

**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。

本报告中的财务会计报告已经审计，安永华明会计师事务所为本系列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

第一章 基金简介.....	1
第二章 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	4
第三章 管理人报告.....	10
第一节 基金管理人及基金经理情况.....	10
第二节 基金运作的遵规守信情况说明.....	11
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.....	11
第四节 基金内部监察报告.....	14
第四章 托管人报告.....	16
第五章 审计报告.....	17
第六章 财务会计报告.....	18
第一节 基金会计报表.....	18
第二节 年度会计报表附注.....	21
第七章 投资组合报告.....	49
第八章 基金份额持有人情况.....	66
第九章 开放式基金份额变动情况.....	66
第十章 重大事件揭示.....	66
第十一章 备查文件.....	72

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	610,643,329.30 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	27,504,708,270.36 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	4,915,169,296.03 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
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

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

七、其他有关资料

1、会计师事务所

名称	安永华明会计师事务所
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层

2、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、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。

一、嘉实增长基金

(一) 主要财务指标

单位：元

序号	项目	2007 年	2006 年	2005 年
1	本期利润	2,187,867,840.52	1,487,546,629.71	122,516,166.82
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	2,082,522,964.21	973,153,150.52	522,789.27
3	加权平均基金份额本期利润	2.5637	1.2691	0.0928
4	期末可供分配利润	1,961,264,246.77	681,877,882.43	-450,322.17
5	期末可供分配基金份额利润	3.2118	0.6369	-0.0003
6	期末基金资产净值	2,879,528,330.31	2,435,221,649.46	1,833,216,246.30
7	期末基金份额净值	4.716	2.274	1.193

8	加权平均净值利润率	71.27%	76.21%	8.06%
9	本期基金份额净值增长率	107.39%	114.77%	8.85%
10	份额累计净值增长率	496.64%	187.69%	33.95%

注：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
$$R = \frac{\sum_{i=1}^n A_i \times (P_i - P_0)}{A_0}$$
 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。

(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
过去三个月	0.49%	1.23%	0.03%	2.04%	0.46%	-0.81%
过去六个月	26.10%	1.35%	41.98%	2.18%	-15.88%	-0.83%
过去一年	107.39%	1.60%	197.05%	2.59%	-89.66%	-0.99%
过去三年	384.82%	1.27%	396.21%	2.02%	-11.39%	-0.75%
自基金合同生效起至今	496.64%	1.13%	246.92%	1.84%	249.72%	-0.71%

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 12 月 31 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的发行的证券，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 个交易日内进行调整，并符合相应的规定。

3、本基金过往三年每年的净值增长率并与同期业绩比较基准的收益率比较

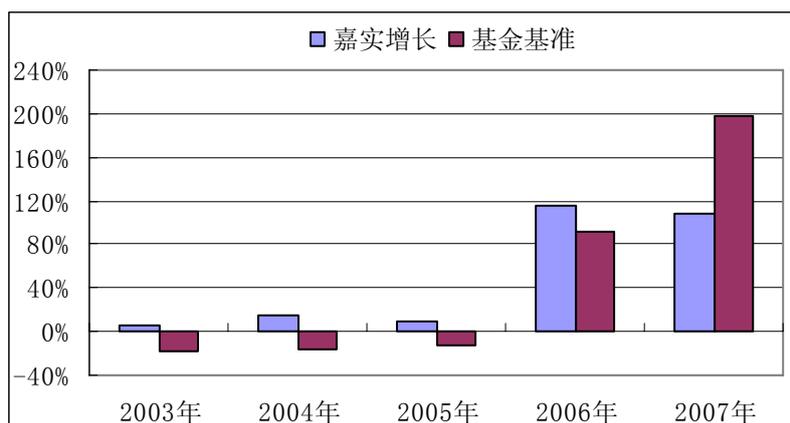


图 2: 嘉实增长基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

（三）本基金过往三年每年基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数 (元)	备注
2007 年		
2006 年	2.100	2006 年共分配四次
2005 年		
合计	2.100	

二、嘉实稳健基金

（一）主要财务指标

单位：元

序号	项目	2007 年	2006 年	2005 年
1	本期利润	10,149,141,461.47	1,748,961,672.32	17,087,155.42
2	本期利润扣减本期公允价值	7,072,031,392.12	782,293,223.63	-21,898,815.00

	变动损益后的净额			
3	加权平均基金份额本期利润	0.6427	1.4393	0.0188
4	期末可供分配利润	16,638,799,529.78	455,666,956.60	-23,288,181.13
5	期末可供分配基金份额利润	0.6049	0.0989	-0.0289
6	期末基金资产净值	38,104,650,434.09	6,056,993,592.19	840,295,344.68
7	期末基金份额净值	1.385	1.314	1.044
8	加权平均净值利润率	48.70%	120.78%	1.85%
9	本期基金份额净值增长率	123.76%	101.90%	2.96%
10	份额累计净值增长率	405.44%	125.88%	11.88%

注：执行新会计准则后财务指标披露方面的主要变化

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

(2) 原“加权平均份额本期净收益”名称调整为“加权平均份额本期利润”，计算方法

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

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

(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
过去三个月	-6.42%	1.55%	-4.43%	1.99%	-1.99%	-0.44%
过去六个月	37.13%	1.62%	39.18%	2.06%	-2.05%	-0.44%
过去一年	123.76%	1.73%	156.00%	2.26%	-32.24%	-0.53%
过去三年	365.14%	1.30%	427.48%	1.72%	-62.34%	-0.42%
自基金合同生效起至今	405.44%	1.16%	326.71%	1.57%	78.72%	-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

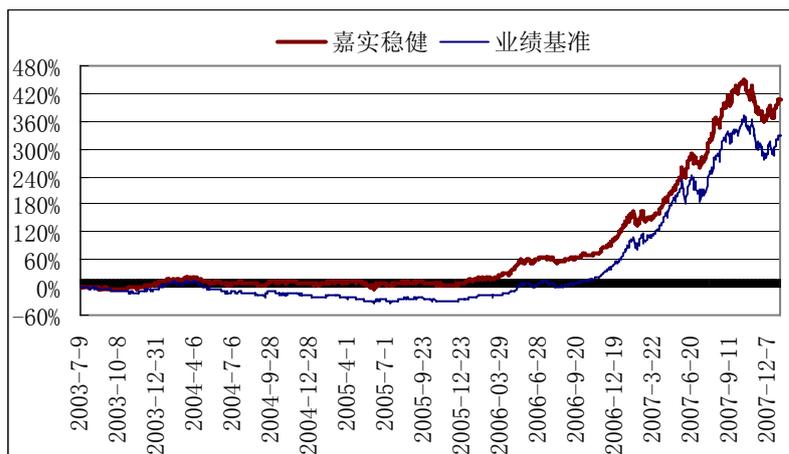


图 3: 嘉实稳健基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2007 年 12 月 31 日)

注 1: 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 个交易日内进行调整, 并符合相应的规定。

注 2: 2008 年 2 月 28 日本基金管理人发布《关于调整嘉实稳健证券投资基金基金经理的公告》, 邹唯先生不再担任本基金基金经理, 本基金由现任基金经理忻怡先生独立管理。

3、本基金过往三年每年的净值增长率并与同期业绩比较基准的收益率比较

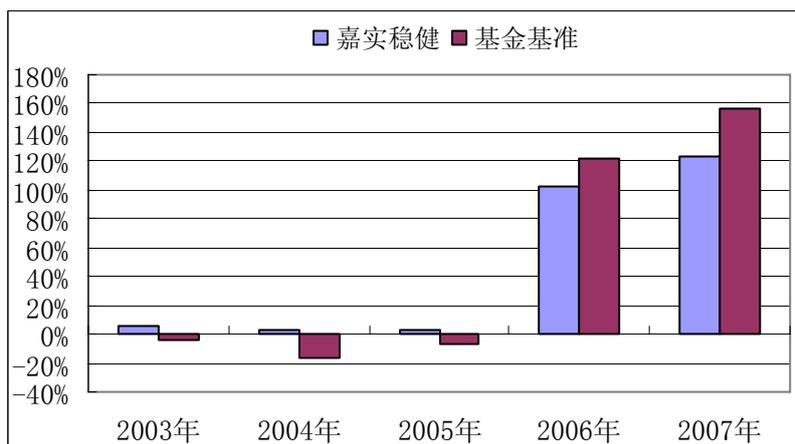


图 4: 嘉实稳健基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

(三) 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	0.500	2007 年共分配一次
2006 年	5.880	2006 年共分配四次
2005 年		
合计	6.380	

三、嘉实债券基金

(一) 主要财务指标

单位: 元

序号	项目	2007 年	2006 年	2005 年
1	本期利润	601,176,681.69	48,679,316.14	16,838,616.21
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	391,848,600.25	31,826,098.76	13,511,657.06
3	加权平均基金份额本期利润	0.2450	0.2432	0.1280
4	期末可供分配利润	16,240,654.78	4,231,484.36	2,804,824.20
5	期末可供分配基金份额利润	0.0033	0.0127	0.0236
6	期末基金资产净值	6,016,275,412.68	356,417,580.73	121,740,676.58
7	期末基金份额净值	1.224	1.067	1.024
8	加权平均净值利润率	19.77%	22.04%	13.05%
9	本期基金份额净值增长率	30.28%	27.17%	13.14%
10	份额累计净值增长率	74.70%	34.10%	5.44%

注: 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
$$E + \sum_{i=1}^n \frac{A_i \times (t_i - t_{i-1})}{n}$$
 的基础上，将 P 改为本期利润。原“加权平均净值收益率”名称调整为“加权平均净值利润率”，计算方法在原公式的基础上，将 P 改为本期利润。

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

(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
过去三个月	2.34%	0.45%	0.10%	0.07%	2.24%	0.38%
过去六个月	12.06%	0.39%	0.86%	0.10%	11.20%	0.29%
过去一年	30.28%	0.41%	-1.80%	0.08%	32.08%	0.33%
过去三年	87.45%	0.41%	11.41%	0.13%	76.04%	0.28%
自基金合同生效起至今	74.70%	0.37%	7.37%	0.22%	67.33%	0.15%

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

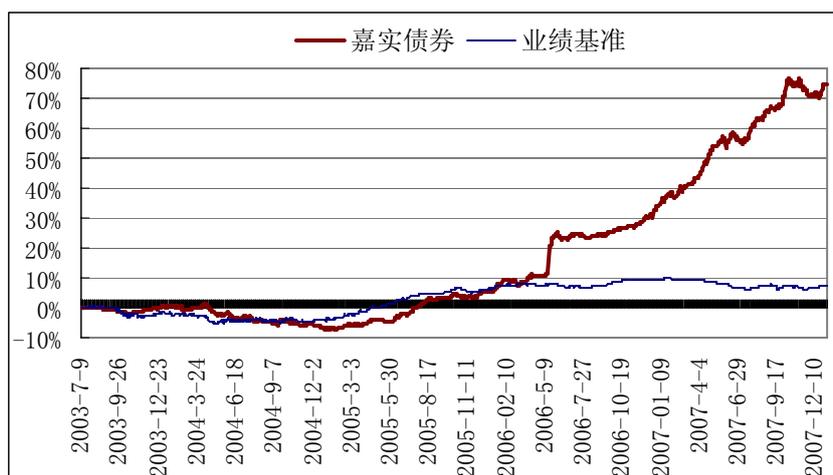


图 5：嘉实债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2007 年 12 月 31 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。

3、本基金过往三年每年的净值增长率并与同期业绩比较基准的收益率比较

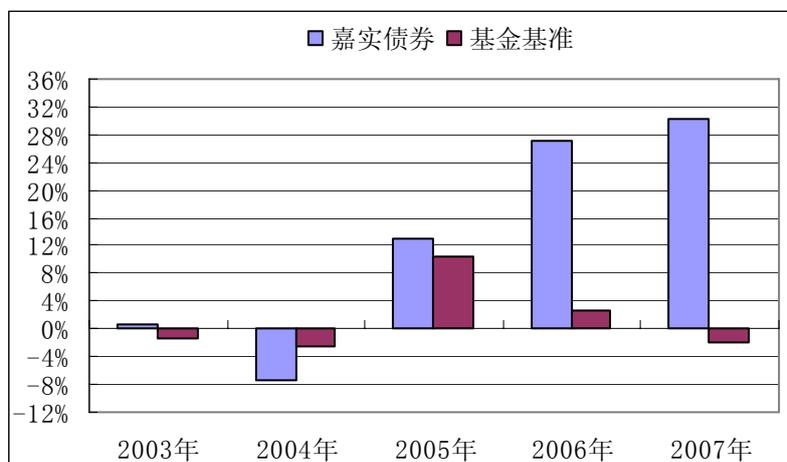


图 6: 嘉实债券基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

(三) 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	1.600	2007 年分配三次
2006 年	2.200	2006 年分配七次
2005 年	0.300	2005 年分配一次
合计	4.100	

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, 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 基金经理小组简介

（1）嘉实增长基金经理

邵健先生，经济学硕士。10 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

忻怡先生，硕士研究生，CFA，6 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，13 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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金基金合同》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。本系列基金/基金运作管理符合有关法律法规及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。

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 4.716 元，报告期内基金份额净值增长率为 107.39%，同期业绩比较基准收益率为 197.05%。自本基金成立以来，本基金份额净值增长率为 496.64%，业绩比较基准收益率为 246.92%。造成本期基金份额净值增长率落后于业绩比较基准收益率的原因主要有两个方面：一是本基金的股票仓位受到基金合同的限制，从而在上涨时会显著落后于全股基准指数；二是本基金在 07 年的投资中相对谨慎，对涨幅巨大的大宗原料板块及低价绩差股等板块进行了低配。

报告期内，中国经济增速创出近年的新高，GDP 增速高达 11.4%。企业盈利在较高的经济增速、温和的通胀的推动下大幅上升，A 股公司预期全年每股收益增长在 50%以上。深沪两市在企业良好的盈利增长与强大的流动性的推动下大幅上扬，并且热点此起彼伏。低价绩差股以及有色金属、煤炭、航空、机械、房地产、金融等板块先后成为热点投资板块。

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。10 月以后，随着 A 股市场估值的日渐高企，国际经济形势的恶化，基金发行的放缓以及中国经济的全面过热及宏观紧缩的预期，A 股市场逐步陷入调整。

在本基金 2007 年的投资中，我们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 2007 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。行业上，上半年我们在保持较多商业、医药等持续增长行业的基础上，重点增持了房地产、机械、金融等行业，下半年，我们在保持较多持续增长行业的基础上，阶段性增持了金融、航空等行业。

(二) 宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望 2008 年市场，我们认为，这将是中国经济与证券市场面临挑战的一年。在经济方面，国际经济形热显著恶化，中国经济由高增长低通胀变为中高增长高通胀，中国经济面临内热外冷的局面，人民币面临较快升值，政策抉择的难度进一步加大。

在证券市场方面，企业盈利由高速增长变为中速增长并且不确定性在加大，估值在盈利增速放缓及供求关系逆转的情况下将显著下移，A 股市场预期将面临一定压力。

与此同时，我们认为，A 股市场将保持较高的活跃度，也将存在较多的结构性机会。短

缺与通胀、节能环保、中国内需、股权激励、资产注入等都将是重要的投资主题。在行业方面，我们认为医药、商业、品牌消费品、海洋石油、新能源等稳定增长行业的相对表现将优于 07 年，金融、钢铁等周期性行业存在阶段性机会。

在 2008 年的投资中，我们仍将贯彻“关注成长、强化防御”的投资策略。在保持较多持续增长行业的基础上，利用部分仓位积极把握前述的多项主题投资的机会。力争继续给长期支持本基金的投资者带来良好的收益。

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 1.385 元，报告期内基金份额净值增长率为 123.76%，同期业绩比较基准增长率为 156.00%。

2007 年对 A 股来说是一个大牛市，在上市公司业绩预期和流动性的推动下，上证指数和沪深 300 分别上涨了 96.7%和 161.5%。从风格上看，中小盘表现相对优良，而大盘股表现相对较差。在行业方面，煤炭、有色金属、航空等行业表现相对较好，而科技、金融、食品饮料等行业表现相对较差。

本基金采取了自下而上精选个股和自上而下行业配置相结合的投资策略。个股方面，云南铜业、中国船舶、盐湖钾肥等个股为本基金带了较大的超额收益，行业上，本基金超配了上游的资源行业。

（二）宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望 2008 年，中国宏观经济面临的最大挑战：如何平衡通货膨胀和外部需求减弱两大风险。对付通货膨胀要求从紧的货币政策，当然人民币的大幅度升值对输入性的通胀会比较有效。但在外部需求减弱的背景下，宏观调控抑制内部需求，极端情况下将导致中国经济硬着陆。

高增长、低通胀是股票投资的最好时期，反之低增长、高通胀则是股票投资最坏的时期。目前中国宏观经济进入了高增长、高通胀时期。我们对 2008 年 A 股的整体收益率水平保持谨慎，同时认为市场波动将大幅度增加。

2008 年，本基金仍然将采取了自下而上精选个股和自上而下行业配置相结合的投资策略。在投资领域上，本基金看好以下几个方面：（1）农产品；（2）对通货膨胀有转嫁能力的行业；（3）行业整合；（4）节能减排的受益者。

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 1.224 元，报告期内基金份额净值增长率为 30.28%，同期业绩比较基准增长率为-1.80%。

报告期内，值得关注的宏观主题是人民币升值、外贸顺差、流动性过剩和通货膨胀，此外，在 GDP 高速增长的大背景下，银行信贷和固定资产投资也居高难下，整体宏观经济呈现出过热的势头。为了保证经济的长期稳定增长，国家采取了一系列宏观调控措施，其中包括人民银行实施的以加息和提高存款准备金率为主的紧缩性货币政策。宏观形势对 07 年债券市场形成了较大的负面影响，而供求关系也使债券市场承受了较大的压力，债券发行力度的提高和股票一级市场的高收益，一个增加了债券市场的供给，另一个则减小了债券市场的需求。鉴于债券市场面临着如此众多的不利因素，本基金在 07 年的绝大部分时间里将组合久期控制在远低于基准的水平，较好地规避了债券市场的下行风险。与此同时，股改顺利完成、人民币升值、企业利润超预期增长、居民金融资产结构转型等等一系列重大利好因素，共同促成了 07 年历史性的股票市场盛宴。面对股票市场的大好形势，本基金从可转债、IPO、公开增发三方面着手，从坚持稳定持股和注重行业选择出发，较好地把握了股票市场的历史性机遇，为投资者创造了较好的回报。

(二) 宏观经济和证券市场展望及投资策略

展望 2008 年，宏观经济的最重要特征将是内热外冷。一方面，国内经济不压不行，不压肯定过热，影响长期稳定增长；另一方面，怎么压，压到什么程度合适，还取决于世界经济尤其是美国经济的震荡对国内的影响。可以说，08 年将是中国经济融入世界的过程当中，国内经济矛盾和世界经济矛盾错综交织、集中体现的一年，形势将十分复杂，难以判断。此外，通货膨胀的趋势及其治理，也将是 08 年宏观经济发展当中可能遇到的一大难点。如果出现经济增速下降的同时物价加速上涨的局面，是保经济还是保物价将成为宏观经济政策制定的两难选择。具体到 08 年的资本市场，在国内外经济形势如此复杂的大背景下，无论债券市场还是股票市场，都将同时面临着众多相互矛盾而又影响重大的利好和利空因素，市场将难以形成比较明显的方向或者趋势，阶段性的投资机会和下行风险都将对 08 年的投资收益形成重大影响。2008 年，本基金将继续遵循“不追求过高风险回报”的投资理念，充分考虑国内外经济形势变化对国内资本市场带来的风险和机会，在严格控制基金净值波动的基础上，为基金持有人努力寻求基金净值的稳定增长。

第四节 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。

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，因市场波动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%，托管人对此进行了提示，并向监管部门进行了报告。

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 审计报告

安永华明（2008）审字第 60468756_A01 号

嘉实理财通系列开放式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理财通系列开放式证券投资基金（以下简称“贵基金”）财务报表，包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表和 2007 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（一）基金管理人对其财务报表的责任

按照企业会计准则和财务报表附注二所述编制基础的规定编制财务报表是贵基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司的责任。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，贵基金财务报表已经按照企业会计准则和附注二所述编制基础的规定编制，在所有重大方面公允反映了贵基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所
中国 北京

中国注册会计师 张小东
中国注册会计师 成超
2008 年 3 月 24 日

第六章 财务会计报告

第一节 基金会计报表

一、资产负债表

会证基01表

编制单位：嘉实基金管理有限公司 2007年12月31日

单位：元

嘉实理财通系列基金							
项目	附注	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
资产		2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
银行存款		198,931,613.60	311,961,584.60	661,343,367.31	441,345,106.92	105,769,672.14	19,916,652.04
结算备付金		3,115,553.94	6,029,821.99	36,409,562.06	37,479,175.70	36,934,424.73	3,672,698.45
存出保证金		1,249,710.16	661,941.77	15,568,653.60	644,380.19	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1	2,497,014,041.18	2,220,318,730.78	35,191,724,496.37	5,493,286,218.77	5,868,829,273.57	331,508,585.08
其中：股票投资		1,845,484,532.98	1,622,158,618.98	27,229,114,996.17	4,179,915,462.31	585,233,707.85	38,136,023.18
债券投资		651,529,508.20	598,160,111.80	7,962,609,500.20	1,313,370,756.46	5,283,595,565.72	288,372,561.90
资产支持证券投资							5,000,000.00
基金投资							
衍生金融资产	2		24,295,484.80	7,180,501.40		8,591,546.95	
买入返售金融资产				1,500,001,200.00		300,000,570.00	
应收证券清算款		167,550,628.76	175,612,784.00	829,418,287.14	130,585,040.31		973,524.08
应收利息	3	8,832,811.13	5,392,279.32	154,209,877.98	11,191,460.16	65,529,474.54	2,687,968.01
应收股利							
应收申购款		19,566,360.53	5,618,397.07	32,670,977.05	25,558,853.18	44,291,742.86	4,511,122.87
其他资产							
资产总计		2,896,260,719.30	2,749,891,024.33	38,428,526,922.91	6,140,090,235.23	6,430,196,704.79	363,520,550.53

嘉实理财通系列基金							
项目	附注	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
负债		2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
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			300,000,000.00				
应付证券清算款		8,911,342.41					4,121,904.72
应付赎回款		1,943,835.46	8,636,325.30	242,996,419.24	68,505,071.95	113,952,256.18	2,194,064.73
应付管理人报酬		3,384,128.42	2,956,091.91	47,151,267.11	7,289,412.13	2,812,649.95	172,112.07
应付托管费		564,021.40	492,682.00	7,858,544.50	1,214,902.04	937,550.00	57,370.68
应付交易费用	4	1,457,373.97	1,526,993.70	24,523,410.53	5,393,958.52	408,083.01	23,136.25
应交税费		156,140.00	134,724.20	83,274.80	83,274.80	292,134.56	262,688.36
应付利息	5		488,920.00				
应付利润						294,909,943.68	
其他负债	6	315,547.33	433,637.76	1,263,572.64	610,023.60	608,674.73	271,692.99
负债合计		16,732,388.99	314,669,374.87	323,876,488.82	83,096,643.04	413,921,292.11	7,102,969.80

权益合计							
实收基金	7	610,643,329.30	1,070,671,701.03	13,592,625,465.83	4,609,029,342.38	4,915,169,296.03	334,132,310.62
未分配利润		2,268,885,001.01	1,364,549,948.43	24,512,024,968.26	1,447,964,249.81	1,101,106,116.65	22,285,270.11
持有人权益合计		2,879,528,330.31	2,435,221,649.46	38,104,650,434.09	6,056,993,592.19	6,016,275,412.68	356,417,580.73
负债及所有者权益总计		2,896,260,719.30	2,749,891,024.33	38,428,526,922.91	6,140,090,235.23	6,430,196,704.79	363,520,550.53
附基金份额净值		4.716	2.274	1.385	1.314	1.224	1.067
基金份额总额		610,643,329.30	1,070,671,701.03	27,504,708,270.36	4,609,029,342.38	4,915,169,296.03	334,132,310.62

二、利润表

单位：元

嘉实理财通系列基金							
项目	附注	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
		2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
收入：		2,279,240,345.61	1,538,152,718.21	10,846,232,271.65	1,795,532,783.08	680,680,352.25	52,343,686.64
利息收入		20,777,983.09	12,872,873.26	143,396,579.42	9,590,906.94	79,855,001.89	5,392,297.30
其中：存款利息收入		2,158,027.43	1,210,535.92	17,080,803.09	1,369,693.66	4,052,388.06	376,110.59
债券利息收入		18,619,955.66	11,662,337.34	124,784,794.50	8,075,656.88	75,411,831.09	5,016,186.71
资产支持证券利息收入						1,753.42	
买入返售金融资产收入				1,530,981.83	145,556.40	389,029.32	
投资收益		2,151,218,083.88	1,008,867,610.86	7,597,734,581.90	817,342,927.14	388,290,730.90	29,919,434.65
其中：股票投资收益	8	2,062,240,907.46	982,093,384.18	7,526,807,447.93	783,753,401.86	350,376,376.00	16,902,064.31
债券投资收益	9	-538,511.94	171,969.11	14,146,732.81	363,141.74	29,966,134.21	7,175,159.97
资产支持证券投资收益						10,112.33	
衍生工具收益	10	80,105,696.35	14,586,850.32	367,844.68	25,568,961.22	7,143,627.95	5,842,210.37
股利收益		9,409,992.01	12,015,407.25	56,412,556.48	7,657,422.32	794,480.41	-
公允价值变动损益	11	105,344,876.31	514,393,479.19	3,077,110,069.35	966,668,448.69	209,328,081.44	16,853,217.38
其他收入	12	1,899,402.33	2,018,754.90	27,991,040.98	1,930,500.31	3,206,538.02	178,737.31
费用		91,372,505.09	50,606,088.50	697,090,810.18	46,571,110.76	79,503,670.56	3,664,370.50
管理人报酬		45,930,368.12	29,182,028.71	308,230,608.34	20,968,723.71	17,844,346.32	1,301,835.87
托管费		7,655,061.40	4,863,671.56	51,371,768.05	3,494,787.33	5,948,115.43	433,945.31
交易费用	13	24,646,510.08	13,260,005.00	298,384,224.25	20,249,422.78	4,481,953.94	368,051.47
利息支出		12,953,994.82	2,974,355.79	38,721,029.87	1,665,671.39	51,033,150.42	1,447,498.89
其中：卖出回购金融资产支出		12,953,994.82	2,974,355.79	38,721,029.87	1,665,671.39	51,033,150.42	1,447,498.89
其他费用	14	186,570.67	326,027.44	383,179.67	192,505.55	196,104.45	113,038.96
净利润		2,187,867,840.52	1,487,546,629.71	10,149,141,461.47	1,748,961,672.32	601,176,681.69	48,679,316.14

三、所有者权益（基金净值）变动表

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

项目	附注	2007 年度			2006 年度		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）		1,070,671,701.03	1,364,549,948.43	2,435,221,649.46	1,536,901,368.28	296,314,878.02	1,833,216,246.30

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）		2,187,867,840.52	2,187,867,840.52		1,487,546,629.71	1,487,546,629.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		-460,028,371.73	-1,283,532,787.94	-1,743,561,159.67	-466,229,667.25	-179,940,404.09
其中：1. 基金申购款		299,353,836.69	701,295,174.05	1,000,649,010.74	1,063,500,001.14	713,621,551.62
2. 基金赎回款		-759,382,208.42	-1,984,827,961.99	-2,744,210,170.41	-1,529,729,668.39	-893,561,955.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	15					-239,371,155.21
五、期末所有者权益（基金净值）		610,643,329.30	2,268,885,001.01	2,879,528,330.31	1,070,671,701.03	1,364,549,948.43

（二）嘉实稳健基金

项目	附注	2007 年度			2006 年度		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）		4,609,029,342.38	1,447,964,249.81	6,056,993,592.19	805,081,074.73	35,214,269.95	840,295,344.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）			10,149,141,461.47	10,149,141,461.47		1,748,961,672.32	1,748,961,672.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		8,983,596,123.45	13,483,233,095.81	22,466,829,219.26	3,803,948,267.65	-71,331,809.13	3,732,616,458.52
其中：1. 基金申购款		19,634,127,106.15	27,074,516,127.82	46,708,643,233.97	5,563,020,988.20	246,210,297.72	5,809,231,285.92
2. 基金赎回款		-10,650,530,982.70	-13,591,283,032.01	-24,241,814,014.71	-1,759,072,720.55	-317,542,106.85	-2,076,614,827.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	15		-568,313,838.83	-568,313,838.83		-264,879,883.33	-264,879,883.33
五、期末所有者权益（基金净值）		13,592,625,465.83	24,512,024,968.26	38,104,650,434.09	4,609,029,342.38	1,447,964,249.81	6,056,993,592.19

（三）嘉实债券基金

项目	附注	2007 年度			2006 年度		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）		334,132,310.62	22,285,270.11	356,417,580.73	118,935,852.38	2,804,824.20	121,740,676.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）			601,176,681.69	601,176,681.69		48,679,316.14	48,679,316.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		4,581,036,985.41	1,010,599,716.53	5,591,636,701.94	215,196,458.24	24,280,332.21	239,476,790.45
其中：1. 基金申购款		9,267,878,859.45	2,158,701,080.59	11,426,579,940.04	525,984,104.22	57,251,210.30	583,235,314.52
2. 基金赎回款		-4,686,841,874.04	-1,148,101,364.06	-5,834,943,238.10	-310,787,645.98	-32,970,878.09	-343,758,524.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	15		-532,955,551.68	-532,955,551.68		-53,479,202.44	-53,479,202.44
五、期末所有者权益（基金净值）			1,101,106,116.65				

金净值)		4,915,169,296.03		6,016,275,412.68	334,132,310.62	22,285,270.11	356,417,580.73
------	--	------------------	--	------------------	----------------	---------------	----------------

第二节 年度会计报表附注

一、本系列基金的基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金（以下简称“本系列基金”或“理财通系列基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）于2003年5月6日《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2003]67号）核准公开发售。根据当时生效的法律法规的有关规定，本系列基金于2003年7月9日成立，自该日起本系列基金管理人正式开始管理本系列基金。本系列基金成立日的基金份额总额为2,562,105,335.59份。

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开放式证券投资基金（以下简称“嘉实增长”）、嘉实稳健开放式证券投资基金（以下简称“嘉实稳健”）和嘉实债券开放式证券投资基金（以下简称“嘉实债券”）。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。本系列基金存续期限不定。

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。

二、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。

三、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

本系列基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

本基金自2007年7月1日起执行企业会计准则，对于因首次执行企业会计准则而发生的会计政策变更，本基金按照有关首次执行企业会计准则的规定采用下述方法进行处理。

1、采用追溯调整法核算的会计政策变更

将所持有的金融资产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，且其变动计入当期损益。

2、采用未来适用法的会计政策变更

除上面1、所述的采用追溯调整法的会计政策变更以外，根据企业会计准则的有关规定，

本基金对因首次执行企业会计准则而产生的对于某些金融工具的成本收益核算方法或估值方法的变更因不切实可行而采用未来适用法。

本年度首次执行企业会计准则，本系列基金按其列报要求对比较数据进行了重述。按企业会计准则的要求，对年末所有者权益及期间净损益的影响情况如下：

①嘉实增长

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	1,833,216,246.30	973,153,150.52	2,435,221,649.46
金融资产公允价值变动的调整数		514,393,479.19	
按新会计准则列报的金额	1,833,216,246.30	1,487,546,629.71	2,435,221,649.46

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	2,435,221,649.46	1,087,337,020.82	3,286,414,528.08
金融资产公允价值变动的调整数		332,189,497.83	
按新会计准则列报的金额	2,435,221,649.46	1,419,526,518.65	3,286,414,528.08

②嘉实稳健

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	840,295,344.68	782,293,223.63	6,056,993,592.19
金融资产公允价值变动的调整数		966,668,448.69	
按新会计准则列报的金额	840,295,344.68	1,748,961,672.32	6,056,993,592.19

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	6,056,993,592.19	2,252,497,124.16	16,830,136,894.21
金融资产公允价值变动的调整数		5,042,338.29	
按新会计准则列报的金额	6,056,993,592.19	2,257,539,462.45	16,830,136,894.21

③嘉实债券

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	121,740,676.58	31,826,098.76	356,417,580.73
金融资产公允价值变动的调整数		16,853,217.38	
按新会计准则列报的金额	121,740,676.58	48,679,316.14	356,417,580.73

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	356,417,580.73	103,824,910.60	3,346,158,099.72
金融资产公允价值变动的调整数		50,751,318.95	
按新会计准则列报的金额	356,417,580.73	154,576,229.55	3,346,158,099.72

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

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

(三) 记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

(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

1、金融工具是指形成本基金的金融资产,并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

金融工具的确认和终止确认:本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产满足下列条件之一的,终止确认:

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- (2) 该金融资产已转移,且符合下述第 4 点金融资产转移的终止确认条件。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。

2、金融资产分类和计量

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类: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。金融资产在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,相关交易费用直接计入当期损益,其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

3、衍生金融工具

本基金的衍生金融工具主要系权证投资。衍生金融工具以公允价值计量,因公允价值变动而产生的任何不符合套期会计规定的利得或损失,直接计入当期损益。公允价值为正数的

衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。

4、金融资产转移

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

5、金融负债分类和计量

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

（六）基金资产的估值原则

1、上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格；

2、未上市的股票的估值

（1）送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值；

（2）首次公开发行的股票，2007年7月1日前，按其成本价估值；2007年7月1日起，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

（3）非公开发行有明确锁定期的股票的估值

根据中国证监会基金部通知[2006]37号文《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，2006年11月13日前投资的非公开发行的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券，以最近一个交易日的收盘价计算；2006

年 11 月 13 日后投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，应按中国证监会相关规定估值。

3、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格；

4、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格；

5、未上市债券和在银行间同业市场交易的债券，2007 年 7 月 1 日前，以不含息价格计价，嘉实增长和嘉实稳健按成本估值，嘉实债券按成本与市价孰低法估值；2007 年 7 月 1 日起，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

6、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，2007 年 7 月 1 日前按成本估值；2007 年 7 月 1 日起采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；在银行间债券市场交易的资产支持证券，2007 年 7 月 1 日前按成本估值；2007 年 7 月 1 日起采用估值技术确定公允价值；

7、上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格；

8、未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

9、因持有股票而享有的配股权证，2007 年 7 月 1 日前，从配股除权日到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；2007 年 7

月 1 日起，采用估值技术确定公允价值进行估值；

10、分离交易可转债，上市日前，按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价分别确定当日债券和权证的估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 3、4、7 中相关原则进行估值；

11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可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方法估值；

12、如有新增事项，按国家最新规定估值。

（七）证券投资的成本计价方法

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的股票、债券、基金，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。资产负债表日，企业应将公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，2007 年 7 月 1 日前按成交日应支付的全部价款入账；2007 年 7 月 1 日起按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

2、债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，2007 年 7 月 1 日前，按成交日应支付的全部价款入账；2007 年 7 月 1 日起，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所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，不构成债券投资成本；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，2007 年 7 月 1 日前，于实际支付价款

时确认为债券投资；2007 年 7 月 1 日起，于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所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，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益；

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券 2007 年 7 月 1 日前，于实际收到全部价款时确认债券投资收益；2007 年 7 月 1 日起，于成交日确认债券投资收益。

出售债券的成本按移动加权平均法结转；

3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本，2007 年 7 月 1 日前，按成交日应支付的全部价款入账；2007 年 7 月 1 日起，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

4、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于确认日根据中国证券业协会公布的债券和权证的公允价值计算出两者占全部公允价值的比例，根据此比例来确认债券和权证分别应承担的成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中相关原则进行计算。

5、回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）2007 年 7 月 1 日前，以协议金额列示，按协议金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提利息；2007 年 7 月 1 日起，以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

（八）待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用根据权责发生制按直线法在与其相关的期限内进行摊销。

（九）收入的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息

收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按资产支持证券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在资产支持证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，2007 年 7 月 1 日前，按协议金额及约定利率，在回购期内采用直线法逐日计提；2007 年 7 月 1 日起，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益，并按收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：2007 年 7 月 1 日前，于实际收到价款时确认债券差价收入；2007 年 7 月 1 日起，于成交日确认债券投资收益，并按成交总额与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

(十) 费用的确认和计量

1、嘉实稳健基金和嘉实增长基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提，嘉实债券基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6%的年费率逐日计提；

2、嘉实稳健基金和嘉实增长基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年

费率逐日计提，嘉实债券基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，2007 年 7 月 1 日前，按协议金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提；2007 年 7 月 1 日起，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

（十一）实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

（十二）损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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。未实现损益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确认。

于 2007 年 7 月 1 日之前，未实现损益平准金在持有人权益中“未实现利得”科目中核算；已实现损益平准金于年末全额转入未分配利润。自 2007 年 7 月 1 日起，未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于年末全额转入未分配利润。

（十三）基金的收益分配政策

1、基金收益分配采用现金方式或再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；未选择分红方式的基金份额持有人的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

5、如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、基金收益分配比例按照有关规定执行；

7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金

会计年度结束后 4 个月内完成。

8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

(十四) 基金拆分会计政策

基金份额拆分日，按拆分前的基金份额数及确定的拆分比例，计算增加的基金份额数，在“实收基金”科目的“数量”栏进行记录。

(十五) 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。

四、税项

(一) 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）交易印花税；

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，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

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》的规定，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发生的股权转让，暂免征收印花税。

(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》的规定，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、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(三) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息等收入由上市公司、债券发行企业等向基金派发时代扣代缴 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》的规定，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、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

五、资产负债表日后事项：无

六、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
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

本系列基金于 2007 年度和 2006 年度均未通过关联方席位进行交易。

2. 关联方报酬

（1）基金管理费

①嘉实增长基金、嘉实稳健基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提；嘉实债券的管理费按前一日的基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

嘉实增长基金

项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	2,956,091.91	45,930,368.12	45,502,331.61	3,384,128.42
2006 年度	2,224,428.17	29,182,028.71	28,450,364.97	2,956,091.91
嘉实稳健基金				
项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	7,289,412.13	308,230,608.34	268,368,753.36	47,151,267.11
2006 年度	1,086,657.89	20,968,723.71	14,765,969.47	7,289,412.13
嘉实债券基金				
项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	172,112.07	17,844,346.32	15,203,808.44	2,812,649.95
2006 年度	59,763.03	1,301,835.87	1,189,486.83	172,112.07

(2) 基金托管费

① 嘉实增长基金、嘉实稳健基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；嘉实债券基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

② 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

嘉实增长基金				
项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	492,682.00	7,655,061.40	7,583,722.00	564,021.40
2006 年度	370,738.05	4,863,671.56	4,741,727.61	492,682.00
嘉实稳健基金				
项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	1,214,902.04	51,371,768.05	44,728,125.59	7,858,544.50
2006 年度	181,109.64	3,494,787.33	2,460,994.93	1,214,902.04
嘉实债券基金				
项目	年初余额	本年计提	本年支付	年末余额
2007 年度	57,370.68	5,948,115.43	5,067,936.11	937,550.00
2006 年度	19,921.01	433,945.31	396,495.64	57,370.68

3. 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
债券买卖交易						
全年购入交易量	229,381,182.97	158,147,347.79	2,827,960,949.58	566,545,303.76	1,648,711,910.72	39,273,730.51
全年卖出交易量	334,147,649.65	20,011,200.00	1,232,831,823.02	30,598,930.00	1,770,989,111.16	38,921,117.81

卖出回购证券						
全年交易量	2,274,132,000.00	363,200,000.00	9,672,000,000.00	186,800,000.00	10,180,360,000.00	72,210,000.00
年末余额						
全年支出	2,179,595.04	194,690.52	7,825,964.34	110,734.90	5,940,814.15	38,625.50

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中国银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下：

项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
银行存款余额	198,931,613.60	311,961,584.60	661,343,367.31	441,345,106.92	105,769,672.14	19,916,652.04
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
银行存款产生的利息收入	2,004,275.63	1,131,550.16	16,349,840.25	1,289,435.61	3,499,500.51	345,324.99

5 关联方投资本基金情况

(1) 基金管理人及其股东持有本系列基金情况

①嘉实稳健基金

关联方名称	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
立信投资有限责任公司	4,985,967.37	0.0181%		
合计	4,985,967.37	0.0181%		

②嘉实债券基金

关联方名称	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	34,122,230.69	0.6942%	20,349,044.29	6.09%
合计	34,122,230.69	0.6942%	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。

(2) 基金管理人主要股东控制的机构持有本系列基金情况：无

七、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

①嘉实增长基金

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	1,062,003,045.47	1,845,484,532.98	783,481,487.51	963,245,773.42	1,622,158,618.98	658,912,845.56
债券投资	交易所市场	218,810,518.76	227,043,508.20	8,232,989.44	379,539,093.60	3,035,761.92
	银行间市场	424,611,508.36	424,486,000.00	-125,508.36	218,621,018.20	
	合计	643,422,027.12	651,529,508.20	8,107,481.08	598,160,111.80	3,035,761.92
资产支持证券投资						
合计	1,705,425,072.59	2,497,014,041.18	791,588,968.59	1,558,370,123.30	2,220,318,730.78	661,948,607.48

②嘉实稳健基金

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	23,111,944,650.82	27,229,114,996.17	4,117,170,345.35	3,151,582,745.88	4,179,915,462.31	1,028,332,716.43
债券投资	交易所市场	170,288,552.09	172,131,500.20	1,842,948.11	195,282,812.70	232,476.38
	银行间市场	7,804,688,936.20	7,790,478,000.00	-14,210,936.20	1,118,087,943.76	
	合计	7,974,977,488.29	7,962,609,500.20	-12,367,988.09	1,313,138,280.08	1,313,370,756.46
资产支持证券投资						
合计	31,086,922,139.11	35,191,724,496.37	4,104,802,357.26	4,464,721,025.96	5,493,286,218.77	1,028,565,192.81

③嘉实债券基金

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	304,295,234.29	585,233,707.85	280,938,473.56	21,641,243.03	38,136,023.18	16,494,780.15
债券投资	交易所市场	2,462,023,127.67	2,449,814,859.72	-12,208,267.95	153,922,202.91	908,006.39
	银行间市场	2,877,114,803.70	2,833,780,706.00	-43,334,097.70	133,832,672.60	-290,320.00
	合计	5,339,137,931.37	5,283,595,565.72	-55,542,365.65	287,754,875.51	288,372,561.90
资产支持证券投资				5,000,000.00	5,000,000.00	
合计	5,643,433,165.66	5,868,829,273.57	225,396,107.91	314,396,118.54	331,508,585.08	17,112,466.54

本年度本系列基金所投资的股票中,无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。(2006年度:嘉实增长,人民币37,152,415.56元;嘉实稳健,人民币1,920,635.03元;嘉实债券,人民币0.00元)

(2) 衍生金融资产

嘉实增长基金

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					24,295,484.80	24,295,484.80
合计					24,295,484.80	24,295,484.80

嘉实稳健基金

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	6,307,596.50	7,180,501.40	872,904.90			
合计	6,307,596.50	7,180,501.40	872,904.90			

嘉实债券基金

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	7,547,106.88	8,591,546.95	1,044,440.07			
合计	7,547,106.88	8,591,546.95	1,044,440.07			

(3) 应收利息

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
应收银行存款利息	47,780.02	49,975.70	420,637.56	130,337.57	65,642.34	24,602.01
应收结算备付金利息	1,402.00	2,713.40	16,384.30	16,865.60	16,620.50	1,652.70
应收债券利息	8,782,886.73	5,339,527.92	153,411,848.65	11,044,194.69	65,344,044.49	2,618,579.05
应收资产支持证券利息						43,134.25
应收权证保证金利息	62.30	62.30	62.30	62.30		
应收申购款利息	680.08		261.33		31,294.45	
应收买入返售金融资产利息			360,683.84		71,872.76	
合计	8,832,811.13	5,392,279.32	154,209,877.98	11,191,460.16	65,529,474.54	2,687,968.01

(4) 应付交易费用

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
应付佣金	1,447,998.17	1,526,993.70	24,504,020.53	5,393,600.02	371,778.01	20,754.73
其中：国泰君安	214,462.64	437,969.61	5,731,274.29	668,241.20		
联合证券					138,412.99	6,479.46
海通证券				590,322.09		
中信证券	426,293.49	149,965.88	5,688,807.76		233,365.02	13,471.27
中金公司			4,457,900.77	612,645.61		
东吴证券	635,482.11	97,554.43				
中信建投证券		539,329.58	2,878,371.83			
招商证券		253,877.80				
渤海证券	171,759.93	48,296.40				
国信证券			2,462,530.66	1,679,812.36		
申银万国			2,659,715.75	432,700.06		
银河证券			-	570,898.87		
湘财证券			625,419.47	838,979.83		
应付席位使用费						804.00
应付银行间交易费用	9,375.80		19,390.00	358.50	36,305.00	2,381.52
合计	1,457,373.97	1,526,993.70	24,523,410.53	5,393,958.52	408,083.01	23,136.25

(5) 应付利息

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
应付上交所卖出回购利息支出		488,920.00				
合计		488,920.00				

(6) 其他负债

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31	2007-12-31	2006-12-31
应付席位保证金	250,000.00	250,000.00	250,000.00	250,000.00	250,000.00	250,000.00
应付通讯费			15,522.50			
应付赎回费	5,547.33	18,037.76	875,050.14	258,423.60	317,174.73	4,357.35
预提审计费	60,000.00	100,600.00	123,000.00	71,600.00	37,000.00	7,800.00
预提信息披露费		65,000.00		30,000.00		5,000.00
预提银行间账户维护费					4,500.00	4,535.64
合计	315,547.33	433,637.76	1,263,572.64	610,023.60	608,674.73	271,692.99

(7) 实收基金

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
年初实收基金	1,070,671,701.03	1,536,901,368.28	4,609,029,342.38	805,081,074.73	334,132,310.62	118,935,852.38
加：本年申购	299,353,836.69	1,063,500,001.14	19,634,127,106.15	5,563,020,988.20	9,267,878,859.45	525,984,104.22
其中：基金分红再投资		51,719,417.77	169,156,969.12	42,164,491.34	101,334,356.32	35,992,071.15
减：本年赎回	759,382,208.42	1,529,729,668.39	10,650,530,982.70	1,759,072,720.55	4,686,841,874.04	310,787,645.98
年末实收基金	610,643,329.30	1,070,671,701.03	13,592,625,465.83	4,609,029,342.38	4,915,169,296.03	334,132,310.62

本系列基金管理人于 2007 年 5 月 30 日（拆分日）按照 1:2.023867075 的拆分比例对嘉实稳健基金进行了基金份额拆分。拆分前，嘉实稳健基金的基金份额净值为人民币 2.024 元；拆分后，基金份额净值为人民币 1.000 元。

(8) 股票投资收益

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
卖出股票成交总额	5,011,799,754.35	3,895,450,589.81	34,382,271,906.82	4,075,686,775.44	1,107,283,270.11	116,334,591.68
减：卖出股票成本总额	2,949,558,846.89	2,913,357,205.63	26,855,464,458.89	3,291,933,373.58	756,906,894.11	99,432,527.37
股票投资收益	2,062,240,907.46	982,093,384.18	7,526,807,447.93	783,753,401.86	350,376,376.00	16,902,064.31

(9) 债券投资收益

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
卖出及到期兑付债券成交总额	681,983,301.55	411,096,764.26	4,799,284,950.36	191,338,061.16	5,187,430,959.17	990,739,922.06
减：卖出及到期兑付债券成本总额	669,687,187.49	401,935,477.53	4,678,824,328.37	186,306,383.67	5,079,367,167.42	969,611,789.84
减：应收利息总额	12,834,626.00	8,989,317.62	106,313,889.18	4,668,535.75	78,097,657.54	13,952,972.25
债券投资收益	-538,511.94	171,969.11	14,146,732.81	363,141.74	29,966,134.21	7,175,159.97

(10) 衍生工具收益

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
卖出权证成交总额	89,076,840.45	14,586,850.32	598,242.23	25,568,961.22	12,286,369.69	5,842,210.37
减：卖出权证成本总额	8,971,144.10		230,397.55		5,142,741.74	
权证投资收益	80,105,696.35	14,586,850.32	367,844.68	25,568,961.22	7,143,627.95	5,842,210.37

(11) 公允价值变动收益

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
交易性金融资产	129,640,361.11	490,252,816.28	3,076,237,164.45	970,338,448.69	208,283,641.37	16,853,217.38
其中：股票投资	124,568,641.95	490,225,878.45	3,088,837,628.92	971,329,913.46	264,443,693.41	16,494,780.15
债券投资	5,071,719.16	26,937.83	-12,600,464.47	-991,464.77	-56,160,052.04	358,437.23
衍生工具	-24,295,484.80	24,140,662.91	872,904.90	-3,670,000.00	1,044,440.07	
其中：权证投资	-24,295,484.80	24,140,662.91	872,904.90	-3,670,000.00	1,044,440.07	
合计	105,344,876.31	514,393,479.19	3,077,110,069.35	966,668,448.69	209,328,081.44	16,853,217.38

(12) 其他收入

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
赎回费收入	1,805,937.07	1,455,351.69	26,462,373.97	1,597,693.49	2,927,110.20	134,810.60
转换费收入	93,465.26	548,203.21	1,528,667.01	332,806.82	279,427.82	30,076.71
其他		15,200.00				13,850.00
合计	1,899,402.33	2,018,754.90	27,991,040.98	1,930,500.31	3,206,538.02	178,737.31

(13) 交易费用

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
交易所交易费用	24,627,127.24	13,257,705.00	298,318,780.73	20,246,722.78	4,435,578.89	361,751.47
银行间交易费用	19,382.84	2,300.00	65,443.52	2,700.00	46,375.05	6,300.00
合计	24,646,510.08	13,260,005.00	298,384,224.25	20,249,422.78	4,481,953.94	368,051.47

(14) 其他费用

嘉实理财通系列基金						
项目	嘉实增长		嘉实稳健		嘉实债券	
	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度	2007年度	2006年度
审计费用	60,000.00	100,600.00	123,000.00	71,600.00	37,000.00	7,800.00
信息披露费	84,000.00	195,000.00	204,000.00	90,000.00	12,000.00	15,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00	18,000.00	18,000.00	18,000.00	18,000.00
席位使用费					87,308.28	59,790.46
银行费用	24,570.67	12,427.44	38,179.67	12,905.55	41,796.17	11,930.92
其他						517.58
合计	186,570.67	326,027.44	383,179.67	192,505.55	196,104.45	113,038.96

(15) 收益分配

嘉实增长基金		
项目	2007 年度	2006 年度
第一次收益分配		35,045,961.12
第二次收益分配		47,174,810.17
第三次收益分配		94,676,186.87
第四次收益分配		62,474,197.05
累计收益分配		239,371,155.21
嘉实稳健基金		
项目	2007 年度	2006 年度
第一次收益分配	568,313,838.83	24,659,529.67
第二次收益分配		15,048,728.73
第三次收益分配		15,053,637.04
第四次收益分配		210,117,987.89
累计收益分配	568,313,838.83	264,879,883.33
嘉实债券基金		
项目	2007 年度	2006 年度
第一次收益分配	67,536,404.92	2,417,260.65
第二次收益分配	170,509,203.08	3,362,311.69
第三次收益分配	294,909,943.68	3,631,217.08
第四次收益分配		6,945,071.53
第五次收益分配		9,906,618.48
第六次收益分配		14,323,560.08
第七次收益分配		12,893,162.93
累计收益分配	532,955,551.68	53,479,202.44

八、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的因认购新发或增发而流通受限的股票

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	2007-9-27	2008-1-9	新股流通受限	36.99	65.61	442,084	16,352,687.16	29,005,131.24
2	601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	30.00	49.45	70,261	2,107,830.00	3,474,406.45
3	002177	御银股份	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
4	002178	延华智能	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
5	002179	中航光电	2007-10-22	2008-2-1	新股流通受限	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10
6	002181	粤传媒	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	7.49	26.68	12,422	93,040.78	331,418.96
7	002182	云海金属	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
8	002183	怡亚通	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20
9	002184	海得控制	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
10	002186	全聚德	2007-11-7	2008-2-20	新股流通受限	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
11	002187	广百股份	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
12	002188	新嘉联	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
13	002189	利达光电	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
14	002190	成飞集成	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
15	002195	海隆软件	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
16	002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
17	002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-3-26	新股流通受限	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
18	002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	36.00	140.45	7,355	264,780.00	1,033,009.75
19	600118	中国卫星	2007-12-28	2008-1-8	配股未上市	18.19	38.45	215,056	3,911,868.64	8,268,903.20
合计									25,382,608.42	50,368,591.04

2. 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	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2007-12-28	刊登公告	63.69	2008-1-2	62.70	199,907	11,787,878.73	12,732,076.83
合计									11,787,878.73	12,732,076.83

3. 报告期末债券正回购交易中作为质押的债券

截至 2007 年 12 月 31 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元 (2006 年 12 月 31 日：3 亿元，2007 年 1 月 4 日到期)。

(二) 嘉实稳健基金

1. 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的股票

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	2007-9-27	2008-1-9	新股流通受限	36.99	65.61	4,002,140	148,039,158.60	262,580,405.40
2	601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	30.00	49.45	2,842,406	85,272,180.00	140,556,976.70
3	601918	国投新集	2007-12-7	2008-3-19	新股流通受限	5.88	15.92	445,632	2,620,316.16	7,094,461.44
4	002177	御银股份	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
5	002178	延华智能	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
6	002179	中航光电	2007-10-22	2008-2-1	新股流通受限	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10
7	002181	粤传媒	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	7.49	26.68	12,422	93,040.78	331,418.96
8	002182	云海金属	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
9	002183	怡亚通	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20

10	002184	海得控制	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
11	002186	全聚德	2007-11-7	2008-2-20	新股流通受限	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
12	002187	广百股份	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
13	002188	新嘉联	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
14	002189	利达光电	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
15	002190	成飞集成	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
16	002193	山东如意	2007-11-28	2008-3-7	新股流通受限	13.07	24.10	15,044	196,625.08	362,560.40
17	002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-3-7	新股流通受限	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
18	002195	海隆软件	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
19	002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
20	002200	绿大地	2007-12-11	2008-3-21	新股流通受限	16.49	49.70	16,647	274,509.03	827,355.90
21	002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-3-26	新股流通受限	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
22	002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70
23	000651	格力电器	2007-12-13	2008-1-21	增发流通受限	39.16	49.35	4,500,000	176,220,000.00	222,075,000.00
合计									417,535,728.59	649,536,611.85

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债券

序号	债券代码	债券名称	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	126008	07 上汽债	2007-12-19	2008-1-8	未上市	71.27	71.80	219,530	15,645,403.50	15,762,254.00
合计									15,645,403.50	15,762,254.00

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	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
1	600169	太原重工	2007-12-10	重大事项	36.06	2008-1-2	39.67	657,496	13,921,448.28	23,709,305.76
2	600331	宏达股份	2007-9-27	重大事项	80.2	未公告		499,914	23,719,635.09	40,093,102.80
3	600521	华海药业	2007-12-28	重大事项未公告	25.68	2008-1-2	26.00	1,270,916	32,946,518.33	32,637,122.88
合计									70,587,601.70	96,439,531.44

3. 报告期末债券正回购交易中作为质押的债券：无

4. 报告期末本基金持有流通受限的权证

序号	权证代码	权证名称	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	580016	上汽 CWB1	2007-12-19	2008-1-8	未上市	7.98	9.0857	790,308	6,307,596.50	7,180,501.40
合计									6,307,596.50	7,180,501.40

(三) 嘉实债券基金

1. 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的股票

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	2007-9-27	2008-1-9	新股流通受限	36.99	65.61	1,435,374	53,094,484.26	94,174,888.14
2	601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	30.00	49.45	1,868,323	56,049,690.00	92,388,572.35
3	601857	中国石油	2007-10-30	2008-2-5	新股流通受限	16.70	30.96	4,504,884	75,231,562.80	139,471,208.64

4	601918	国投新集	2007-12-7	2008-3-19	新股流通受限	5.88	15.92	445,632	2,620,316.16	7,094,461.44
5	601999	出版传媒	2007-12-18	2008-3-21	新股流通受限	4.64	20.24	203,277	943,205.28	4,114,326.48
6	002177	御银股份	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
7	002178	延华智能	2007-10-24	2008-2-1	新股流通受限	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
8	002179	中航光电	2007-10-22	2008-2-1	新股流通受限	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10
9	002181	粤传媒	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	7.49	26.68	12,422	93,040.78	331,418.96
10	002182	云海金属	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
11	002183	怡亚通	2007-11-2	2008-2-13	新股流通受限	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20
12	002184	海得控制	2007-11-7	2008-2-18	新股流通受限	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
13	002186	全聚德	2007-11-7	2008-2-20	新股流通受限	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
14	002187	广百股份	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
15	002188	新嘉联	2007-11-12	2008-2-22	新股流通受限	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
16	002189	利达光电	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
17	002190	成飞集成	2007-11-19	2008-3-3	新股流通受限	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
18	002193	山东如意	2007-11-28	2008-3-7	新股流通受限	13.07	24.10	15,044	196,625.08	362,560.40
19	002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-3-7	新股流通受限	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
20	002195	海隆软件	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
21	002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	新股流通受限	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
22	002199	东晶电子	2007-12-12	2008-3-12	新股流通受限	8.80	25.50	9,645	84,876.00	245,947.50
23	002200	绿大地	2007-12-11	2008-3-21	新股流通受限	16.49	49.70	16,647	274,509.03	827,355.90
24	002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-3-26	新股流通受限	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
25	002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	新股流通受限	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70
合计									193,408,208.33	354,719,172.86

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债券

序号	债券代码	债券名称	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	126008	07 上汽债	2007-12-19	2008-1-8	未上市	71.26	71.80	262,670	18,717,590.26	18,859,706.00
合计									18,717,590.26	18,859,706.00

3. 报告期末本基金持有的暂时停牌股票：无

4. 报告期末债券正回购交易中作为质押的债券：无

5. 报告期末本基金持有流通受限的权证

序号	权证代码	权证名称	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	580016	上汽 CWB1	2007-12-19	2008-1-8	未上市	7.98	9.0857	945,612	7,547,106.88	8,591,546.95
合计									7,547,106.88	8,591,546.95

九、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、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在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资产的公允价值。本系列基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般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。

(1) 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。

①嘉实增长

嘉实增长基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 40%-75%；债券为 20%-55%；现金比例在 5%左右，业绩比较基准为巨潮 500（小盘）指数。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	1,845,484,532.98	64.09%	1,622,158,618.98	66.61%
债券投资	651,529,508.20	22.63%	598,160,111.80	24.56%
衍生金融资产			24,295,484.80	1.00%
合计	2,497,014,041.18	86.72%	2,244,614,215.58	92.17%

本系列基金管理人运用定量分析方法对本系列基金的市场价格风险进行分析。下表为嘉实增长市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
巨潮 500（小盘）指数	+5	91,116,493.87	91,116,493.87
	-5	-91,116,493.87	-91,116,493.87
2006 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
巨潮 500（小盘）指数	+5	102,631,388.00	102,631,388.00
	-5	-102,631,388.00	-102,631,388.00

②嘉实稳健

嘉实稳健基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 40%-75%；债券为 20%-55%；现金比例在 5%左右，业绩比较基准为巨潮 200（大盘）指数。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	27,229,114,996.17	71.46%	4,179,915,462.31	69.01%
债券投资	7,962,609,500.20	20.90%	1,313,370,756.46	21.68%
衍生金融资产	7,180,501.40	0.02%		
合计	35,198,904,997.77	92.38%	5,493,286,218.77	90.69%

本系列基金管理人运用定量分析方法对本系列基金的市场价格风险进行分析。下表为嘉实稳

健市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
巨潮 200 (大盘) 指数	+5	1,864,053,338.84	1,864,053,338.84
	-5	-1,864,053,338.84	-1,864,053,338.84
2006 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
巨潮 200 (大盘) 指数	+5	274,700,553.35	274,700,553.35
	-5	-274,700,553.35	-274,700,553.35

③嘉实债券

嘉实债券基金主要投资于固定收益类金融工具，投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；新股投资比例不超过基金资产总值的 20%，业绩比较基准为：中央国债登记结算公司的中国债券指数。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	585,233,707.85	9.73%	38,136,023.18	10.70%
债券投资	5,283,595,565.72	87.82%	288,372,561.90	80.91%
资产支持证券			5,000,000.00	1.40%
衍生金融资产	8,591,546.95	0.14%		
合计	5,877,420,815.52	97.69%	331,508,585.08	93.01%

本系列基金管理人运用定量分析方法对本系列基金的市场价格风险进行分析。下表为嘉实债券市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
上证指数	+5	41,910,878.59	41,910,878.59
	-5	-41,910,878.59	-41,910,878.59
2006 年 12 月 31 日	增加/减少%	对利润总额的影响	对净值的影响
上证指数	+5	3,019,355.89	3,019,355.89
	-5	-3,019,355.89	-3,019,355.89

(2) 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、存出保证金及债券投资等。

①嘉实增长

下表统计了嘉实增长交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	198,931,613.60				198,931,613.60
结算备付金	3,115,553.94				3,115,553.94
存出保证金	138,549.12			1,111,161.04	1,249,710.16
交易性金融资产	583,126,130.80	68,403,377.40		1,845,484,532.98	2,497,014,041.18
应收证券清算款				167,550,628.76	167,550,628.76
应收利息				8,832,811.13	8,832,811.13
应收申购款	732,070.83			18,834,289.70	19,566,360.53
资产总计	786,043,918.29	68,403,377.40		2,041,813,423.61	2,896,260,719.30
负债					
应付证券清算款				8,911,342.41	8,911,342.41
应付赎回款				1,943,835.46	1,943,835.46
应付管理人报酬				3,384,128.42	3,384,128.42
应交税费				156,140.00	156,140.00
应付托管费				564,021.40	564,021.40
应付交易费用				1,457,373.97	1,457,373.97
其他负债				315,547.33	315,547.33
负债总计				16,732,388.99	16,732,388.99
利率风险敞口	786,043,918.29	68,403,377.40		2,025,081,034.62	2,879,528,330.31

2006 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	311,961,584.60				311,961,584.60
结算备付金	6,029,821.99				6,029,821.99
存出保证金	138,549.12			523,392.65	661,941.77
交易性金融资产	271,500,071.20	326,660,040.60		1,622,158,618.98	2,220,318,730.78
衍生金融资产				24,295,484.80	24,295,484.80
应收证券清算款				175,612,784.00	175,612,784.00
应收利息				5,392,279.32	5,392,279.32
应收申购款				5,618,397.07	5,618,397.07
资产总计	589,630,026.91	326,660,040.60		1,833,600,956.82	2,749,891,024.33
负债					
卖出回购金融资产款	300,000,000.00				300,000,000.00
应付赎回款				8,636,325.30	8,636,325.30
应付管理人报酬				2,956,091.91	2,956,091.91
应付托管费				492,682.00	492,682.00
应付交易费用				1,526,993.70	1,526,993.70
应交税费				134,724.20	134,724.20

应付利息				488,920.00	488,920.00
其他负债				433,637.76	433,6237.76
负债总计	300,000,000.00			14,669,374.87	314,669,374.87
利率风险敞口	289,630,026.91	326,660,040.60		1,818,931,581.95	2,435,221,649.46

下表为嘉实增长利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-926,068.01	-926,068.01
人民币	-25	926,068.01	926,068.01
2006 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-1,954,556.69	-1,954,556.69
人民币	-25	1,954,556.69	1,954,556.69

②嘉实稳健

下表统计了嘉实稳健交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	661,343,367.31				661,343,367.31
结算备付金	36,409,562.06				36,409,562.06
存出保证金	138,549.12			15,430,104.48	15,568,653.60
交易性金融资产	7,197,799,806.80	749,047,439.40	15,762,254.00	27,229,114,996.17	35,191,724,496.37
衍生金融资产				7,180,501.40	7,180,501.40
买入返售金融资产	1,500,001,200.00				1,500,001,200.00
应收证券清算款				829,418,287.14	829,418,287.14
应收利息				154,209,877.98	154,209,877.98
应收申购款	1,061,213.10			31,609,763.95	32,670,977.05
资产总计	9,396,753,698.39	749,047,439.40	15,762,254.00	28,266,963,531.12	38,428,526,922.91
负债					
应付赎回款				242,996,419.24	242,996,419.24
应付管理人报酬				47,151,267.11	47,151,267.11
应付托管费				7,858,544.50	7,858,544.50
应付交易费用				24,523,410.53	24,523,410.53
应交税费				83,274.80	83,274.80
其他负债				1,263,572.64	1,263,572.64
负债总计				323,876,488.82	323,876,488.82
利率风险敞口	9,396,753,698.39	749,047,439.40	15,762,254.00	27,943,087,042.30	38,104,650,434.09

2006 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	441,345,106.92				441,345,106.92
结算备付金	37,479,175.70				37,479,175.70

存出保证金	138,549.12			505,831.07	644,380.19
交易性金融资产	387,137,416.46	926,233,340.00		4,179,915,462.31	5,493,286,218.77
应收证券清算款				130,585,040.31	130,585,040.31
应收利息				11,191,460.16	11,191,460.16
应收申购款				25,558,853.18	25,558,853.18
资产总计	866,100,248.20	926,233,340.00		4,347,756,647.03	6,140,090,235.23
负债					
应付赎回款				68,505,071.95	68,505,071.95
应付管理人报酬				7,289,412.13	7,289,412.13
应付托管费				1,214,902.04	1,214,902.04
应付交易费用				5,393,958.52	5,393,958.52
应交税费				83,274.80	83,274.80
其他负债				610,023.60	610,023.60
负债总计				83,096,643.04	83,096,643.04
利率敏风险敞口	866,100,248.20	926,233,340.00		4,264,660,003.99	6,056,993,592.19

下表为嘉实稳健利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-8,745,466.55	-8,745,466.55
人民币	-25	8,745,466.55	8,745,466.55
2006 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-5,075,204.77	-5,075,204.77
人民币	-25	5,075,204.77	5,075,204.77

③嘉实债券

下表统计了嘉实债券交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	105,769,672.14				105,769,672.14
结算备付金	36,934,424.73				36,934,424.73
存出保证金	-			250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	3,368,180,416.62	1,156,038,735.70	759,376,413.40	585,233,707.85	5,868,829,273.57
衍生金融资产				8,591,546.95	8,591,546.95
买入返售金融资产	300,000,570.00				300,000,570.00
应收利息				65,529,474.54	65,529,474.54
应收申购款	27,536,840.52			16,754,902.34	44,291,742.86
资产总计	3,838,421,924.01	1,156,038,735.70	759,376,413.40	676,359,631.68	6,430,196,704.79
负债					
应付赎回款				113,952,256.18	113,952,256.18
应付管理人报酬				2,812,649.95	2,812,649.95
应付托管费				937,550.00	937,550.00

应付交易费用				408,083.01	408,083.01
应交税费				292,134.56	292,134.56
应付利润				294,909,943.68	294,909,943.68
其他负债				608,674.73	608,674.73
负债总计				413,921,292.11	413,921,292.11
利率风险敞口	3,838,421,924.01	1,156,038,735.70	759,376,413.40	262,438,339.57	6,016,275,412.68

2006 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,916,652.04				19,916,652.04
结算备付金	3,672,698.45				3,672,698.45
存出保证金				250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	117,456,188.89	96,844,549.01	79,071,824.00	38,136,023.18	331,508,585.08
应收证券清算款				973,524.08	973,524.08
应收利息				2,687,968.01	2,687,968.01
应收申购款				4,511,122.87	4,511,122.87
资产总计	141,045,539.38	96,844,549.01	79,071,824.00	46,558,638.14	363,520,550.53
负债					
应付证券清算款				4,121,904.72	4,121,904.72
应付赎回款				2,194,064.73	2,194,064.73
应付管理人报酬				172,112.07	172,112.07
应付托管费				57,370.68	57,370.68
应付交易费用				23,136.25	23,136.25
应交税费				262,688.36	262,688.36
其他负债				271,692.99	271,692.99
负债总计				7,102,969.80	7,102,969.80
利率风险敞口	141,045,539.38	96,844,549.01	79,071,824.00	39,455,668.34	356,417,580.73

下表为嘉实债券利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。

2007 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-24,675,848.81	-24,675,848.81
人民币	-25	24,675,848.81	24,675,848.81
2006 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对利润总额的影响	对净值的影响
人民币	+25	-2,892,230.97	-2,892,230.97
人民币	-25	2,892,230.97	2,892,230.97

(3) 外汇风险

本系列基金/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。

十、其他事项说明

报告期末本基金买断式逆回购交易中取得的债券:无

第七章 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	1,845,484,532.98	63.72%
债券	651,529,508.20	22.49%
权证		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	202,047,167.54	6.98%
其他资产	197,199,510.58	6.81%
合计	2,896,260,719.30	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	137,690,483.02	4.78%
C 制造业	921,902,502.20	32.02%
C0 食品、饮料	149,419,778.88	5.19%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	57,354,287.60	1.99%
C5 电子	4,871,303.90	0.17%
C6 金属、非金属	94,359,310.56	3.28%
C7 机械、设备、仪表	233,683,588.89	8.12%
C8 医药、生物制品	335,310,459.23	11.64%
C99 其他制造业	46,903,773.14	1.63%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	16,071,628.96	0.56%
F 交通运输、仓储业	84,155,239.58	2.92%
G 信息技术业	114,576,685.38	3.98%
H 批发和零售贸易	144,262,488.17	5.01%
I 金融、保险业	288,266,920.79	10.01%
J 房地产业	69,978,102.90	2.43%
K 社会服务业	68,249,063.02	2.37%
L 传播与文化产业	331,418.96	0.01%
M 综合类		
合计	1,845,484,532.98	64.09%

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	5,246,481	149,419,778.88	5.19%
2	600479	千金药业	2,916,036	127,489,093.92	4.43%

3	000423	东阿阿胶	3,813,496	124,167,429.76	4.31%
4	601166	兴业银行	2,330,314	120,850,084.04	4.20%
5	600036	招商银行	2,892,410	114,626,208.30	3.98%
6	002097	山河智能	1,818,210	103,910,701.50	3.61%
7	600583	海油工程	1,625,407	84,651,196.56	2.94%
8	600859	王府井	1,409,814	71,181,508.86	2.47%
9	600761	安徽合力	1,755,644	65,819,093.56	2.28%
10	600588	用友软件	1,279,341	65,335,944.87	2.27%
11	000069	华侨城 A	1,300,057	65,327,864.25	2.27%
12	600383	金地集团	1,555,677	63,471,621.60	2.20%
13	002003	伟星股份	1,543,903	46,903,773.14	1.63%
14	600386	*ST 北巴	1,805,496	42,772,200.24	1.48%
15	002028	思源电气	702,134	41,425,906.00	1.44%
16	600315	上海家化	790,688	38,245,578.56	1.33%
17	000538	云南白药	1,077,974	37,384,138.32	1.30%
18	600118	XR 中国卫	931,908	35,831,862.60	1.24%
19	600713	南京医药	2,245,343	35,745,860.56	1.24%
20	600361	华联综超	910,000	29,611,400.00	1.03%
21	601088	中国神华	442,084	29,005,131.24	1.01%
22	000709	唐钢股份	1,129,854	28,223,752.92	0.98%
23	600000	浦发银行	500,000	26,400,000.00	0.92%
24	601939	建设银行	2,326,520	22,916,222.00	0.80%
25	002080	中材科技	732,852	22,315,343.40	0.77%
26	000960	锡业股份	300,000	19,818,000.00	0.69%
27	600299	星新材料	381,854	18,302,262.22	0.64%
28	600511	国药股份	300,000	17,802,000.00	0.62%
29	002081	金螳螂	277,384	16,071,628.96	0.56%
30	002024	苏宁电器	200,000	14,370,000.00	0.50%
31	600029	南方航空	499,901	13,967,233.94	0.48%
32	601111	中国国航	499,940	13,718,353.60	0.48%
33	600717	天津港	499,907	13,697,451.80	0.48%
34	601699	潞安环能	179,930	12,913,576.10	0.45%
35	000063	中兴通讯	199,907	12,732,076.83	0.44%
36	600150	中国船舶	50,000	12,487,000.00	0.43%
37	600449	赛马实业	529,958	10,721,050.34	0.37%
38	000419	通程控股	499,911	10,448,139.90	0.36%
39	600849	上海医药	745,000	10,266,100.00	0.36%
40	600005	武钢股份	499,921	9,848,443.70	0.34%
41	600582	天地科技	150,000	7,707,000.00	0.27%
42	000402	金融街	229,911	6,506,481.30	0.23%
43	601808	中海油服	187,384	6,434,766.56	0.22%
44	600028	中国石化	199,992	4,685,812.56	0.16%
45	600584	长电科技	200,000	3,482,000.00	0.12%

46	601601	中国太保	70,261	3,474,406.45	0.12%
47	600456	宝钛股份	30,000	2,028,600.00	0.07%
48	002183	怡亚通	20,376	1,588,309.20	0.05%
49	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.04%
50	002202	金风科技	7,355	1,033,009.75	0.04%
51	002182	云海金属	32,956	920,461.08	0.03%
52	002187	广百股份	19,759	849,439.41	0.03%
53	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.03%
54	002177	御银股份	10,305	700,740.00	0.02%
55	002165	红宝丽	10,468	549,046.60	0.02%
56	002201	九鼎新材	15,176	483,659.12	0.02%
57	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.01%
58	002189	利达光电	24,710	363,237.00	0.01%
59	002181	粤传媒	12,422	331,418.96	0.01%
60	002196	方正电机	12,380	301,824.40	0.01%
61	002190	成飞集成	14,098	298,313.68	0.01%
62	002195	海隆软件	8,796	289,036.56	0.01%
63	002166	莱茵生物	8,827	257,836.67	0.01%
64	002167	东方锆业	6,482	257,400.22	0.01%
65	002178	延华智能	10,994	255,060.80	0.01%
66	002188	新嘉联	11,180	239,922.80	0.01%
股票投资合计				1,845,484,532.98	64.09%

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	212,567,733.40	8.73%
2	600036	招商银行	210,597,665.53	8.65%
3	000069	华侨城A	192,786,790.11	7.92%
4	600383	金地集团	124,445,143.27	5.11%
5	000410	沈阳机床	122,347,104.35	5.02%
6	600067	冠城大通	109,327,151.57	4.49%
7	002097	山河智能	102,616,159.44	4.21%
8	600479	千金药业	95,993,261.61	3.94%
9	600675	中华企业	86,024,098.17	3.53%
10	000852	江钻股份	76,448,294.06	3.14%
11	600588	用友软件	75,322,000.77	3.09%
12	000630	铜陵有色	71,813,345.10	2.95%
13	601628	中国人寿	67,707,319.32	2.78%
14	000402	金融街	67,045,581.76	2.75%
15	600761	安徽合力	63,361,732.34	2.60%
16	000002	万科A	56,696,134.97	2.33%
17	600019	宝钢股份	50,545,810.57	2.08%

18	600795	国电电力	48,759,702.55	2.00%
19	601390	中国中铁	47,105,905.45	1.93%
20	600028	中国石化	46,634,475.76	1.91%

(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	600859	王府井	237,015,812.44	9.73%
2	000410	沈阳机床	222,993,023.88	9.16%
3	600036	招商银行	201,118,031.60	8.26%
4	600118	XR 中国卫	201,052,219.05	8.26%
5	600150	中国船舶	196,194,988.16	8.06%
6	601166	兴业银行	185,386,763.12	7.61%
7	000069	华侨城 A	148,650,721.20	6.10%
8	600479	千金药业	144,331,515.95	5.93%
9	002097	山河智能	141,729,184.58	5.82%
10	600067	冠城大通	135,528,443.53	5.57%
11	600713	南京医药	121,099,867.10	4.97%
12	600019	宝钢股份	120,632,413.92	4.95%
13	600383	金地集团	115,416,895.85	4.74%
14	600675	中华企业	108,696,037.94	4.46%
15	000423	东阿阿胶	101,262,463.46	4.16%
16	600583	海油工程	99,470,257.66	4.08%
17	000538	云南白药	94,414,939.12	3.88%
18	601628	中国人寿	90,555,204.01	3.72%
19	000002	万科 A	87,362,557.37	3.59%
20	600161	天坛生物	84,662,701.28	3.48%
21	000777	中核科技	79,600,660.54	3.27%
22	600022	济南钢铁	78,497,401.71	3.22%
23	601390	中国中铁	72,507,747.47	2.98%
24	000852	江钻股份	69,058,253.92	2.84%
25	002024	苏宁电器	66,043,829.65	2.71%
26	000402	金融街	65,039,368.52	2.67%
27	000630	铜陵有色	63,867,850.56	2.62%
28	000718	苏宁环球	62,847,567.10	2.58%
29	600529	山东药玻	61,156,004.05	2.51%
30	601318	中国平安	60,092,456.61	2.47%
31	000848	承德露露	60,061,930.86	2.47%
32	600299	星新材料	58,057,333.78	2.38%
33	000987	广州友谊	56,078,126.39	2.30%
34	600059	古越龙山	55,546,538.60	2.28%
35	600616	第一食品	52,058,896.81	2.14%
36	000709	唐钢股份	50,888,342.01	2.09%
37	600809	山西汾酒	50,597,393.67	2.08%

(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)
3,052,424,301.70	5,011,799,754.35

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	187,476,106.60	6.51%
央行票据	126,355,000.00	4.39%
企业债		
金融债券	298,131,000.00	10.35%
可转换债券	39,567,401.60	1.38%
资产支持证券		
其他		
合计	651,529,508.20	22.63%

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	060301	06 进出 01	178,848,000.00	6.21%
2	010115	21 国债(15)	86,615,344.80	3.01%
3	030301	03 进出 01	69,587,000.00	2.42%
4	009908	99 国债(8)	41,687,455.20	1.45%
5	0701001	07 央行票据 01	29,187,000.00	1.01%

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: 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	1,249,710.16
2	应收证券清算款	167,550,628.76
3	应收利息	8,832,811.13
4	应收申购款	19,566,360.53
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
	合计	197,199,510.58

(4) 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	110236	桂冠转债	12,535,610.00	0.44%

(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	27,229,114,996.17	70.86%
债券	7,962,609,500.20	20.72%
权证	7,180,501.40	0.02%
买入返售证券	1,500,001,200.00	3.90%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	697,752,929.37	1.81%
其他资产	1,031,867,795.77	2.69%
合计	38,428,526,922.91	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	827,355.90	0.00%
B 采掘业	3,869,249,325.24	10.15%
C 制造业	12,060,773,118.57	31.65%
C0 食品、饮料	557,855,615.78	1.46%
C1 纺织、服装、皮毛	29,873,227.86	0.08%
C2 木材、家具	294,202,133.01	0.77%
C3 造纸、印刷	505,193,770.62	1.33%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	2,837,690,801.03	7.45%
C5 电子	2,554,253.90	0.01%
C6 金属、非金属	5,865,857,190.57	15.39%
C7 机械、设备、仪表	1,650,398,771.77	4.33%
C8 医药、生物制品	317,147,354.03	0.83%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	419,215,586.55	1.10%
E 建筑业	459,600,289.70	1.21%
F 交通运输、仓储业	1,819,807,581.19	4.77%
G 信息技术业	2,324,162.99	0.01%
H 批发和零售贸易	421,593,772.31	1.11%
I 金融、保险业	4,056,952,315.54	10.65%
J 房地产业	3,078,507,984.32	8.08%
K 社会服务业	773,580,460.52	2.03%
L 传播与文化产业	331,418.96	0.00%
M 综合类	266,351,624.38	0.70%

合计	27,229,114,996.17	71.46%
----	-------------------	--------

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	000792	盐湖钾肥	35,030,110	2,728,144,966.80	7.16%
2	600036	招商银行	51,401,935	2,037,058,684.05	5.35%
3	601699	潞安环能	25,160,822	1,805,792,194.94	4.74%
4	000002	万科A	45,858,978	1,322,572,925.52	3.47%
5	600019	宝钢股份	70,826,003	1,235,205,492.32	3.24%
6	600569	安阳钢铁	95,824,734	1,150,855,055.34	3.02%
7	000878	云南铜业	19,198,390	1,052,263,755.90	2.76%
8	600348	国阳新能	19,422,704	1,039,503,118.08	2.73%
9	601318	中国平安	9,377,558	994,958,903.80	2.61%
10	600383	金地集团	23,696,157	966,803,205.60	2.54%
11	600660	福耀玻璃	21,908,264	785,630,347.04	2.06%
12	000069	华侨城A	15,300,547	768,852,486.75	2.02%
13	000898	鞍钢股份	24,556,952	741,128,811.36	1.96%
14	601398	工商银行	78,413,283	637,499,990.79	1.67%
15	600004	白云机场	27,471,835	576,359,098.30	1.51%
16	600104	上海汽车	21,868,038	574,910,719.02	1.51%
17	600325	华发股份	13,661,280	498,773,332.80	1.31%
18	600717	天津港	16,797,819	460,260,240.60	1.21%
19	601390	中国中铁	40,000,000	459,600,000.00	1.21%
20	600591	上海航空	25,984,591	453,950,804.77	1.19%
21	600308	华泰股份	14,432,862	414,367,468.02	1.09%
22	000729	燕京啤酒	19,599,214	412,563,454.70	1.08%
23	000983	西山煤电	5,999,810	380,807,940.70	1.00%
24	600694	大商股份	7,616,633	372,301,021.04	0.98%
25	600150	中国船舶	1,327,880	331,624,751.20	0.87%
26	600997	开滦股份	7,400,426	324,878,701.40	0.85%
27	600009	上海机场	8,652,129	324,627,880.08	0.85%
28	600337	美克股份	12,003,351	294,202,133.01	0.77%
29	600276	恒瑞医药	4,983,387	284,252,394.48	0.75%
30	000651	格力电器	5,576,738	275,212,020.30	0.72%
31	601088	中国神华	4,002,140	262,580,405.40	0.69%
32	600795	国电电力	14,521,673	253,257,977.12	0.66%
33	601939	建设银行	25,063,732	246,877,760.20	0.65%
34	600895	张江高科	13,784,363	246,326,566.81	0.65%
35	600720	祁连山	18,804,743	212,493,595.90	0.56%
36	600048	保利地产	2,627,995	170,346,635.90	0.45%
37	000401	冀东水泥	7,854,732	162,985,689.00	0.43%
38	600649	原水股份	7,899,709	158,863,147.99	0.42%
39	000970	中科三环	11,675,265	158,666,851.35	0.42%
40	600875	东方电气	1,709,263	152,124,407.00	0.40%

41	600737	中粮屯河	7,591,022	145,292,161.08	0.38%
42	601601	中国太保	2,842,406	140,556,976.70	0.37%
43	600449	赛马实业	6,795,950	137,482,068.50	0.36%
44	000402	金融街	4,226,215	119,601,884.50	0.31%
45	600585	海螺水泥	1,547,463	112,686,255.66	0.30%
46	600456	宝钛股份	1,499,906	101,423,643.72	0.27%
47	002078	太阳纸业	2,502,102	90,826,302.60	0.24%
48	600089	特变电工	2,544,080	82,250,106.40	0.22%
49	600761	安徽合力	2,171,446	81,407,510.54	0.21%
50	000927	一汽夏利	3,399,517	49,292,996.50	0.13%
51	600331	宏达股份	499,914	40,093,102.80	0.11%
52	600423	柳化股份	1,441,168	38,565,655.68	0.10%
53	600268	国电南自	1,599,885	33,133,618.35	0.09%
54	600521	华海药业	1,270,916	32,637,122.88	0.09%
55	000698	沈阳化工	2,119,847	30,080,628.93	0.08%
56	002029	七匹狼	1,049,991	28,412,756.46	0.07%
57	601808	中海油服	827,000	28,399,180.00	0.07%
58	000987	广州友谊	748,120	27,762,733.20	0.07%
59	600583	海油工程	523,959	27,287,784.72	0.07%
60	600169	太原重工	657,496	23,709,305.76	0.06%
61	600361	华联综超	619,029	20,143,203.66	0.05%
62	600858	银座股份	532,723	20,025,057.57	0.05%
63	000625	长安汽车	999,992	18,759,849.92	0.05%
64	002028	思源电气	249,931	14,745,929.00	0.04%
65	000709	唐钢股份	499,906	12,487,651.88	0.03%
66	601918	国投新集	445,632	7,094,461.44	0.02%
67	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.02%
68	600031	三一重工	100,000	5,704,000.00	0.02%
69	600012	皖通高速	499,952	4,609,557.44	0.01%
70	002183	怡亚通	40,876	3,186,284.20	0.01%
71	002194	武汉凡谷	33,001	1,713,081.91	0.00%
72	002182	云海金属	49,956	1,395,271.08	0.00%
73	002187	广百股份	32,259	1,386,814.41	0.00%
74	002177	御银股份	18,305	1,244,740.00	0.00%
75	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.00%
76	002185	华天科技	40,500	868,320.00	0.00%
77	002154	报喜鸟	24,838	856,911.00	0.00%
78	000960	锡业股份	12,540	828,392.40	0.00%
79	002200	绿大地	16,647	827,355.90	0.00%
80	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.00%
81	002193	山东如意	25,044	603,560.40	0.00%
82	002165	红宝丽	10,468	549,046.60	0.00%
83	002189	利达光电	33,210	488,187.00	0.00%

84	002178	延华智能	19,994	463,860.80	0.00%
85	002188	新嘉联	19,180	411,602.80	0.00%
86	600823	世茂股份	20,000	410,000.00	0.00%
87	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.00%
88	002181	粤传媒	12,422	331,418.96	0.00%
89	002201	九鼎新材	10,176	324,309.12	0.00%
90	002190	成飞集成	14,098	298,313.68	0.00%
91	002166	莱茵生物	8,827	257,836.67	0.00%
92	002167	东方锆业	6,482	257,400.22	0.00%
93	002196	方正电机	9,880	240,874.40	0.00%
94	002195	海隆软件	6,796	223,316.56	0.00%
95	002081	金螳螂	5	289.70	0.00%
股票投资合计				27,229,114,996.17	71.46%

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	000002	万科A	3,640,442,736.96	60.10%
2	600036	招商银行	2,958,443,904.35	48.84%
3	600019	宝钢股份	2,374,459,131.74	39.20%
4	000878	云南铜业	2,302,880,075.27	38.02%
5	000792	盐湖钾肥	1,933,364,138.64	31.92%
6	601699	潞安环能	1,611,644,491.32	26.61%
7	601318	中国平安	1,453,822,127.57	24.00%
8	601398	工商银行	1,332,046,418.33	21.99%
9	600383	金地集团	1,254,761,961.24	20.72%
10	000001	深发展A	1,190,780,903.15	19.66%
11	600348	国阳新能	1,184,487,837.83	19.56%
12	600016	民生银行	1,160,019,433.78	19.15%
13	000898	鞍钢股份	1,040,575,304.53	17.18%
14	000069	华侨城A	972,508,484.10	16.06%
15	600900	长江电力	921,190,487.86	15.21%
16	600569	安阳钢铁	803,229,884.72	13.26%
17	600660	福耀玻璃	777,059,397.21	12.83%
18	600015	华夏银行	773,701,699.19	12.77%
19	600004	白云机场	771,666,976.50	12.74%
20	600104	上海汽车	730,109,363.40	12.05%
21	600887	伊利股份	718,642,449.95	11.86%
22	600795	国电电力	624,770,767.19	10.31%
23	600325	华发股份	594,362,959.77	9.81%
24	600030	中信证券	558,081,148.00	9.21%
25	600591	上海航空	512,340,030.36	8.46%
26	000960	锡业股份	510,514,931.23	8.43%

27	600717	天津港	506,083,487.84	8.36%
28	600308	华泰股份	499,959,047.24	8.25%
29	600000	浦发银行	456,595,539.61	7.54%
30	600694	大商股份	447,222,340.41	7.38%
31	600266	北京城建	408,187,098.15	6.74%
32	000063	中兴通讯	390,504,521.42	6.45%
33	600497	驰宏锌锗	383,717,808.22	6.34%
34	000758	中色股份	372,897,260.86	6.16%
35	000729	燕京啤酒	367,139,857.42	6.06%
36	600048	保利地产	363,385,411.32	6.00%
37	600009	上海机场	360,561,511.49	5.95%
38	601390	中国中铁	338,978,288.70	5.60%
39	600895	张江高科	333,026,874.67	5.50%
40	000651	格力电器	320,417,620.15	5.29%
41	000970	中科三环	319,938,208.01	5.28%
42	600886	国投电力	305,508,245.28	5.04%
43	600150	中国船舶	302,446,184.58	4.99%
44	600337	美克股份	276,645,931.88	4.57%
45	600376	天鸿宝业	275,487,830.58	4.55%
46	601006	大秦铁路	264,156,432.81	4.36%
47	000983	西山煤电	244,470,384.09	4.04%
48	600879	火箭股份	230,866,716.62	3.81%
49	600519	贵州茅台	228,249,414.61	3.77%
50	000858	五粮液	224,743,987.32	3.71%
51	600997	开滦股份	222,633,944.22	3.68%
52	600276	恒瑞医药	216,609,747.08	3.58%
53	000401	冀东水泥	207,273,504.02	3.42%
54	000402	金融街	206,849,659.21	3.42%
55	600600	青岛啤酒	178,100,831.96	2.94%
56	600456	宝钛股份	162,685,196.23	2.69%
57	601939	建设银行	161,661,071.40	2.67%
58	600585	海螺水泥	156,354,781.93	2.58%
59	600875	东方电气	154,813,998.43	2.56%
60	601088	中国神华	148,039,158.60	2.44%
61	600737	中粮屯河	147,594,115.52	2.44%
62	600649	原水股份	143,465,490.71	2.37%
63	600720	祁连山	141,384,453.99	2.33%
64	600309	烟台万华	136,723,807.70	2.26%
65	600361	华联综超	133,120,340.52	2.20%
66	600675	中华企业	131,056,159.76	2.16%
67	000537	广宇发展	127,992,727.55	2.11%

(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	000002	万科A	3,184,443,471.73	52.57%
2	600036	招商银行	2,481,653,524.14	40.97%
3	000878	云南铜业	2,249,253,491.46	37.13%
4	600019	宝钢股份	1,712,537,653.00	28.27%
5	600016	民生银行	1,691,219,905.32	27.92%
6	000001	深发展A	1,474,946,004.68	24.35%
7	600900	长江电力	1,160,657,895.03	19.16%
8	000960	锡业股份	921,735,658.74	15.22%
9	600015	华夏银行	808,183,341.35	13.34%
10	601398	工商银行	749,460,762.12	12.37%
11	000898	鞍钢股份	735,859,341.45	12.15%
12	601318	中国平安	658,255,915.25	10.87%
13	000858	五粮液	656,442,047.66	10.84%
14	600887	伊利股份	651,243,903.47	10.75%
15	000063	中兴通讯	646,282,187.15	10.67%
16	600030	中信证券	573,895,334.67	9.47%
17	600104	上海汽车	510,563,010.45	8.43%
18	600150	中国船舶	509,818,897.04	8.42%
19	600028	中国石化	502,101,873.69	8.29%
20	600000	浦发银行	500,010,817.63	8.26%
21	000758	中色股份	478,180,217.09	7.89%
22	601006	大秦铁路	468,560,378.64	7.74%
23	600266	北京城建	445,327,933.77	7.35%
24	600497	驰宏锌锗	397,702,328.81	6.57%
25	600591	上海航空	381,898,539.22	6.31%
26	000970	中科三环	359,995,258.98	5.94%
27	600009	上海机场	354,227,311.03	5.85%
28	600004	白云机场	352,270,753.42	5.82%
29	601699	潞安环能	343,297,911.62	5.67%
30	600690	青岛海尔	333,995,324.23	5.51%
31	600795	国电电力	323,163,823.59	5.34%
32	000069	华侨城A	312,971,795.06	5.17%
33	601857	中国石油	306,636,374.18	5.06%
34	600519	贵州茅台	298,670,755.78	4.93%
35	600886	国投电力	275,469,513.46	4.55%
36	600348	国阳新能	261,610,239.50	4.32%
37	600879	火箭股份	252,636,265.25	4.17%
38	600376	天鸿宝业	241,681,903.10	3.99%
39	600048	保利地产	225,970,661.73	3.73%
40	600675	中华企业	182,804,219.04	3.02%
41	600361	华联综超	171,527,984.34	2.83%

42	600309	烟台万华	155,035,428.86	2.56%
43	600383	金地集团	154,896,058.84	2.56%
44	600325	华发股份	154,717,688.22	2.55%
45	600600	青岛啤酒	153,545,155.04	2.54%
46	600308	华泰股份	151,166,592.03	2.50%
47	000046	泛海建设	139,392,666.29	2.30%
48	600123	兰花科创	135,349,787.46	2.23%
49	600005	武钢股份	135,035,540.06	2.23%
50	000401	冀东水泥	133,910,252.25	2.21%
51	000012	南玻 A	121,539,729.22	2.01%

(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)
46,854,601,943.32	34,382,271,906.82

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	152,453,007.00	0.40%
金融债	2,031,516,000.00	5.33%
央行票据	5,758,962,000.00	15.11%
企业债	16,606,444.00	0.05%
可转换债券	3,072,049.20	0.01%
资产支持证券		
其他		
合计	7,962,609,500.20	20.90%

6. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券简称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	0701018	07 央行票据 18	961,785,000.00	2.52%
2	0701004	07 央行票据 04	904,704,000.00	2.37%
3	0701081	07 央行票据 81	579,360,000.00	1.52%
4	0701006	07 央行票据 06	486,400,000.00	1.28%
5	0701091	07 央行票据 91	482,550,000.00	1.27%

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	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	580016	上汽 CWB1	7,180,501.40	0.02%

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	15,568,653.60
2	应收证券清算款	829,418,287.14
3	应收利息	154,209,877.98
4	应收申购款	32,670,977.05
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
	合计	1,031,867,795.77

(4) 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	125960	锡业转债	3,072,049.20	0.01%

(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	580013	武钢 CWB1	99,425	230,397.55	被动持有
2	580016	上汽 CWB1	790,308	6,307,596.50	被动持有

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	585,233,707.85	9.10%
债券	5,283,595,565.72	82.17%
权证	8,591,546.95	0.13%
买入返售证券	300,000,570.00	4.67%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	142,704,096.87	2.22%
其他资产	110,071,217.40	1.71%
合计	6,430,196,704.79	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	827,355.90	0.01%
B 采掘业	304,644,716.65	5.06%
C 制造业	10,222,139.78	0.18%
C0 食品、饮料		
C1 纺织、服装、皮毛	362,560.40	0.01%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料		
C5 电子	1,635,251.40	0.03%

C6 金属、非金属	1,244,770.20	0.02%
C7 机械、设备、仪表	6,979,557.78	0.12%
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	7,094,461.44	0.12%
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	56,491,737.12	0.94%
G 信息技术业	2,324,162.99	0.04%
H 批发和零售贸易	849,439.41	0.01%
I 金融、保险业	195,412,750.35	3.25%
J 房地产业		
K 社会服务业	2,921,198.77	0.05%
L 传播与文化产业	4,445,745.44	0.07%
M 综合类		
合计	585,233,707.85	9.73%

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	601857	中国石油	4,504,884	139,471,208.64	2.32%
2	601088	中国神华	2,018,374	132,425,518.14	2.20%
3	601601	中国太保	1,868,323	92,388,572.35	1.54%
4	601939	建设银行	7,034,280	69,287,658.00	1.15%
5	601919	中国远洋	1,324,232	56,491,737.12	0.94%
6	601169	北京银行	1,657,000	33,736,520.00	0.56%
7	601808	中海油服	827,000	28,399,180.00	0.47%
8	601918	国投新集	445,632	7,094,461.44	0.12%
9	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.10%
10	002128	露天煤业	87,837	4,348,809.87	0.07%
11	601999	出版传媒	203,277	4,114,326.48	0.07%
12	002194	武汉凡谷	33,001	1,713,081.91	0.03%
13	002183	怡亚通	20,376	1,588,309.20	0.03%
14	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.02%
15	002182	云海金属	32,956	920,461.08	0.02%
16	002187	广百股份	19,759	849,439.41	0.01%
17	002200	绿大地	16,647	827,355.90	0.01%
18	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.01%
19	002177	御银股份	10,305	700,740.00	0.01%
20	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.01%
21	002189	利达光电	24,710	363,237.00	0.01%
22	002193	山东如意	15,044	362,560.40	0.01%
23	002181	粤传媒	12,422	331,418.96	0.01%
24	002201	九鼎新材	10,176	324,309.12	0.01%
25	002190	成飞集成	14,098	298,313.68	0.01%
26	002178	延华智能	10,994	255,060.80	0.00%

27	002199	东晶电子	9,645	245,947.50	0.00%
28	002196	方正电机	9,880	240,874.40	0.00%
29	002188	新嘉联	11,180	239,922.80	0.00%
30	002195	海隆软件	6,796	223,316.56	0.00%
股票投资合计				585,233,707.85	9.73%

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	601857	中国石油	75,231,562.80	21.11%
2	601088	中国神华	74,659,654.26	20.95%
3	600021	上海电力	74,041,359.60	20.77%
4	601939	建设银行	72,512,706.00	20.34%
5	000024	招商地产	59,010,853.99	16.56%
6	601601	中国太保	56,049,690.00	15.73%
7	600370	三房巷	53,204,990.00	14.93%
8	600488	天药股份	43,422,304.36	12.18%
9	600048	保利地产	42,800,046.00	12.01%
10	600874	创业环保	41,198,667.05	11.56%
11	600795	国电电力	40,065,445.37	11.24%
12	600518	康美药业	29,830,373.28	8.37%
13	600001	邯郸钢铁	29,252,797.87	8.21%
14	600030	中信证券	27,929,369.49	7.84%
15	000488	晨鸣纸业	23,641,836.13	6.63%
16	600143	金发科技	21,929,140.00	6.15%
17	600317	营口港	20,988,347.59	5.89%
18	601169	北京银行	20,712,500.00	5.81%
19	600726	华电能源	19,132,357.90	5.37%
20	000002	万科A	18,552,472.71	5.21%
21	600423	柳化股份	18,358,406.44	5.15%
22	600320	振华港机	15,057,740.32	4.22%
23	601318	中国平安	14,917,156.80	4.19%
24	601328	交通银行	13,154,147.80	3.69%
25	601808	中海油服	12,495,960.00	3.51%
26	601009	南京银行	11,953,040.00	3.35%
27	601919	中国远洋	11,229,487.36	3.15%
28	600398	凯诺科技	11,008,481.00	3.09%
29	601866	中海集运	10,909,760.00	3.06%
30	601918	国投新集	8,353,316.16	2.34%
31	002142	宁波银行	7,539,768.00	2.12%

(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	000024	招商地产	134,267,600.64	37.67%

2	600021	上海电力	76,871,653.00	21.57%
3	600048	保利地产	60,827,306.51	17.07%
4	600370	三房巷	55,502,257.63	15.57%
5	600795	国电电力	51,053,693.68	14.32%
6	600874	创业环保	48,717,679.75	13.67%
7	600488	天药股份	45,729,825.77	12.83%
8	601318	中国平安	44,049,486.39	12.36%
9	601939	建设银行	41,396,638.84	11.61%
10	600030	中信证券	36,884,045.21	10.35%
11	600001	邯郸钢铁	35,785,805.80	10.04%
12	600423	柳化股份	29,543,297.88	8.29%
13	600518	康美药业	27,931,149.94	7.84%
14	600726	华电能源	26,512,436.09	7.44%
15	000488	晨鸣纸业	25,831,618.83	7.25%
16	600317	营口港	22,850,776.84	6.41%
17	600143	金发科技	21,951,833.19	6.16%
18	601328	交通银行	21,923,445.64	6.15%
19	601009	南京银行	20,500,102.17	5.75%
20	601168	西部矿业	20,250,493.41	5.68%
21	000002	万科A	20,211,828.37	5.67%
22	601866	中海集运	18,015,674.28	5.05%
23	002142	宁波银行	16,978,169.18	4.76%
24	601006	大秦铁路	16,091,590.58	4.51%
25	601333	广深铁路	15,573,974.15	4.37%
26	600320	振华港机	14,298,707.20	4.01%
27	601918	国投新集	13,222,258.08	3.71%
28	601998	中信银行	12,095,904.86	3.39%
29	600398	凯诺科技	10,572,382.83	2.97%
30	601166	兴业银行	9,642,178.90	2.71%
31	600087	南京水运	7,957,922.73	2.23%
32	601628	中国人寿	7,531,381.78	2.11%

(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)
1,039,560,885.37	1,107,283,270.11

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	2,081,369,291.30	34.60%
央行票据	611,517,000.00	10.16%
企业债券	710,810,190.20	11.81%
金融债券	1,518,411,000.00	25.24%
可转换债券	361,488,084.22	6.01%

资产支持证券		
其他		
合计	5,283,595,565.72	87.82%

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	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	0701034	07 央行票据 34	436,365,000.00	7.25%
2	019716	07 国债 16	338,708,000.00	5.63%
3	010115	21 国债(15)	316,511,594.40	5.26%
4	009908	99 国债(8)	316,110,369.00	5.25%
5	010210	02 国债(10)	289,954,679.40	4.82%

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	580016	上汽 CWB1	8,591,546.95	0.14%

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	250,000.00
2	应收证券清算款	
3	应收利息	65,529,474.54
4	应收申购款	44,291,742.86
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
	合计	110,071,217.40

(4) 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	31,206,052.00	0.52%
2	125960	锡业转债	69,321,255.66	1.15%
3	128031	巨轮转债	9,143,725.56	0.15%

(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	580013	武钢 CWB1	1,199,599	2,779,830.76	被动持有
2	580014	深高 CWB1	313,560	1,038,784.63	被动持有
3	580015	日照 CWB1	217,140	458,160.91	被动持有

4	580016	上汽 CWB1	945,612	7,547,106.88	被动持有
5	031005	国安 GAC1	166,423	865,965.44	被动持有

第八章 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)	15,796	1,147,715	45,781
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	38,658.10	23,964.75	107,362.65

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		610,643,329.30	27,504,708,270.36	4,915,169,296.03
机构 投资者	持有基金份额	439,191,783.68	820,225,020.38	2,720,212,460.49
	持有基金份额占总份额的比例	71.92%	2.98%	55.34%
个人 投资者	持有基金份额	171,451,545.62	26,684,483,249.98	2,194,956,835.54
	持有基金份额占总份额的比例	28.08%	97.02%	44.66%

三、报告期末本基金管理人从业人员持有本系列基金情况

项目	嘉实增长基金		嘉实稳健基金		嘉实债券基金	
	持有份额 总量(份)	占总份 额比例	持有份额 总量(份)	占总份 额比例	持有份额总 量(份)	占总份 额比例
基金管理人持有本 基金的所有从业人 员	142,979.42	0.0234%	571,145.19	0.0021%	5,552,913.50	0.1130%

第九章 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
报告期内基金总申购份额	299,353,836.69	40,725,573,437.38	9,267,878,859.45
报告期内基金总赎回份额	759,382,208.42	17,829,894,509.40	4,686,841,874.04
报告期期末基金份额总额	610,643,329.30	27,504,708,270.36	4,915,169,296.03

注:嘉实稳健基金报告期内基金总申购份额中包括本基金拆分增加得份额 2,348,644,924.54 份

第十章 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

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

(1) 报告期内, 嘉实增长基金未实施收益分配;

(2) 报告期内, 嘉实稳健基金实施 1 次收益分配, 每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元;

(3) 报告期内, 嘉实债券基金实施 3 次收益分配, 合计每 10 份基金份额派发现金红利 1.60 元。

六、报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度支付给安永华明会计师事务所的审计费 220,000.00 元, 该审计机构已连续 5 年提供审计服务。

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

2. 报告期内通过证券公司专用席位进行的股票、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	2,971,187,808.02	37.87%	2,421,909.66	38.34%
中信证券股份有限公司	1	2,219,601,163.36	28.29%	1,736,852.29	27.50%
东吴证券有限责任公司	1	936,350,947.50	11.94%	765,932.27	12.13%
中信建投证券有限责任公司	1	265,100,917.19	3.38%	217,170.30	3.44%
招商证券股份有限公司	1	389,219,998.30	4.96%	304,565.70	4.82%
渤海证券有限责任公司	1	1,063,932,213.82	13.56%	869,623.29	13.77%
合计	6	7,845,393,048.19	100.00%	6,316,053.51	100.00%

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	37,452,754.00	47.69%
中信证券股份有限公司	1,041,625.00	1.32%
东吴证券有限责任公司	29,016,957.00	36.95%
中信建投证券有限责任公司	3,023,500.00	3.85%
渤海证券有限责任公司	8,000,659.70	10.19%
合计	78,535,495.70	100.00%

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	2,861,000,000.00	74.66%
东吴证券有限责任公司	392,000,000.00	10.23%
中信建投证券有限责任公司	36,000,000.00	0.94%
渤海证券有限责任公司	543,000,000.00	14.17%
合计	3,832,000,000.00	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
中信证券股份有限公司	11,748,885.60	100.00%
合计	11,748,885.60	100.00%

⑤报告期内，本基金减少租用汉唐证券有限责任公司 1 个专用交易席位。

(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	6,259,685,561.71	7.83%	5,132,895.53	7.95%
国泰君安证券股份有限公司	1	10,598,179,874.05	13.25%	8,293,142.21	12.85%
海通证券股份有限公司	1	3,646,221,281.57	4.56%	2,989,364.52	4.63%
中国国际金融有限公司	1	8,332,593,404.77	10.42%	6,832,661.91	10.59%
中国银河证券有限责任公司	1	3,794,013,982.04	4.74%	3,110,900.46	4.82%
申银万国证券股份有限公司	1	17,429,199,700.94	21.79%	13,638,447.71	21.13%

国信证券有限责任公司	1	4,705,265,458.18	5.88%	3,857,986.70	5.98%
湘财证券有限责任公司	1	2,635,182,227.34	3.29%	2,160,838.41	3.35%
中信建投证券有限责任公司	1	10,243,709,518.20	12.81%	8,399,014.29	13.02%
中信证券股份有限公司	1	12,340,437,065.24	15.43%	10,118,375.31	15.68%
合计	10	79,984,488,074.04	100.00%	64,533,627.05	100.00%

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	100.00%
合计	18,120,885.50	100.00%

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	5.68%
海通证券股份有限公司	276,000,000.00	31.36%
中国银河证券有限责任公司	36,000,000.00	4.09%
国信证券有限责任公司	240,000,000.00	27.27%
中信建投证券有限责任公司	128,000,000.00	14.55%
中信证券股份有限公司	150,000,000.00	17.05%
合计	880,000,000.00	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	100.00%
合计	598,242.23	100.00%

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、中信证券股份有限公司 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	844,337,074.57	76.25%	675,097.10	76.26%
联合证券有限责任公司	1	262,946,195.54	23.75%	210,189.89	23.74%
合计	2	1,107,283,270.11	100.00%	885,286.99	100.00%

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	2,472,904,164.40	90.90%	52,846.50	87.30%
联合证券有限责任公司	247,429,322.03	9.10%	7,688.04	12.70%
合计	2,720,333,486.43	100.00%	60,534.54	100.00%

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	33,021,900,000.00	100.00%
合计	33,021,900,000.00	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
中信证券股份有限公司	10,244,752.45	83.38%
联合证券有限责任公司	2,041,617.24	16.62%
合计	12,286,369.69	100.00%

⑤本报告期内，本基金未变更租用的专用交易席位。

九、报告期内本系列基金/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	派发现金红利 0.50 元/10 份
23	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	含本系列基金
24	关于对浦发银行东方卡/活期一本通账户持有人开通嘉实基金网上直销交易业务的公告	2007 年 7 月 4 日	含本系列基金
25	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	含本系列基金
26	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	包括嘉实债券、嘉实增长
27	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	含本系列基金
28	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	含本系列基金
29	关于旗下开放式基金在浦发银行开通柜面基金定期定额投资业务的公告	2007 年 8 月 17 日	含嘉实稳健、嘉实增长
30	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	含本系列基金
31	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	含本系列基金
32	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	含本系列基金
33	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	含本系列基金
34	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	含本系列基金
35	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	工商银行包括嘉实稳健, 中信银行、安信证券、恒泰证券和中原证券包括本系列基金
36	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	含本系列基金

37	嘉实债券证券投资基金 2007 年第二次收益分配公告	2007 年 10 月 11 日	派发现金红利 0.50 元/10 份
38	关于恢复嘉实增长基金申购及转入业务和增加中国工商银行为嘉实增长基金代销机构的公告	2007 年 10 月 11 日	
39	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	含本系列基金
40	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	含本系列基金
41	关于通过中国建设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 11 月 10 日	含嘉实增长、嘉实稳健
42	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	含本系列基金
43	关于增加中国工商银行为嘉实债券、嘉实货币、嘉实超短债基金代销机构的公告	2007 年 11 月 28 日	
44	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	含本系列基金
45	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	含本系列基金
46	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	含本系列基金
47	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	含本系列基金
48	嘉实债券证券投资基金 2007 年第三次收益分配公告	2007 年 12 月 26 日	派发现金红利 0.60 元/10 份

第十一章 备查文件

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；
- 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

2008 年 3 月 28 日