

嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长基金、嘉实稳健基金和嘉实债券基金 2008 年年度报告摘要

(上接 C88 页) 本系列基金的基金管理人于 2008 年度及 2007 年度均未持有本系列基金中的嘉实增长和嘉实稳健基金份额。持有的嘉实债券基金份额如下:

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 期初持有的基金份额, 期间申购/买入总额, 期间赎回/卖出总额, 期末持有的基金份额.

注:(1)期间申购/买入总额含红利再投资、转换份额、期间赎回/卖出总额无转换出份额。(2)基金管理人于 2007 年 2 月 5 日通过本系列基金代认购机构申购嘉实债券基金 1500 万元,申购费为 1000 元;2006 年 8 月 22 日,申购嘉实债券基金 1200 万元,申购费为 1000 元;2006 年 10 月 19 日,申购嘉实债券基金 1000 万元,申购费为 1000 元。

7.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司, 嘉实增长基金, 嘉实稳健基金.

7.4.5 期末关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入 (1) 嘉实增长基金

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司.

注: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,按银行同业利率计息。下同。

7.4.5.1 嘉实稳健基金

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司.

7.4.6 本系列基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内,本系列基金未在承销期内参与关联方承销的证券

7.4.5.1 嘉实增长基金

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司.

7.4.5.2 嘉实稳健基金

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司.

7.4.5.3 嘉实债券基金

Table with 3 columns: Item, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Rows include 中国银行股份有限公司.

7.4.5.4 受限证券情况

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本系列基金未持有因认购新股/增发证券而于期末持有的受限证券

7.4.5.5 暂时停牌股票

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本系列基金未持有暂时停牌股票

7.4.5.6 期末持有正在回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本系列基金中嘉实债券基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 539,123,091.31 元,是以下列债券作为质押:

Table with 3 columns: 债券代码, 债券名称, 期末公允价值, 期末公允价值占基金净资产的比例(%)

7.4.5.7 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本系列基金无从证券交易所债券正回购交易的情况

8 嘉实增长基金

8.1 期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金净资产比例(%)

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期末基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.1.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

8.1.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

注:8.1.4.1 项“买入金额”、8.1.4.2 项“卖出金额”及 8.1.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.1.5 期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券

8.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1.9 投资组合报告附注

8.1.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券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、处罚。

8.1.9.2 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。

8.1.9.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况

8.2 嘉实稳健证券投资基金

8.2.1 期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:(1)报告期内,本基金持有的“蓝月亮牌”市面公允价值比例为 9.9971%,表中数据为保留小数点后两位,四舍五入所致。(2)投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读载于本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期末基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.2.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

注:8.2.4.1 项“买入金额”、8.2.4.2 项“卖出金额”及 8.2.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.2.5 期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

按买入或卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.2.5 期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

期末本基金未持有资产支持证券

8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券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、处罚。

8.2.9.2 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。

8.2.9.3 其他债券投资

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.2.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.2.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 期末公允价值占公允价值比例(%)

8.3 嘉实增长证券投资基金

8.3.1 期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

8.3.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.4 报告期内股票投资组合的重大变动

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 占期末基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的年度报告正文。

8.3.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

注:8.3.4.1 项“买入金额”、8.3.4.2 项“卖出金额”及 8.3.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.3.5 期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

期末本基金未持有资产支持证券

8.3.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.9 投资组合报告附注

8.3.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券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、处罚。

8.3.9.2 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。

8.3.9.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.3.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.3.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 期末公允价值占公允价值比例(%)

8.3.9.6 基金持有人信息

8.3.9.6.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 3 columns: 基金简称, 持有人户数(户), 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

8.3.9.6.2 期末基金管理人的从业人员持有本系列开放式基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总资产比例(%)

8.3.9.6.3 基金管理人所有从业人员持有本系列开放式基金的情况

Table with 3 columns: 基金简称, 基金管理人持有基金份额, 占基金总资产比例(%)

8.3.9.6.4 开放式基金份额变动

Table with 3 columns: 基金简称, 基金份额变动

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议