

嘉实研究精选股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

5.1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其从业人员不得从事内幕交易、操纵市场、不正当关联交易、利益输送、损害基金份额持有人利益等违法违规行为。

5.2 基金简介 2.1 基金基本情况 基金名称: 嘉实研究精选股票型证券投资基金 基金简称: 嘉实研究精选股票(深交所证券简称: 嘉实精选)

2.2 基金产品说明 投资目标: 本基金投资于具有良好成长性的上市公司,以谋求基金资产的长期增值。 投资策略: 本基金采取自上而下的投资策略,在宏观、中观和微观三个层面上进行资产配置。

2.3 基金管理人及基金托管人 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

2.4 信息披露方式 基金管理人网站: www.jsfund.cn 基金年度报告正文的全文披露网站: www.jsfund.cn

5.3 主要财务指标和净值表现 3.1 主要财务指标 3.1.1 期间数据指标 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)

Table with 2 columns: 指标名称 (Indicator Name) and 本报告期 (This Period). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

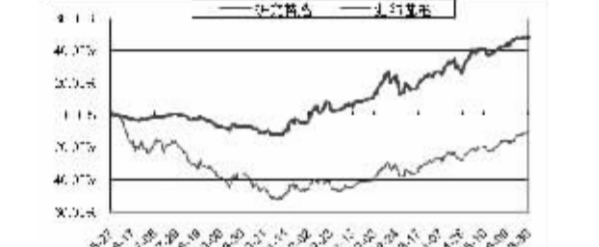
注: 1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。 2. 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较 阶段 份额净值增长率 业绩比较基准收益 绝对收益 ①-②

Table with 5 columns: 阶段 (Period), 份额净值增长率 (Share Net Value Growth Rate), 业绩比较基准收益 (Benchmark Return), 绝对收益 (Absolute Return), ①-② (Difference).

注: 本基金业绩比较基准为沪深300指数*95%+上证国债指数*5%。 本基金的投资范围包括股票、债券、权证、股指期货、货币市场工具等。

3.2.2 本基金合同成立以来的基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较 图: 嘉实研究精选股票基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益的历史走势对比图



注: 本基金合同约定, 本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期, 建仓期结束时本基金的资产组合符合合同约定“十四、基金的投资”(七)“投资组合比例限制”的约定。

5.4 持有人服务 4.1 基金管理人及基金托管人 4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

4.1.2 基金管理人及基金托管人的业务资格 4.1.3 基金管理人及基金托管人的业绩 4.1.4 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.1 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.2 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.3 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.4 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.5 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.6 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.7 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.8 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.9 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.10 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.11 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.12 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.13 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.14 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.15 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.16 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.17 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.18 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.19 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.20 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.21 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.22 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.23 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.24 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.25 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.26 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.27 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.28 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.29 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.30 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.31 基金管理人及基金托管人的其他信息

4.2.32 基金管理人及基金托管人的其他信息 4.2.33 基金管理人及基金托管人的其他信息

报告截止日: 2009年6月30日 单位: 人民币元

Table with 3 columns: 资产 (Assets), 期末 (End of Period), 期初 (Beginning of Period). Rows include 银行存款, 结算备付金, 交易保证金, etc.

6.2 负债 6.2.1 负债 6.2.2 负债

Table with 3 columns: 项目 (Item), 期末 (End of Period), 期初 (Beginning of Period). Rows include 应付证券清算款, 应付赎回款, 应付管理人报酬, etc.

注: 报告截止日2009年6月30日, 基金份额净值1.445元, 基金份额总额2,451,336,124.93份。

6.3 所有者权益 6.3.1 所有者权益 6.3.2 所有者权益

Table with 3 columns: 项目 (Item), 期末 (End of Period), 期初 (Beginning of Period). Rows include 实收基金, 未分配利润, 未实现收益, etc.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资组合的所有股票明细, 应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.4 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细 7.4.1 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述2只股票。 7.4.2 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述12只股票。 7.4.3 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述30只股票。 7.4.4 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述46只股票。 7.4.5 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述57只股票。 7.4.6 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述67只股票。 7.4.7 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

(3) 受限证券类别: 其他 期末(2009年6月30日)本基金未持有流通受限的其他证券。

7.1 投资组合报告 7.1.1 报告期末基金资产组合情况 7.1.2 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (Amount), 占基金总资产比例 (%) (Percentage of Total Assets).

7.2 期末按行业分类的股票投资组合 7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资组合的所有股票明细, 应阅读登载于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.4 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细 7.4.1 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述2只股票。 7.4.2 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述12只股票。 7.4.3 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述30只股票。 7.4.4 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述46只股票。 7.4.5 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述57只股票。 7.4.6 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述67只股票。 7.4.7 累计计入金额超前期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占前期基金资产净值比例 (%) (Percentage of Previous Period Net Asset Value).

47 000027 歌华有线 68,103,966.63 1.14

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

7.4 买入返售金融资产及卖出回购的金融资产 7.4.1 买入返售金融资产及卖出回购的金融资产

Table with 3 columns: 项目 (Item), 期末 (End of Period), 期初 (Beginning of Period). Rows include 买入返售金融资产, 卖出回购金融资产。

注: 7.4.1项“买入金额”、7.4.2项“卖出金额”及7.4.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交金额乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 7.5.1 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 7.6.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注: 报告期末本基金持有上述2只债券。 7.6.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

7.7 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名资产支持证券投资明细 7.7.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名资产支持证券投资明细

7.8 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名权证投资明细 7.8.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名权证投资明细

7.9 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名股指期货投资明细 7.9.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名股指期货投资明细

7.10 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名国债期货投资明细 7.10.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名国债期货投资明细

7.11 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.11.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.12 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.12.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.13 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.13.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.14 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.14.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.15 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.15.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.16 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.16.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.17 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.17.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.18 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.18.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.19 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.19.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.20 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.20.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.21 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.21.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.22 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.22.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.23 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.23.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.24 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.24.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.25 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.25.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.26 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.26.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.27 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.27.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.28 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.28.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.29 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.29.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.30 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.30.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.31 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.31.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细

7.32 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细 7.32.1 报告期末本基金持有的公允价值计量属性为公允价值计量的前十名其他衍生品投资明细