日照港	1,367,945	21,736,646.05	0.06%
289	600035	楚天高速	2,528,838	21,393,969.48	0.05%
290	600151	航天机电	1,625,550	20,351,886.00	0.05%
291	600377	宁沪高速	1,899,891	19,986,853.32	0.05%
292	600109	成都建投	299,893	19,891,902.69	0.05%
293	000708	大冶特钢	1,219,922	19,689,541.08	0.05%
294	600548	深高速	1,499,801	18,822,502.55	0.05%
295	600501	航天晨光	1,068,176	18,693,080.00	0.05%
296	601005	重庆钢铁	1,946,150	16,950,966.50	0.04%
297	000029	深深房 A	1,936,311	15,451,761.78	0.04%
298	601918	国投新集	938,632	14,943,021.44	0.04%
299	600361	华联综超	417,196	13,575,557.84	0.03%

300	000068	S 三 星	1,267,959	13,059,977.70	0.03%
301	000761	本钢板材	872,856	12,830,983.20	0.03%
302	601002	晋亿实业	1,202,713	12,375,916.77	0.03%
303	002110	三钢闽光	580,589	10,520,272.68	0.03%
304	002194	武汉凡谷	57,001	2,958,921.91	0.01%
305	002183	怡 亚 通	20,376	1,588,309.20	0.00%
306	002186	全 聚 德	18,259	1,077,828.77	0.00%
307	002182	云海金属	32,956	920,461.08	0.00%
308	002187	广百股份	19,759	849,439.41	0.00%
309	002200	绿 大 地	16,647	827,355.90	0.00%
310	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.00%
311	002177	御银股份	10,305	700,740.00	0.00%
312	002193	山东如意	24,544	591,510.40	0.00%
313	002189	利达光电	33,210	488,187.00	0.00%
314	002201	九鼎新材	14,176	451,789.12	0.00%
315	002190	成飞集成	20,598	435,853.68	0.00%
316	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.00%
317	002181	粤 传 媒	12,422	331,418.96	0.00%
318	002196	方正电机	12,380	301,824.40	0.00%
319	002195	海隆软件	8,796	289,036.56	0.00%
320	002178	延华智能	10,994	255,060.80	0.00%
321	002199	东晶电子	9,645	245,947.50	0.00%
322	002188	新 嘉 联	11,180	239,922.80	0.00%
合计				36,964,474,405.58	93.96%

注：上表序号 304-322 股票为本基金认购的新股。根据 2007 年 12 月 10 日中证指数有限公司发布的《关于调整沪深 300 和中证 100 等指数样本股的公告》，2008 年 1 月第一个交易日调整沪深 300 指数样本股，其中赛格三星、东方钽业、华联综超为剔除的样本股，但这 3 只股票在 2007 年 12 月 28 日（最后 1 个交易日）停牌。

7.4 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% 的所有股票明细

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	600030	中信证券	2,237,932,807.96	399.38%
2	600028	中国石化	1,958,318,675.42	349.48%
3	600036	招商银行	1,882,128,111.82	335.88%
4	600016	民生银行	1,822,779,850.21	325.29%
5	600000	浦发银行	1,749,443,910.74	312.20%
6	000002	万 科 A	1,607,237,578.07	286.82%
7	600019	宝钢股份	995,923,037.50	177.73%
8	600900	长江电力	957,723,963.46	170.91%
9	601318	中国平安	817,180,121.21	145.83%

10	601398	工商银行	765,942,196.83	136.69%
11	600050	中国联通	722,696,971.90	128.97%
12	600519	贵州茅台	652,155,242.62	116.38%
13	601006	大秦铁路	626,012,398.87	111.72%
14	601600	中国铝业	613,343,277.10	109.46%
15	601857	中国石油	589,260,900.46	105.16%
16	000001	深发展 A	578,612,815.56	103.26%
17	600018	上港集团	552,826,145.86	98.66%
18	601088	中国神华	546,918,052.01	97.60%
19	002024	苏宁电器	537,175,540.65	95.86%
20	600011	华能国际	501,097,558.96	89.42%
21	000069	华侨城 A	481,414,324.02	85.91%
22	000858	五粮液	468,018,854.48	83.52%
23	601166	兴业银行	463,990,012.26	82.80%
24	601628	中国人寿	459,606,652.79	82.02%
25	000898	鞍钢股份	459,343,379.46	81.97%
26	600009	上海机场	448,351,183.75	80.01%
27	600005	武钢股份	445,588,023.63	79.52%
28	600104	上海汽车	442,796,545.97	79.02%
29	600739	辽宁成大	398,963,335.64	71.20%
30	600048	保利地产	386,302,689.07	68.94%
31	600320	振华港机	363,415,728.01	64.85%
32	000623	吉林敖东	358,421,779.91	63.96%
33	600015	华夏银行	357,025,789.48	63.71%
34	600177	雅戈尔	338,965,849.76	60.49%
35	601919	中国远洋	328,924,634.63	58.70%
36	000063	中兴通讯	326,334,477.00	58.24%
37	600309	烟台万华	312,465,078.82	55.76%
38	600150	中国船舶	300,453,968.65	53.62%
39	600795	国电电力	287,091,522.91	51.23%
40	600881	亚泰集团	286,648,359.06	51.15%
41	000527	美的电器	282,093,727.68	50.34%
42	000039	中集集团	281,508,072.95	50.24%
43	600383	金地集团	272,447,142.36	48.62%
44	600010	包钢股份	258,179,712.93	46.07%
45	000402	金融街	254,680,384.91	45.45%
46	600583	海油工程	247,073,592.13	44.09%
47	000825	太钢不锈	242,691,605.62	43.31%
48	000568	泸州老窖	242,258,895.31	43.23%
49	600642	申能股份	242,025,464.55	43.19%
50	601991	大唐发电	229,443,775.50	40.95%
51	601111	中国国航	228,577,713.85	40.79%

52	000562	宏源证券	223,809,446.88	39.94%
53	600031	三一重工	220,920,377.24	39.42%
54	000983	西山煤电	212,392,072.71	37.90%
55	600717	天津港	211,195,850.95	37.69%
56	000024	招商地产	210,328,425.90	37.53%
57	601328	交通银行	208,019,198.03	37.12%
58	000651	格力电器	207,500,554.88	37.03%
59	000792	盐湖钾肥	197,896,670.30	35.32%
60	000060	中金岭南	195,607,161.99	34.91%
61	600037	歌华有线	190,750,437.63	34.04%
62	600585	海螺水泥	187,670,439.44	33.49%
63	000709	唐钢股份	183,470,467.28	32.74%
64	000652	泰达股份	183,174,749.84	32.69%
65	600029	南方航空	180,481,246.46	32.21%
66	000878	云南铜业	180,178,054.65	32.15%
67	600655	豫园商城	179,478,818.28	32.03%
68	000157	中联重科	176,199,350.82	31.44%
69	600675	中华企业	172,760,340.33	30.83%
70	600631	百联股份	163,950,642.98	29.26%
71	000751	锌业股份	160,849,600.52	28.70%
72	600331	宏达股份	158,918,757.90	28.36%
73	600001	邯郸钢铁	158,462,341.19	28.28%
74	600026	中海发展	157,657,729.99	28.14%
75	600690	青岛海尔	154,630,789.23	27.59%
76	600497	驰宏锌锗	154,435,182.56	27.56%
77	601333	广深铁路	154,341,934.08	27.54%
78	600660	福耀玻璃	152,036,341.05	27.13%
79	600649	原水股份	151,443,070.93	27.03%
80	600694	大商股份	150,190,551.02	26.80%
81	600887	伊利股份	149,932,294.06	26.76%
82	600100	同方股份	148,648,803.00	26.53%
83	000027	深圳能源	147,341,940.22	26.29%
84	000839	中信国安	147,270,071.26	26.28%
85	600811	东方集团	145,319,313.64	25.93%
86	601998	中信银行	143,491,735.00	25.61%
87	600688	S 上石化	137,493,700.45	24.54%
88	000630	铜陵有色	137,478,801.35	24.53%
89	600601	方正科技	137,388,991.24	24.52%
90	601588	北辰实业	135,650,838.31	24.21%
91	600832	东方明珠	133,142,540.17	23.76%
92	600839	四川长虹	132,474,446.50	23.64%
93	000758	中色股份	131,344,276.97	23.44%

94	000933	神火股份	129,285,507.49	23.07%
95	600489	中金黄金	127,768,610.04	22.80%
96	000629	攀钢钢钒	126,407,117.60	22.56%
97	000800	一汽轿车	125,197,717.63	22.34%
98	600008	首创股份	124,773,088.12	22.27%
99	000793	华闻传媒	124,557,950.07	22.23%
100	601872	招商轮船	124,530,324.88	22.22%
101	600068	葛洲坝	124,198,510.82	22.16%
102	601169	北京银行	121,061,191.82	21.60%
103	600635	大众公用	120,357,942.65	21.48%
104	000960	锡业股份	120,205,441.59	21.45%
105	600895	张江高科	117,635,240.47	20.99%
106	000423	东阿阿胶	117,124,587.53	20.90%
107	600808	马钢股份	116,679,928.16	20.82%
108	600269	赣粤高速	114,479,147.31	20.43%
109	600098	广州控股	114,148,257.33	20.37%
110	600879	火箭股份	111,690,779.63	19.93%
111	000897	津滨发展	107,373,554.01	19.16%
112	000778	新兴铸管	106,158,672.60	18.94%
113	600362	江西铜业	105,639,569.25	18.85%
114	600786	东方锅炉	105,426,584.73	18.81%
115	600428	中远航运	104,848,122.38	18.71%
116	601699	潞安环能	103,209,673.11	18.42%
117	600188	兖州煤业	102,463,036.41	18.29%
118	600685	广船国际	102,371,058.42	18.27%
119	600219	南山铝业	101,285,338.01	18.08%
120	600835	上海机电	100,798,448.03	17.99%
121	601001	大同煤业	99,702,350.89	17.79%
122	600308	华泰股份	99,512,320.44	17.76%
123	600741	巴士股份	99,447,564.21	17.75%
124	601168	西部矿业	98,324,987.33	17.55%
125	600348	国阳新能	96,800,648.97	17.27%
126	601666	平煤天安	96,316,177.37	17.19%
127	600210	紫江企业	96,192,043.94	17.17%
128	000031	中粮地产	96,121,426.90	17.15%
129	600058	五矿发展	95,255,600.43	17.00%
130	000680	山推股份	94,708,433.00	16.90%
131	600748	上实发展	94,257,214.76	16.82%
132	600550	天威保变	93,618,916.04	16.71%
133	600350	山东高速	93,310,899.65	16.65%
134	601808	中海油服	92,189,885.77	16.45%
135	600089	特变电工	91,515,731.18	16.33%

136	000829	天音控股	91,260,992.43	16.29%
137	600123	兰花科创	90,803,764.26	16.20%
138	000422	湖北宜化	90,478,733.03	16.15%
139	600500	中化国际	90,384,843.35	16.13%
140	000401	冀东水泥	90,283,747.64	16.11%
141	600569	安阳钢铁	90,119,189.27	16.08%
142	600022	济南钢铁	89,963,948.21	16.05%
143	000932	华菱管线	89,339,653.56	15.94%
144	600472	包头铝业	88,715,284.01	15.83%
145	000807	云铝股份	87,594,840.97	15.63%
146	600196	复星医药	86,529,518.55	15.44%
147	600143	金发科技	85,280,670.49	15.22%
148	600456	宝钛股份	85,029,919.24	15.17%
149	600875	东方电气	83,989,857.81	14.99%
150	000338	潍柴动力	83,969,605.32	14.98%
151	000895	双汇发展	83,842,708.75	14.96%
152	600221	海南航空	83,714,142.64	14.94%
153	600027	华电国际	82,588,329.48	14.74%
154	600266	北京城建	82,286,696.92	14.68%
155	600868	梅雁水电	82,019,961.45	14.64%
156	000717	韶钢松山	79,983,959.24	14.27%
157	600663	陆家嘴	79,253,684.69	14.14%
158	600271	航天信息	79,077,064.52	14.11%
159	000539	粤电力 A	78,853,678.64	14.07%
160	000009	S 深宝安 A	78,655,470.14	14.04%
161	000768	西飞国际	78,614,596.55	14.03%
162	600547	山东黄金	78,562,919.79	14.02%
163	600108	亚盛集团	78,514,855.41	14.01%
164	600997	开滦股份	77,663,259.49	13.86%
165	000612	焦作万方	76,343,109.22	13.62%
166	600004	白云机场	76,012,196.14	13.56%
167	600153	建发股份	74,770,799.95	13.34%
168	000937	金牛能源	74,327,989.62	13.26%
169	600859	王府井	74,021,228.71	13.21%
170	000046	泛海建设	73,662,128.46	13.15%
171	600886	国投电力	73,289,257.91	13.08%
172	601009	南京银行	72,308,519.81	12.90%
173	600282	南钢股份	71,626,239.26	12.78%
174	600183	生益科技	70,401,167.70	12.56%
175	000959	首钢股份	70,400,192.11	12.56%
176	000488	晨鸣纸业	69,638,690.35	12.43%
177	000625	长安汽车	68,586,310.73	12.24%

178	600653	申华控股	67,623,675.22	12.07%
179	000636	风华高科	66,159,045.87	11.81%
180	600591	上海航空	65,946,833.34	11.77%
181	600110	中科英华	65,597,718.88	11.71%
182	000541	佛山照明	64,865,265.93	11.58%
183	000538	云南白药	64,611,229.07	11.53%
184	000088	盐田港	64,575,260.25	11.52%
185	000729	燕京啤酒	64,105,802.26	11.44%
186	000503	海虹控股	63,473,063.21	11.33%
187	600115	东方航空	62,492,630.15	11.15%
188	000089	深圳机场	62,316,908.85	11.12%
189	002008	大族激光	62,171,249.05	11.09%
190	600062	双鹤药业	61,775,556.75	11.02%
191	600508	上海能源	61,647,939.61	11.00%
192	600596	新安股份	61,101,596.46	10.90%
193	000528	柳工	60,965,838.35	10.88%
194	600638	新黄浦	60,332,555.07	10.77%
195	600415	小商品城	60,202,578.23	10.74%
196	600797	浙大网新	59,944,630.00	10.70%
197	600761	安徽合力	59,854,708.24	10.68%
198	000012	南玻A	59,249,331.47	10.57%
199	600132	重庆啤酒	58,977,963.10	10.53%
200	600418	江淮汽车	58,612,703.83	10.46%
201	600628	新世界	55,529,326.91	9.91%
202	600528	中铁二局	55,466,325.55	9.90%
203	600588	用友软件	55,388,541.46	9.88%
204	600361	华联综超	55,224,352.54	9.86%
205	000021	长城开发	55,139,080.90	9.84%
206	600085	同仁堂	55,111,119.66	9.83%
207	000100	*ST TCL	55,063,035.88	9.83%
208	600357	承德钒钛	54,845,190.17	9.79%
209	002142	宁波银行	54,501,800.52	9.73%
210	600125	铁龙物流	54,040,777.76	9.64%
211	000410	沈阳机床	53,341,240.33	9.52%
212	600432	吉恩镍业	52,322,068.29	9.34%
213	600718	东软股份	52,220,061.69	9.32%
214	600549	厦门钨业	51,787,433.40	9.24%
215	600299	星新材料	51,595,600.33	9.21%
216	600066	宇通客车	51,022,047.90	9.11%
217	600236	桂冠电力	50,941,985.30	9.09%
218	000036	华联控股	50,935,802.28	9.09%
219	601939	建设银行	50,895,350.40	9.08%

220	600809	山西汾酒	50,792,441.83	9.06%
221	600616	第一食品	50,581,490.13	9.03%
222	600021	上海电力	50,187,378.36	8.96%
223	000690	宝新能源	49,889,841.13	8.90%
224	600220	江苏阳光	49,251,157.94	8.79%
225	600087	南京水运	49,237,688.41	8.79%
226	600600	青岛啤酒	49,236,500.75	8.79%
227	600643	S 爱建	49,219,174.27	8.78%
228	000930	丰原生化	49,078,093.40	8.76%
229	600851	海欣股份	48,450,290.31	8.65%
230	000900	现代投资	47,954,608.76	8.56%
231	000822	山东海化	47,545,979.39	8.48%
232	600006	东风汽车	47,489,371.57	8.47%
233	600611	大众交通	46,913,239.07	8.37%
234	600325	华发股份	46,795,991.00	8.35%
235	600779	水井坊	46,630,227.53	8.32%
236	000581	威孚高科	44,964,878.70	8.02%
237	000767	漳泽电力	44,565,943.07	7.95%
238	600161	天坛生物	44,072,078.95	7.86%
239	600961	株冶集团	44,041,903.30	7.86%
240	600780	通宝能源	43,986,668.27	7.85%
241	600096	云天化	43,935,298.46	7.84%
242	600270	外运发展	43,664,836.12	7.79%
243	000927	一汽夏利	43,364,013.29	7.74%
244	600111	包钢稀土	43,004,365.58	7.67%
245	000682	东方电子	42,794,652.73	7.64%
246	600595	中孚实业	42,601,651.98	7.60%
247	000951	中国重汽	42,416,427.38	7.57%
248	000559	万向钱潮	42,405,569.98	7.57%
249	600208	新潮中宝	42,000,856.28	7.50%
250	600820	隧道股份	41,428,635.11	7.39%
251	600256	广汇股份	41,111,567.37	7.34%
252	000425	徐工科技	41,047,434.95	7.33%
253	600849	上海医药	40,348,582.08	7.20%
254	600837	海通证券	40,306,706.67	7.19%
255	600020	中原高速	40,249,910.80	7.18%
256	600812	华北制药	40,003,912.06	7.14%
257	600158	中体产业	39,406,610.45	7.03%
258	600787	中储股份	39,055,179.99	6.97%
259	000061	农产品	38,853,027.37	6.93%
260	000876	新希望	38,654,824.29	6.90%
261	600598	北大荒	38,423,047.13	6.86%

262	600060	海信电器	38,123,810.34	6.80%
263	600312	平高电气	37,310,334.12	6.66%
264	600747	大显股份	37,202,803.66	6.64%
265	000917	电广传媒	37,054,452.61	6.61%
266	600033	福建高速	36,823,561.62	6.57%
267	600535	天士力	36,653,761.39	6.54%
268	000912	泸天化	35,924,035.52	6.41%
269	600662	强生控股	35,917,448.38	6.41%
270	600380	健康元	35,332,521.40	6.31%
271	600102	莱钢股份	35,225,038.98	6.29%
272	600017	日照港	34,314,364.01	6.12%
273	002128	露天煤业	34,244,741.73	6.11%
274	600770	综艺股份	33,881,629.37	6.05%
275	600170	上海建工	33,781,821.42	6.03%
276	600307	酒钢宏兴	33,494,643.13	5.98%
277	600639	浦东金桥	33,246,238.35	5.93%
278	002122	天马股份	33,201,494.99	5.93%
279	000969	安泰科技	33,194,166.66	5.92%
280	600012	皖通高速	32,976,897.82	5.88%
281	600118	XR 中国卫	32,884,173.25	5.87%
282	600874	创业环保	32,729,895.41	5.84%
283	000970	中科三环	32,687,538.68	5.83%
284	000828	东莞控股	32,639,685.57	5.82%
285	600190	锦州港	32,134,484.83	5.73%
286	600377	宁沪高速	32,040,052.33	5.72%
287	600117	西宁特钢	31,913,804.81	5.70%
288	600316	洪都航空	31,816,150.63	5.68%
289	600151	航天机电	31,475,402.87	5.62%
290	600754	锦江股份	31,373,962.23	5.60%
291	600863	内蒙华电	31,161,717.48	5.56%
292	600548	深高速	29,768,875.06	5.31%
293	600007	中国国贸	28,727,023.01	5.13%
294	600501	航天晨光	28,569,145.02	5.10%
295	600198	*ST 大唐	28,442,093.04	5.08%
296	600978	宜华木业	28,279,145.08	5.05%
297	000400	许继电气	28,211,437.79	5.03%
298	000869	张裕 A	28,208,101.66	5.03%
299	600597	光明乳业	27,665,822.60	4.94%
300	000718	苏宁环球	27,280,290.13	4.87%
301	000550	江铃汽车	26,882,579.17	4.80%
302	002069	獐子岛	26,836,939.29	4.79%
303	000786	北新建材	26,634,041.11	4.75%

304	600521	华海药业	26,524,918.22	4.73%
305	002078	太阳纸业	25,917,871.42	4.63%
306	600035	楚天高速	25,803,172.47	4.60%
307	601003	柳钢股份	25,699,406.78	4.59%
308	000059	辽通化工	25,346,300.19	4.52%
309	600171	上海贝岭	24,996,780.40	4.46%
310	000543	皖能电力	24,248,573.57	4.33%
311	000066	长城电脑	24,214,680.40	4.32%
312	600088	中视传媒	24,212,082.83	4.32%
313	600200	江苏吴中	24,165,460.56	4.31%
314	000708	大冶特钢	23,856,569.16	4.26%
315	000962	东方钨业	23,737,432.01	4.24%
316	000617	石油济柴	23,663,297.02	4.22%
317	002097	山河智能	23,174,439.54	4.14%
318	600410	华胜天成	23,032,877.96	4.11%
319	601601	中国太保	22,803,120.00	4.07%
320	000572	海马股份	22,334,301.23	3.99%
321	000029	深深房 A	21,953,602.14	3.92%
322	600460	士兰微	21,764,667.63	3.88%
323	000997	新大陆	21,251,671.39	3.79%
324	600160	巨化股份	21,217,142.72	3.79%
325	600078	澄星股份	20,967,243.02	3.74%
326	600970	中材国际	20,083,822.43	3.58%
327	600498	烽火通信	19,773,480.45	3.53%
328	000761	本钢板材	19,431,589.45	3.47%
329	600109	成都建投	19,416,709.01	3.47%
330	002025	航天电器	18,000,153.85	3.21%
331	002106	莱宝高科	16,823,001.98	3.00%
332	000875	吉电股份	16,788,137.11	3.00%
333	601005	重庆钢铁	16,339,790.73	2.92%
334	601002	晋亿实业	16,228,422.89	2.90%
335	000520	长航凤凰	15,952,068.05	2.85%
336	000601	韶能股份	15,910,888.83	2.84%
337	600884	杉杉股份	15,879,041.13	2.83%
338	002051	中工国际	15,020,299.66	2.68%
339	000068	S 三星	14,306,392.92	2.55%
340	000022	深赤湾 A	14,300,419.16	2.55%
341	000725	*ST 东方 A	12,871,427.09	2.30%
342	000698	沈阳化工	12,158,779.97	2.17%
343	600602	广电电子	12,116,144.00	2.16%
344	600637	广电信息	12,098,429.70	2.16%
345	002110	三钢闽光	11,420,254.30	2.04%

(2) 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 的所有股票明细

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	1,128,037,848.74	201.31%
2	600030	中信证券	993,024,558.73	177.21%
3	000002	万科A	953,283,972.83	170.12%
4	600000	浦发银行	809,114,129.04	144.39%
5	600016	民生银行	718,098,906.61	128.15%
6	000858	五粮液	630,692,907.13	112.55%
7	600019	宝钢股份	473,002,556.83	84.41%
8	601318	中国平安	467,517,730.45	83.43%
9	600900	长江电力	448,028,273.84	79.95%
10	000623	吉林敖东	403,103,112.71	71.94%
11	000069	华侨城A	363,600,274.39	64.89%
12	600028	中国石化	360,598,229.67	64.35%
13	000001	深发展A	358,998,253.42	64.07%
14	600050	中国联通	351,572,111.02	62.74%
15	600519	贵州茅台	350,272,689.40	62.51%
16	601398	工商银行	345,875,764.73	61.72%
17	601600	中国铝业	326,315,625.31	58.23%
18	002024	苏宁电器	275,442,445.40	49.15%
19	000898	鞍钢股份	266,280,424.95	47.52%
20	600104	上海汽车	264,791,156.88	47.25%
21	601006	大秦铁路	263,441,432.67	47.01%
22	600009	上海机场	252,544,208.24	45.07%
23	600011	华能国际	252,022,210.12	44.98%
24	601628	中国人寿	250,199,887.53	44.65%
25	600005	武钢股份	244,214,679.58	43.58%
26	601166	兴业银行	238,465,774.46	42.56%
27	600739	辽宁成大	208,743,931.15	37.25%
28	600177	雅戈尔	196,853,074.18	35.13%
29	600320	振华港机	196,234,899.75	35.02%
30	600015	华夏银行	184,699,068.32	32.96%
31	000063	中兴通讯	177,862,900.64	31.74%
32	600048	保利地产	174,493,016.09	31.14%
33	600309	烟台万华	173,655,550.37	30.99%
34	000527	美的电器	167,009,934.87	29.80%
35	600881	亚泰集团	158,462,620.29	28.28%
36	000039	中集集团	152,834,531.87	27.27%
37	000402	金融街	151,316,784.54	27.00%
38	600010	包钢股份	147,364,956.13	26.30%
39	600795	国电电力	141,223,453.87	25.20%

40	000825	太钢不锈	139,031,515.50	24.81%
41	600583	海油工程	138,135,941.47	24.65%
42	600642	申能股份	134,824,824.08	24.06%
43	601111	中国国航	133,756,130.45	23.87%
44	000983	西山煤电	131,071,984.47	23.39%
45	600383	金地集团	126,738,571.88	22.62%
46	600031	三一重工	124,964,967.21	22.30%
47	000562	宏源证券	124,512,848.23	22.22%
48	000568	泸州老窖	123,381,676.54	22.02%
49	000651	格力电器	117,655,441.95	21.00%
50	600150	中国船舶	114,216,687.60	20.38%
51	000024	招商地产	110,174,113.31	19.66%
52	600717	天津港	109,660,138.10	19.57%
53	600585	海螺水泥	109,361,367.56	19.52%
54	000878	云南铜业	108,603,833.98	19.38%
55	000652	泰达股份	108,109,169.17	19.29%
56	000060	中金岭南	108,096,451.23	19.29%
57	000709	唐钢股份	107,767,520.10	19.23%
58	600037	歌华有线	106,948,174.26	19.09%
59	600029	南方航空	106,845,139.72	19.07%
60	600018	上港集团	106,651,438.89	19.03%
61	000792	盐湖钾肥	106,457,432.60	19.00%
62	600675	中华企业	103,101,266.12	18.40%
63	000157	中联重科	102,620,779.20	18.31%
64	600655	豫园商城	102,353,764.96	18.27%
65	600331	宏达股份	98,249,084.29	17.53%
66	600026	中海发展	93,775,448.06	16.73%
67	600660	福耀玻璃	87,795,067.92	15.67%
68	600497	驰宏锌锗	86,668,573.43	15.47%
69	600690	青岛海尔	86,355,642.06	15.41%
70	600631	百联股份	85,815,710.60	15.31%
71	000027	深圳能源	82,743,635.03	14.77%
72	600062	双鹤药业	80,755,111.09	14.41%
73	600688	S 上石化	79,577,126.08	14.20%
74	600100	同方股份	79,351,043.54	14.16%
75	600649	原水股份	78,717,604.78	14.05%
76	000751	锌业股份	78,698,174.25	14.04%
77	600694	大商股份	78,135,435.20	13.94%
78	600601	方正科技	77,662,981.22	13.86%
79	600839	四川长虹	77,389,042.13	13.81%
80	000933	神火股份	77,237,082.05	13.78%
81	600859	王府井	76,516,348.71	13.65%

82	000630	铜陵有色	75,946,273.86	13.55%
83	601939	建设银行	75,594,248.43	13.49%
84	000839	中信国安	73,601,180.53	13.13%
85	000758	中色股份	72,693,520.59	12.97%
86	002008	大族激光	72,523,879.89	12.94%
87	600489	中金黄金	71,400,939.32	12.74%
88	600068	葛洲坝	71,179,790.54	12.70%
89	000960	锡业股份	70,958,296.65	12.66%
90	600635	大众公用	70,943,080.53	12.66%
91	000800	一汽轿车	69,175,256.15	12.34%
92	600895	张江高科	68,397,360.30	12.21%
93	600350	山东高速	66,435,274.53	11.86%
94	600008	首创股份	65,538,638.31	11.70%
95	600098	广州控股	64,398,134.54	11.49%
96	600879	火箭股份	63,153,021.68	11.27%
97	601001	大同煤业	61,830,975.91	11.03%
98	600188	兖州煤业	61,418,287.98	10.96%
99	600299	星新材料	61,337,950.85	10.95%
100	600269	赣粤高速	61,025,568.93	10.89%
101	000100	*ST TCL	60,370,667.06	10.77%
102	600588	用友软件	60,327,813.20	10.77%
103	601991	大唐发电	59,368,489.54	10.59%
104	000690	宝新能源	59,065,273.43	10.54%
105	600348	国阳新能	58,627,878.35	10.46%
106	600741	巴士股份	57,996,123.68	10.35%
107	600786	东方锅炉	57,968,860.10	10.34%
108	600058	五矿发展	56,647,554.08	10.11%
109	000680	山推股份	56,216,713.85	10.03%
110	000778	新兴铸管	55,798,291.93	9.96%
111	600835	上海机电	55,414,496.34	9.89%
112	600748	上实发展	55,142,648.33	9.84%
113	600362	江西铜业	54,588,406.26	9.74%
114	600308	华泰股份	53,847,234.55	9.61%
115	600123	兰花科创	53,018,933.62	9.46%
116	000422	湖北宜化	52,850,834.45	9.43%
117	600210	紫江企业	52,117,751.21	9.30%
118	600808	马钢股份	51,399,856.95	9.17%
119	600428	中远航运	51,392,857.09	9.17%
120	000401	冀东水泥	50,989,552.97	9.10%
121	600001	邯郸钢铁	50,934,019.33	9.09%
122	600022	济南钢铁	50,447,793.24	9.00%
123	600196	复星医药	50,256,648.14	8.97%

124	600569	安阳钢铁	50,129,735.88	8.95%
125	600266	北京城建	50,092,776.31	8.94%
126	600685	广船国际	49,774,828.30	8.88%
127	000807	云铝股份	49,683,236.37	8.87%
128	600472	包头铝业	49,466,843.94	8.83%
129	600361	华联综超	49,218,638.54	8.78%
130	601328	交通银行	49,023,712.27	8.75%
131	000423	东阿阿胶	48,953,473.65	8.74%
132	600811	东方集团	48,941,294.56	8.73%
133	600997	开滦股份	47,358,582.00	8.45%
134	600547	山东黄金	46,697,461.53	8.33%
135	000009	S 深宝安 A	46,325,157.79	8.27%
136	000930	丰原生化	46,313,630.60	8.27%
137	600887	伊利股份	45,373,505.13	8.10%
138	600832	东方明珠	45,058,262.62	8.04%
139	000937	金牛能源	43,939,066.72	7.84%
140	000717	韶钢松山	43,352,607.49	7.74%
141	600875	东方电气	42,225,751.57	7.54%
142	600060	海信电器	42,135,919.92	7.52%
143	600282	南钢股份	41,767,456.15	7.45%
144	600312	平高电气	40,187,353.34	7.17%
145	000793	华闻传媒	38,812,950.36	6.93%
146	600110	中科英华	37,635,987.02	6.72%
147	000541	佛山照明	37,350,270.52	6.67%
148	600153	建发股份	37,145,237.66	6.63%
149	600591	上海航空	37,057,431.04	6.61%
150	000636	风华高科	36,358,365.49	6.49%
151	600508	上海能源	36,055,397.27	6.43%
152	000932	华菱管线	35,119,701.42	6.27%
153	600198	*ST 大唐	34,286,102.75	6.12%
154	601998	中信银行	33,720,967.62	6.02%
155	000869	张裕 A	31,364,750.26	5.60%
156	002078	太阳纸业	30,868,316.93	5.51%
157	600521	华海药业	30,541,300.02	5.45%
158	002097	山河智能	30,451,157.19	5.43%
159	002069	獐子岛	30,256,392.09	5.40%
160	600143	金发科技	29,653,710.95	5.29%
161	600004	白云机场	29,394,867.62	5.25%
162	600500	中化国际	29,324,596.57	5.23%
163	000031	中粮地产	28,660,594.43	5.11%
164	000997	新大陆	28,502,586.20	5.09%
165	600663	陆家嘴	27,530,102.88	4.91%

166	600498	烽火通信	27,462,497.65	4.90%
167	000066	长城电脑	27,241,252.82	4.86%
168	600868	梅雁水电	27,158,371.99	4.85%
169	000629	攀钢钢钒	26,890,712.57	4.80%
170	000539	粤电力 A	26,882,965.35	4.80%
171	600884	杉杉股份	26,881,515.26	4.80%
172	600160	巨化股份	26,603,460.82	4.75%
173	601333	广深铁路	26,490,559.27	4.73%
174	000617	石油济柴	26,446,456.07	4.72%
175	600078	澄星股份	26,361,758.19	4.70%
176	600970	中材国际	25,823,854.10	4.61%
177	600410	华胜天成	25,643,233.67	4.58%
178	600456	宝钛股份	25,466,013.12	4.54%
179	600171	上海贝岭	25,243,093.42	4.50%
180	000520	长航凤凰	24,579,697.32	4.39%
181	600200	江苏吴中	24,037,469.85	4.29%
182	600271	航天信息	23,950,794.02	4.27%
183	000625	长安汽车	23,763,907.41	4.24%
184	600108	亚盛集团	23,626,933.34	4.22%
185	600653	申华控股	23,497,242.04	4.19%
186	600183	生益科技	23,250,695.55	4.15%
187	600027	华电国际	23,249,723.09	4.15%
188	000768	西飞国际	22,996,462.15	4.10%
189	000088	盐田港	22,970,621.61	4.10%
190	000875	吉电股份	22,818,587.34	4.07%
191	000089	深圳机场	22,377,800.57	3.99%
192	000528	柳工	22,268,260.99	3.97%
193	000729	燕京啤酒	22,068,377.99	3.94%
194	600085	同仁堂	21,829,872.27	3.90%
195	600596	新安股份	21,625,123.59	3.86%
196	600017	日照港	21,560,255.44	3.85%
197	000488	晨鸣纸业	21,522,846.52	3.84%
198	000538	云南白药	21,387,656.25	3.82%
199	600460	士兰微	21,372,799.00	3.81%
200	600886	国投电力	21,136,374.07	3.77%
201	600628	新世界	20,724,164.45	3.70%
202	600219	南山铝业	20,530,045.18	3.66%
203	600418	江淮汽车	20,445,897.14	3.65%
204	600550	天威保变	20,284,822.36	3.62%
205	601666	平煤天安	20,282,184.19	3.62%
206	000503	海虹控股	20,256,245.36	3.61%
207	600600	青岛啤酒	19,843,978.27	3.54%

208	600066	宇通客车	19,508,772.64	3.48%
209	000897	津滨发展	19,041,845.59	3.40%
210	000022	深赤湾 A	18,526,301.79	3.31%
211	600357	承德钒钛	18,465,702.33	3.30%
212	600761	安徽合力	18,181,687.07	3.24%
213	000021	长城开发	18,065,499.68	3.22%
214	600718	东软股份	18,051,307.50	3.22%
215	000612	焦作万方	17,939,557.67	3.20%
216	000410	沈阳机床	17,807,277.66	3.18%
217	600125	铁龙物流	17,643,886.72	3.15%
218	600132	重庆啤酒	17,504,597.67	3.12%
219	600643	S 爱建	17,424,899.42	3.11%
220	600006	东风汽车	17,401,999.45	3.11%
221	000601	韶能股份	17,362,235.50	3.10%
222	000046	泛海建设	17,360,328.57	3.10%
223	600780	通宝能源	17,330,217.59	3.09%
224	600779	水井坊	17,319,741.37	3.09%
225	600415	小商品城	17,043,097.75	3.04%
226	600797	浙大网新	16,991,209.18	3.03%
227	600221	海南航空	16,941,354.41	3.02%
228	002106	莱宝高科	16,846,106.60	3.01%
229	600549	厦门钨业	16,808,586.50	3.00%
230	600809	山西汾酒	16,752,651.53	2.99%
231	000581	威孚高科	16,715,915.46	2.98%
232	601699	潞安环能	16,523,598.47	2.95%
233	600220	江苏阳光	16,510,317.19	2.95%
234	601872	招商轮船	16,493,377.12	2.94%
235	000036	华联控股	16,404,009.25	2.93%
236	000698	沈阳化工	16,384,260.84	2.92%
237	600851	海欣股份	16,339,969.73	2.92%
238	002051	中工国际	16,266,557.46	2.90%
239	600432	吉恩镍业	16,171,660.03	2.89%
240	600021	上海电力	16,165,254.76	2.88%
241	000822	山东海化	16,142,875.95	2.88%
242	600096	云天化	16,100,232.95	2.87%
243	600161	天坛生物	16,016,141.54	2.86%
244	601588	北辰实业	15,972,759.23	2.85%
245	000767	漳泽电力	15,940,237.75	2.84%
246	600270	外运发展	15,572,246.17	2.78%
247	600087	南京水运	15,286,756.23	2.73%
248	000900	现代投资	15,277,633.77	2.73%
249	600616	第一食品	15,176,047.17	2.71%

250	600787	中储股份	15,099,175.60	2.69%
251	600267	海正药业	15,026,606.35	2.68%
252	600820	隧道股份	14,925,730.85	2.66%
253	000012	南玻A	14,745,960.49	2.63%
254	600849	上海医药	14,659,181.43	2.62%
255	600812	华北制药	14,611,131.84	2.61%
256	002025	航天电器	14,600,126.80	2.61%
257	000425	徐工科技	14,536,456.98	2.59%
258	600236	桂冠电力	14,526,889.69	2.59%
259	600637	广电信息	14,445,619.04	2.58%
260	000927	一汽夏利	14,401,435.69	2.57%
261	600598	北大荒	14,346,001.04	2.56%
262	600020	中原高速	14,293,827.14	2.55%
263	600121	郑州煤电	14,020,525.62	2.50%
264	600307	酒钢宏兴	14,006,539.29	2.50%
265	600256	广汇股份	13,973,739.61	2.49%
266	000917	电广传媒	13,717,439.82	2.45%
267	600747	大显股份	13,499,796.15	2.41%
268	000725	*ST 东方 A	13,456,327.37	2.40%
269	000559	万向钱潮	13,407,139.77	2.39%
270	600602	广电电子	13,223,159.61	2.36%
271	600662	强生控股	13,147,974.48	2.35%
272	600639	浦东金桥	12,969,744.07	2.31%
273	600117	西宁特钢	12,888,481.36	2.30%
274	600102	莱钢股份	12,885,568.72	2.30%
275	600770	综艺股份	12,867,012.57	2.30%
276	000912	泸天化	12,860,096.41	2.29%
277	600548	深高速	12,763,881.75	2.28%
278	000829	天音控股	12,685,888.35	2.26%
279	600033	福建高速	12,658,624.16	2.26%
280	600170	上海建工	12,358,930.24	2.21%
281	000959	首钢股份	12,246,186.09	2.19%
282	600535	天士力	12,228,152.61	2.18%
283	000099	中信海直	12,224,081.69	2.18%
284	600377	宁沪高速	11,853,914.57	2.12%
285	600874	创业环保	11,594,812.53	2.07%
286	600012	皖通高速	11,368,489.18	2.03%
287	600837	海通证券	11,219,915.20	2.00%

(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)
52,844,577,356.05	25,255,388,245.59

7.5 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		
金融债	9,747,000.00	0.03%
央行票据	913,281,000.00	2.32%
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
其他		
合计	923,028,000.00	2.35%

7.6 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	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	0701004	07 央行票据 04	194,560,000.00	0.49%
2	0701018	07 央行票据 18	194,300,000.00	0.49%
3	0701028	07 央行票据 28	194,000,000.00	0.49%
4	0701015	07 央行票据 15	145,815,000.00	0.37%
5	0701009	07 央行票据 09	97,270,000.00	0.25%

7.7 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证明细

序号	权证代码	权证名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	280,851,083.18	0.71%

7.8 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**7.9 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) 其他资产构成

序号	项目	期末余额(元)
1	交易保证金	18,886,086.27
2	应收证券清算款	183,031,142.77
3	应收利息	22,551,795.29
4	应收申购款	102,516,845.40
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
	合计	326,985,869.73

(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	030002	五粮 YGC1	5,899,861	257,812,091.57	主动投资
2	031001	侨城 HQC1	3,576,946	211,362,348.53	主动投资
3	031003	深发 SFC1	588,794	0	被动持有
4	031004	深发 SFC2	294,397	0	被动持有
5	580989	南航 JTP1	6,369,012	0	被动持有

§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)	1,419,940
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	20,885.35

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	29,655,949,371.86	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	3,154,969,656.56	10.64%
个人投资者持有的基金份额	26,500,979,715.30	89.36%

8.3 报告期末本基金场内前十名持有人明细

序号	持有人名称	持有份额(份)	占总份额的比例
1	太平人寿保险有限公司	76,443,550	0.26%
2	英大国际信托有限责任公司—招商银行添富增利理财计划信托	66,298,649	0.22%
3	中信信托有限责任公司—基金 5 号	54,869,927	0.19%
4	美国友邦保险有限公司北京分公司—投连一个险投连	51,010,945	0.17%
5	中信信托有限责任公司—双盈 6 号	41,521,100	0.14%
6	美国友邦保险有限公司广州分公司—投连一个险投连	39,130,897	0.13%
7	美国友邦保险有限公司深圳分公司—投连一个险投连	32,472,619	0.11%
8	青岛国信资产管理有限公司	32,089,500	0.11%
9	美国友邦保险有限公司上海分公司—投连一个险投连	28,912,062	0.10%
10	信诚人寿保险有限公司	27,782,074	0.09%

8.4 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	占总份额的比例
----	--------	---------

	总量(份)	
本基金管理人持有本基金的所有从业人员	949,267.46	0.0032%

§9 开放式基金份额变动情况

项 目	基金份额总额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	867,126,900.07
报告期期初基金份额总额	323,536,756.55
报告期期间总申购份额	48,222,050,874.10
报告期期间总赎回份额	18,889,638,258.79
报告期期末基金份额总额	29,655,949,371.86

§10 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、基金托管人的托管部门重大人事变动情况

1. 基金管理人: 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) 2007年7月21日, 本基金管理人发布了《关于变更丰和价值证券投资基金基金经理的公告》, 聘请王鹏任本基金基金经理, 赵军不再担任本基金基金经理。

2. 基金托管人的托管部门重大人事变动情况

报告期内, 本基金托管人的托管部门原总经理秦立儒先生已于2007年11月27日调任其他岗位, 即日起由董杰先生担任托管部门负责人。

(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

报告期内本基金实施了三次基金收益分配, 合计每10份基金份额派发现金红利16.18元。

(六) 报告期内, 本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费150,000.00元, 该审计机构连续3个年度为本基金提供审计服务。

(七) 基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

(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、债券回购及权证情况

(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
平安证券有限责任公司	1	1,951,893,968.11	2.52%	1,600,547.91	2.55%
中国银河证券股份有限公司	1	11,092,326,166.87	14.33%	8,679,812.07	13.85%
中信证券股份有限公司	1	27,706,542,124.28	35.81%	22,719,274.33	36.26%
中银国际证券有限责任公司	1	2,790,198,940.67	3.61%	2,183,345.04	3.48%
东北证券股份有限公司	1	4,242,688,430.46	5.48%	3,478,996.79	5.55%
申银万国证券股份有限公司	1	16,024,783,471.00	20.71%	13,140,263.04	20.97%
国泰君安证券股份有限公司	1	7,355,288,552.45	9.51%	5,755,550.14	9.19%
招商证券股份有限公司	1	6,217,798,634.49	8.04%	5,098,565.45	8.14%
合计	8	77,381,520,288.33	100.00%	62,656,354.77	100.00%

(2) 债券交易情况: 无

(3) 债券回购交易情况: 无

(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
中国银河证券有限责任公司	269,752,355.76	53.86%
中信证券股份有限公司	15,340,636.82	3.06%
中银国际证券有限责任公司	215,744,082.63	43.08%
合计	500,837,075.21	100.00%

3. 报告期内租用证券公司席位的变更情况

报告期内本基金新增东北证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司租上海席位各 1 个, 新增国泰君安证券股份有限公司租深圳席位 1 个。

(九) 报告期内本基金刊登于《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	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第四次分红预告与暂停申购及转入业务公告	2007 年 1 月 30 日	
5	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第四次分红公告	2007 年 2 月 3 日	派发现金红利 9.20 元/10 份
6	关于增加光大证券为嘉实 300 基金代销机构的公告	2007 年 2 月 15 日	
7	嘉实沪深 300 指数证券投资基金第五次收益分配预告	2007 年 2 月 27 日	
8	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第五次收益分配公告	2007 年 3 月 3 日	派发现金红利 0.69 元/10 份
9	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
10	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	含本基金
11	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
12	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
13	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
14	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
15	关于增加工商银行作为嘉实服务与嘉实 300 基金代销机构和通过工商银行个人网上银行申购费率优惠的公告	2007 年 6 月 28 日	
16	嘉实基金关于旗下基金执行新的会计准则和停止披露嘉实超短债基金 30 日年化净值增长率的公告	2007 年 7 月 2 日	含本基金
17	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申购费率优惠的公告	2007 年 7 月 9 日	含本基金
18	关于增加中国建设银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 7 月 12 日	含本基金
19	关于增加中国民生银行为嘉实 300 基金代销机构的公告	2007 年 7 月 30 日	
20	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第六次收益分配公告	2007 年 8 月 3 日	派发现金红利 2.00 元/10 份
21	关于对中信银行、昆明商业银行及长沙商业银行的借记卡持有人开通嘉实基金网上直销交易业务的公告	2007 年 8 月 4 日	含本基金
22	关于旗下开放式基金通过中国建设银行开办定期定额投资业务公告	2007 年 8 月 10 日	含本基金

23	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第七次收益分配预告	2007 年 8 月 20 日	
24	嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 第七次收益分配公告	2007 年 8 月 22 日	派发现金红利 4.29 元/10 份
25	关于嘉实 300 基金持有人保留基金份额不设最低份额限制的公告	2007 年 8 月 22 日	
26	关于嘉实成长、嘉实服务和嘉实 300 基金通过中国工商银行开办基金定投业务的公告	2007 年 8 月 24 日	
27	关于增加信泰证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 8 月 24 日	含本基金
28	关于嘉实成长、嘉实服务和嘉实 300 基金参与中国工商银行基金定投费率优惠活动的公告	2007 年 9 月 15 日	
29	关于对光大银行、中行广东分行、金华商行、杭州商行、顺德农信社、上海农商行及南京银行的借记卡持有人开通嘉实基金网上直销交易业务的公告	2007 年 9 月 15 日	含本基金
30	关于增加深圳平安银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 9 月 21 日	含本基金
31	关于调整旗下证券投资基金估值方法和会计政策的公告	2007 年 9 月 28 日	含本基金
32	关于旗下开放式基金参与交通银行开展的基金定投推广活动的公告	2007 年 9 月 29 日	含本基金
33	关于增加中国工商银行、中信银行、安信证券、恒泰证券和中原证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 10 月 9 日	中信银行、安信证券含本基金
34	关于增加中原证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 10 月 23 日	含本基金
35	关于嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 投资权证的公告	2007 年 10 月 24 日	
36	关于对温州商行、济南商行的借记卡持有人开通嘉实基金网上直销交易业务的公告	2007 年 10 月 31 日	含本基金
37	关于旗下开放式基金通过广州证券和中信万通证券开办定期定额投资业务的公告	2007 年 10 月 31 日	含本基金
38	关于增加中国农业银行为旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 11 月 19 日	
39	关于旗下开放式基金通过中国农业银行开办定期定额投资业务的公告	2007 年 11 月 30 日	含本基金
40	关于增加华龙证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 11 月 30 日	含本基金
41	关于旗下开放式基金通过交通银行开办日常基金转换业务公告	2007 年 12 月 11 日	含本基金
42	关于增加兴业银行为嘉实沪深 300 指数 (LOF) 基金代销机构的公告	2007 年 12 月 12 日	
43	关于增加新时代证券和上海证券为旗下开放式基金代销机构的公告	2007 年 12 月 20 日	含本基金

44	关于嘉实成长、嘉实服务和嘉实 300 基金参与中国工商银行基金定投费率优惠活动的公告	2007 年 12 月 27 日	
----	--	------------------	--

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的文件;
- (2) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》;
- (4) 《嘉实沪深 300 指数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) 报告期内嘉实沪深 300 指数证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 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

2008年3月28日