(上接 118 版)

序号	股票简称	股票代码	数量（股）	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	转让受限期限
1	日照港	600017	247,568	1,163,569.60	1,787,440.96	市价	自上市日起锁定3个月	2006.9.28–2007.1.18
2	大秦铁路	601006	549,510	2,720,074.50	4,451,031.00	市价	自上市日起锁定三6个月	2006.7.26–2007.2.1
3	广深铁路	601333	1,783,794	6,707,065.44	12,843,316.80	市价	自上市日起锁定3个月	2006.12.18–2007.3.21
4	北辰实业	601588	269,636	647,126.40	1,801,168.48	市价	自上市日起锁定3个月	2006.9.28–2007.1.16
5	中国人寿	601628	209,475	3,954,888.00	3,954,888.00	成本	自上市日起锁定3个月	2006.12.28–2007.4.9
6	众和股份	002070	44,440	392,849.60	613,272.00	市价	自上市日起锁定3个月	2006.9.20–2007.1.12
7	中材科技	002080	50,455	453,085.90	978,827.00	市价	自上市日起锁定3个月	2006.11.7–2007.2.20
8	金螳螂	002081	36,846	471,628.80	884,304.00	市价	自上市日起锁定3个月	2006.11.6–2007.2.20
9	海鸥卫浴	002084	71,104	570,965.12	1,583,486.08	市价	自上市日起锁定3个月	2006.11.14–2007.2.24
10	鲁阳股份	002088	38,917	428,087.00	1,049,980.66	市价	自上市日起锁定三3个月	2006.11.21–2007.2.28
11	青岛金王	002094	44,790	344,435.10	533,448.90	市价	自上市日起锁定3个月	2006.12.6–2007.3.15
12	网盛科技	002095	17,772	250,407.48	979,592.64	市价	自上市日起锁定3个月	2006.12.6–2007.3.15
13	山河智能	002097	39,070	390,700.00	1,266,258.70	市价	自上市日起锁定3个月	2006.12.12–2007.3.22
	合计			18,494,882.94	32,727,015.22			

（4）流通受限制不能自由转让的债券：无

§8 投资组合报告

8.1 嘉实增长基金

8.1.1 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	1,622,158,618.98	58.99%
债券	598,160,111.80	21.75%
权证	24,295,484.80	0.88%
银行存款及清算备付金合计	317,991,406.59	11.57%
资产支持证券		
其他资产	187,285,402.16	6.81%
资产合计	2,749,891,024.33	100.00%

8.1.2 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	85,801,754.64	3.52%
C 制造业	810,378,511.78	33.28%
C0 食品、饮料	180,124,382.63	7.40%
C1 纺织、服装、皮毛	735,926.40	0.03%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	55,632,893.10	2.28%
C5 电子	611,113.66	0.03%
C6 金属、非金属	154,143,103.18	6.33%
C7 机械、设备、仪表	154,844,995.36	6.36%
C8 医药、生物制品	264,063,023.15	10.84%
C99 其他制造业	223,074.30	0.01%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	23,178,256.56	0.95%
E 建筑业	884,304.00	0.04%
F 交通运输、仓储业	71,708,293.14	2.94%
G 信息技术业	140,558,552.16	5.77%
H 批发和零售贸易	324,964,583.42	13.34%
I 金融、保险业	69,353,709.48	2.85%
J 房地产业	46,392,599.28	1.91%
K 社会服务业	24,447,497.45	1.00%
L 传播与文化产业	24,490,557.07	1.01%
M 综合类		
合计	1,622,158,618.98	66.61%

8.1.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600859	王府井	7,962,141	193,480,026.30	7.95%
2	600118	中国卫星	6,786,864	135,058,593.60	5.55%
3	000848	承德露露	7,379,904	116,454,885.12	4.78%
4	600583	海油工程	2,369,592	82,153,754.64	3.37%
5	000538	云南白药	3,026,516	75,329,983.24	3.09%
6	600713	南京医药	10,850,662	71,180,342.72	2.92%
7	600036	招商银行	3,674,313	60,111,760.68	2.47%
8	000423	S阿 胶	4,375,361	59,898,692.09	2.46%
9	600019	宝钢股份	6,599,980	57,155,826.80	2.35%
10	600361	华联综超	2,465,842	56,936,291.78	2.34%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

（1）报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2％的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600118	中国卫星	141,005,189.27	7.69%
2	600036	招商银行	118,187,385.45	6.45%
3	600151	航天机电	109,083,057.68	5.95%
4	000400	许继电气	104,750,409.67	5.71%
5	600859	王府井	93,786,376.73	5.12%
6	600511	国药股份	65,443,406.80	3.57%
7	600019	宝钢股份	64,846,467.30	3.54%
8	000031	中粮地产	63,864,449.18	3.48%
9	600713	南京医药	62,577,724.15	3.41%
10	601398	工商银行	62,041,638.34	3.38%
11	600088	中视传媒	60,185,367.38	3.28%
12	000423	S阿 胶	59,401,405.26	3.24%
13	600694	大商股份	53,944,912.22	2.94%
14	600271	航天信息	49,765,732.30	2.71%
15	000069	华侨城 A	49,734,972.87	2.71%
16	000758	中色股份	48,187,135.47	2.63%
17	600161	天坛生物	47,748,040.87	2.60%
18	600900	长江电力	47,715,775.38	2.60%
19	000402	金 融 街	47,675,802.42	2.60%
20	600583	海油工程	44,609,912.08	2.43%
21	000729	燕京啤酒	41,073,083.64	2.24%
22	000568	泸州老窖	39,812,107.31	2.17%
23	000002	万 科 A	38,741,510.36	2.11%
24	600590	泰豪科技	38,504,096.32	2.10%
25	600022	济南钢铁	37,757,040.57	2.06%
26	600028	中国石化	37,669,544.07	2.05%
27	600150	沪东重机	37,650,915.30	2.05%
28	000858	五 粮 液	36,598,746.79	2.00%

（2）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2％的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600125	铁龙物流	190,068,091.36	10.37%
2	000538	云南白药	163,539,859.34	8.92%
3	600583	海油工程	141,946,968.93	7.74%
4	000069	华侨城 A	137,158,023.17	7.48%
5	000400	许继电气	126,982,071.44	6.93%
6	000031	中粮地产	126,599,495.52	6.91%
7	600694	大商股份	97,193,972.92	5.30%
8	600036	招商银行	96,673,806.61	5.27%
9	600151	航天机电	90,192,306.71	4.92%
10	600361	华联综超	82,503,961.97	4.50%
11	601398	工商银行	75,020,998.93	4.09%
12	000858	五 粮 液	74,402,304.43	4.06%
13	000402	金 融 街	69,871,779.86	3.81%
14	600271	航天信息	68,278,722.86	3.72%
15	002024	苏宁电器	65,618,894.26	3.58%
16	600436	片仔癀	63,311,351.15	3.45%
17	600438	通威股份	62,803,607.47	3.43%
18	600859	王府井	62,292,947.24	3.40%
19	000617	S济 柴	62,149,152.24	3.39%
20	600739	辽宁成大	60,423,630.87	3.30%
21	600383	金地集团	53,658,687.56	2.93%
22	000758	中色股份	53,463,734.42	2.92%
23	600616	第一食品	51,944,737.24	2.83%
24	600009	上海机场	51,848,225.45	2.83%
25	600028	中国石化	50,650,187.80	2.76%
26	600900	长江电力	50,075,796.41	2.73%
27	000898	鞍钢股份	49,160,215.89	2.68%
28	000568	泸州老窖	48,682,647.94	2.66%
29	600066	宇通客车	47,013,123.67	2.56%
30	000002	万 科 A	45,455,888.66	2.48%
31	000729	燕京啤酒	45,375,086.77	2.48%
32	600019	宝钢股份	44,681,359.29	2.44%
33	000911	南宁糖业	43,671,267.24	2.38%
34	600016	民生银行	40,713,236.41	2.22%
35	600088	中视传媒	39,347,628.10	2.15%
36	600849	上海医药	38,753,470.22	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　单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
2,755,526,028.05	3,890,786,198.71

8.1.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	国债	366,832,832.40	15.06%
2	央行票据	24,520,625.24	1.01%
3	金融债券	194,100,392.96	7.97%
4	企业债券		
5	可转换债券	12,706,261.20	0.52%
6	资产支持证券		
合计		598,160,111.80	24.56%

8.1.6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	20国债⑽	109,641,333.50	4.50%
2	21国债⒂	83,631,798.00	3.43%
3	02国债⒁	64,839,585.00	2.66%
4	03进出 01	59,863,380.00	2.46%
5	06进出 01	59,657,220.00	2.45%

8.1.7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	031001	侨城 HQC1	1,729,216	24,295,484.80	1.00%
合计				24,295,484.80	1.00%

8.1.8 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

8.1.9 投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金其他资产的构成

项 目	期末余额(元)
交易保证金	661,941.77
应收利息	5,392,279.32
应收申购款	5,618,397.07
待摊费用	
应收证券清算款	175,612,784.00
其他应收款	
合计	187,285,402.16

（4）基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	100236	桂冠转债	5,693,033.50	0.23%
2	100795	国电转债	4,230,049.50	0.17%

（5）报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额	类别（被动持有或主动投资）
1	031001	侨城 HQC1	2,180,161	0	被动持有
2	580990	茅台 JCP1	640,490	0	被动持有
3	580996	沪场 JTP1	2,470,287	0	被动持有
4	580997	招行 CMP1	5,134,670	0	被动持有

8.2 嘉实稳健基金

8.2.1 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	4,179,915,462.31	68.08%
债券	1,313,370,756.46	21.39%
权证		
银行存款及清算备付金合计	478,824,282.62	7.79%
资产支持证券		
其他资产	167,979,733.84	2.74%
资产合计	6,140,090,235.23	100.00%

8.2.2 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	2,431,547.64	0.04%
B 采掘业	561,496,939.14	9.27%
C 制造业	1,587,298,939.84	26.20%
C0 食品、饮料	347,234,339.05	5.73%
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		
C5 电子		
C6 金属、非金属	892,841,702.18	14.74%
C7 机械、设备、仪表	331,183,560.77	5.47%
C8 医药、生物制品	15,379,797.77	0.25%
C99 其他制造业	659,540.07	0.01%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	88,777,361.87	1.47%
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	340,675,087.08	5.62%
G 信息技术业	276,772,107.08	4.57%
H 批发和零售贸易	63,445,733.10	1.05%
I 金融、保险业	845,537,665.44	13.96%
J 房地产业	413,480,081.12	6.83%
K 社会服务业		
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	4,179,915,462.31	69.01%

8.2.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600036	招商银行	32,781,934	536,312,440.24	8.85%
2	600019	宝钢股份	56,047,043	485,367,392.38	8.01%
3	600028	中国石化	50,063,684	456,580,798.08	7.54%
4	000002	万 科 A	26,779,798	413,480,081.12	6.83%
5	000858	五 粮 液	14,123,130	322,713,520.50	5.33%
6	600690	青岛海尔	29,689,581	273,737,936.82	4.52%
7	600016	民生银行	25,472,818	259,822,743.60	4.29%
8	600009	上海机场	13,575,099	256,705,122.09	4.24%
9	000063	中兴通讯	6,263,819	244,915,322.90	4.04%
10	000898	鞍钢股份	20,499,557	209,095,481.40	3.45%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

（1）报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2％的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600028	中国石化	528,489,541.52	62.89%
2	600036	招商银行	500,371,376.12	59.55%
3	600019	宝钢股份	465,426,975.91	55.39%
4	600016	民生银行	416,051,013.61	49.51%
5	000002	万 科 A	375,983,769.65	44.74%
6	000063	中兴通讯	277,002,957.78	32.96%
7	000858	五 粮 液	259,181,332.91	30.84%
8	600009	上海机场	245,238,086.31	29.18%
9	601398	工商银行	228,897,124.01	27.24%
10	600900	长江电力	220,204,188.05	26.21%
11	000898	鞍钢股份	189,920,670.00	22.60%
12	600690	青岛海尔	185,904,307.51	22.12%
13	600050	中国联通	149,409,842.13	17.78%
14	600348	国阳新能	106,887,167.53	12.72%
15	601006	大秦铁路	101,494,385.74	12.08%
16	000970	中科三环	97,319,011.50	11.58%
17	600005	武钢股份	90,113,145.32	10.72%
18	600717	天津港	65,484,382.77	7.79%
19	600026	中海发展	65,093,045.77	7.75%
20	600519	贵州茅台	60,887,251.41	7.25%
21	600879	火箭股份	56,041,026.21	6.67%
22	600011	华能国际	51,356,916.65	6.11%
23	000423	S阿 胶	44,654,616.76	5.31%
24	000729	燕京啤酒	44,455,188.32	5.29%
25	600031	三一重工	43,568,133.82	5.18%
26	600122	宏图高科	43,282,622.79	5.15%
27	601111	中国国航	42,304,171.71	5.03%
28	600037	歌华有线	35,730,534.87	4.25%
29	000400	许继电气	34,297,901.75	4.08%
30	600660	福耀玻璃	32,570,181.43	3.88%
31	600859	王府井	32,440,082.43	3.86%
32	000060	中金岭南	32,377,220.93	3.85%
33	000882	华联股份	30,884,680.18	3.68%
34	600123	兰花科创	30,501,151.31	3.63%
35	600585	海螺水泥	28,579,234.32	3.40%
36	000039	中集集团	28,354,690.75	3.37%
37	600688	S上石化	28,339,640.13	3.37%
38	600739	辽宁成大	27,956,776.03	3.33%
39	600320	振华港机	27,598,495.69	3.28%
40	600361	华联综超	25,682,141.22	3.06%
41	600118	中国卫星	24,061,334.56	2.86%
42	600331	宏达股份	23,365,611.26	2.78%
43	600006	东风汽车	22,486,410.26	2.68%
44	601628	中国人寿	22,022,481.60	2.62%
45	600362	江西铜业	21,772,089.74	2.59%
46	000608	阳光股份	20,860,078.82	2.48%
47	000157	中联重科	20,532,666.76	2.44%
48	000878	云南铜业	20,187,558.82	2.40%
49	600489	中金黄金	20,067,820.77	2.39%
50	000069	华侨城 A	19,975,438.42	2.38%
51	000825	太钢不锈	19,740,220.79	2.35%
52	600030	中信证券	19,002,808.70	2.26%
53	600018	上港集团	18,732,844.46	2.23%
54	600855	航天长峰	17,873,780.59	2.13%
55	600150	沪东重机	17,075,458.26	2.03%
56	600418	江淮汽车	17,005,394.31	2.02%

（2）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2％的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600016	民生银行	342,881,635.34	40.80%
2	601398	工商银行	342,750,470.93	40.79%
3	600028	中国石化	266,515,930.26	31.72%
4	000002	万 科 A	212,407,415.84	25.28%
5	600050	中国联通	186,041,541.57	22.14%
6	600036	招商银行	184,237,752.27	21.93%
7	600900	长江电力	181,632,526.38	21.62%
8	000063	中兴通讯	106,517,618.35	12.68%
9	000858	五 粮 液	105,118,742.27	12.51%
10	600019	宝钢股份	94,449,219.23	11.24%
11	600026	中海发展	76,306,635.42	9.08%
12	000069	华侨城 A	73,022,411.72	8.69%
13	600037	歌华有线	71,595,238.34	8.52%
14	600717	天津港	70,327,911.11	8.37%
15	600879	火箭股份	67,038,965.93	7.98%
16	600694	大商股份	66,274,568.88	7.89%
17	600519	贵州茅台	63,026,105.20	7.50%
18	601006	大秦铁路	59,786,643.40	7.11%
19	600011	华能国际	48,036,097.12	5.72%
20	601111	中国国航	45,407,823.89	5.40%
21	000729	燕京啤酒	44,515,358.83	5.30%
22	600018	上港集团	43,913,221.76	5.23%
23	600660	福耀玻璃	43,124,683.73	5.13%
24	600183	生益科技	42,724,012.39	5.08%
25	600859	王府井	40,873,722.45	4.86%
26	600348	国阳新能	40,056,669.53	4.77%
27	000538	云南白药	37,855,919.34	4.51%
28	600739	辽宁成大	37,607,436.09	4.48%
29	600585	海螺水泥	35,918,511.16	4.27%
30	600887	伊利股份	35,715,216.05	4.25%
31	600009	上海机场	35,424,464.12	4.22%
32	000060	中金岭南	35,315,810.10	4.20%
33	600362	江西铜业	34,896,413.86	4.15%
34	000423	S阿 胶	34,347,094.42	4.09%
35	600320	振华港机	32,502,737.85	3.87%
36	600331	宏达股份	30,947,547.34	3.68%
37	000400	许继电气	29,797,899.05	3.55%
38	000039	中集集团	29,590,113.38	3.52%
39	000157	中联重科	28,925,317.37	3.44%
40	600688	S上石化	24,879,195.00	2.96%
41	000878	云南铜业	24,503,432.94	2.92%
42	600118	中国卫星	24,478,446.23	2.91%
43	600000	浦发银行	23,556,169.07	2.80%
44	000825	太钢不锈	23,173,650.80	2.76%
45	600085	同仁堂	22,967,702.97	2.73%
46	600350	山东高速	22,946,002.83	2.73%
47	600489	中金黄金	22,238,084.82	2.65%
48	600150	沪东重机	21,925,829.00	2.61%
49	600006	东风汽车	21,826,993.91	2.60%
50	600642	申能股份	21,777,721.75	2.59%
51	600795	国电电力	20,621,168.93	2.45%
52	600031	三一重工	19,826,756.61	2.36%
53	600122	宏图高科	19,123,980.17	2.28%
54	000608	阳光股份	18,803,927.47	2.24%
55	600361	华联综超	18,545,891.89	2.21%
56	600418	江淮汽车	18,522,044.62	2.20%

（3）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额　单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
5,919,402,163.04	4,070,758,213.17

8.2.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	国债	194,842,425.10	3.22%
2	央行票据	39,256,639.45	0.65%
3	金融债券	1,078,831,304.31	17.80%
4	企业债券		
5	可转换债券	440,387.60	0.01%
6	资产支持证券		
合计		1,313,370,756.46	21.68%

8.2.6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	06国开 18	280,302,990.00	4.63%
2	06国开 27	197,389,663.01	3.26%
3	02国开 19	131,780,930.00	2.18%
4	06国开 20	110,113,860.00	1.82%
5	01国开 09	50,695,100.00	0.84%

8.2.7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细：无

8.2.8 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

8.2.9 投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金其他资产的构成

项目	期末余额(元)
交易保证金	644,380.19
应收证券清算款	130,585,040.31
应收股利	
应收利息	11,191,460.16
应收申购款	25,558,853.18
其他应收款	
待摊费用	
买入返售证券	
合计	167,979,733.84

（4）基金持有的处于转股期的可转换债券明细：无

（5）报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额	类别（被动持有或主动投资）
1	031001	侨城 HQC1	1,095,633	0	被动持有
2	030002	五粮 YGC1	780,000	0	被动持有
3	038004	五粮 YGP1	820,000	0	被动持有
4	580990	茅台 JCP1	828,006	0	被动持有
5	580996	沪场 JTP1	1,095,712	0	被动持有
6	580997	招行 CMP1	5,018,641	0	被动持有

8.3 嘉实债券基金

8.3.1 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	38,136,023.18	10.49%
债券	288,372,561.90	79.33%
权证		
银行存款及清算备付金合计	23,589,350.49	6.49%
资产支持证券	5,000,000.00	1.37%
其他资产	8,422,614.96	2.32%
资产合计	363,520,550.53	100.00%

8.3.2 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		
C 制造业	6,025,273.34	1.69%
C0 食品、饮料		
C1 纺织、服装、皮毛	613,272.00	0.17%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料		
C5 电子		
C6 金属、非金属	3,612,293.74	1.01%
C7 机械、设备、仪表	1,266,258.70	0.36%
C8 医药、生物制品		
C99 其他制造业	533,448.90	0.15%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业	884,304.00	0.25%
F 交通运输、仓储业	23,168,319.76	6.50%
G 信息技术业	979,592.64	0.27%
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业	5,277,364.96	1.48%
J 房地产业	1,801,168.48	0.51%
K 社会服务业		
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	38,136,023.18	10.70%

8.3.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	601333	广深铁路	1,783,794	12,843,316.80	3.60%
2	601006	大秦铁路	1,054,020	8,537,562.00	2.40%
3	601628	中国人寿	209,475	3,954,888.00	1.11%
4	601588	北辰实业	269,636	1,801,168.48	0.51%
5	600017	日照港	247,568	1,787,440.96	0.50%
6	002084	海鸥卫浴	71,104	1,583,486.08	0.44%
7	600036	招商银行	80,836	1,322,476.96	0.37%
8	002097	山河智能	39,070	1,266,258.70	0.36%
9	002088	鲁阳股份	38,917	1,049,980.66	0.29%
10	002095	网盛科技	17,772	979,592.64	0.28%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.4 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二十名的股票明细

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	600037	歌华有线	15,826,410.24	13.00%
2	600177	雅戈尔	14,376,467.18	11.81%
3	600001	邯郸钢铁	10,796,012.36	8.87%
4	000936	华 西 村	9,411,709.49	7.73%
5	600036	招商银行	8,539,824.19	7.01%
6	601006	大秦铁路	7,692,399.00	6.32%
7	601398	工商银行	6,817,200.00	5.60%
8	601333	广深铁路	6,707,065.44	5.51%
9	600317	营口港	5,491,358.21	4.51%
10	600726	华电能源	5,395,444.05	4.43%
11	000301	丝绸股份	5,255,641.83	4.32%
12	600219	南山铝业	4,412,114.88	3.62%
13	601628	中国人寿	3,954,888.00	3.25%
14	600196	复星医药	2,958,686.04	2.43%
15	600795	国电电力	2,366,685.21	1.94%
16	601699	潞安环能	1,314,874.00	1.08%
17	600017	日照港	1,163,569.60	0.96%
18	601991	大唐发电	895,120.00	0.74%
19	601872	招商轮船	864,430.00	0.71%
20	002069	獐 子 岛	784,200.00	0.64%

（2）报告期内累计卖出价值前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	600177	雅戈尔	23,366,810.06	19.19%
2	600037	歌华有线	15,891,682.85	13.05%
3	600001	邯郸钢铁	10,573,264.76	8.69%
4	000936	华 西 村	10,131,109.82	8.32%
5	600036	招商银行	9,224,653.23	7.58%
6	601398	工商银行	7,254,753.50	5.96%
7	600317	营口港	5,447,868.01	4.47%
8	600726	华电能源	5,385,383.34	4.42%
9	000301	丝绸股份	4,988,135.96	4.10%
10	600219	南山铝业	4,279,737.70	3.52%
11	601006	大秦铁路	3,945,721.92	3.24%
12	600795	国电电力	2,605,327.62	2.14%
13	600196	复星医药	2,294,972.20	1.89%
14	002069	獐 子 岛	2,288,477.52	1.88%
15	601699	潞安环能	1,903,391.87	1.56%
16	601872	招商轮船	1,780,307.57	1.46%
17	601991	大唐发电	1,523,888.88	1.25%
18	002067	景兴纸业	1,164,697.49	0.96%
19	600642	申能股份	600,854.79	0.49%
20	002065	东华合创	503,591.05	0.41%

（3）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额　单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
121,073,770.4	116,192,213.19

8.3.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	国债	147,260,185.40	41.32%
2	央行票据	48,654,552.60	13.65%
3	金融债券	55,013,300.00	15.44%
4	企业债券	34,941,500.00	9.80%
5	可转换债券	2,503,023.90	0.70%
6	资产支持证券	5,000,000.00	1.40%
合计		293,372,561.90	82.31%

8.3.6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	06央票 68	29,182,552.60	8.19%
2	06金牛 CP01	28,875,000.00	8.10%
3	02国债⑽	27,752,547.60	7.79%
4	99国债⑻	24,244,532.00	6.80%
5	02国债⑶	21,920,844.00	6.15%

8.3.7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细：无

8.3.8 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

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	119011	吴中 01	50,000	5,000,000.00	1.40%

8.3.9 投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金其他资产的构成

项目名称	期末余额(元)
交易保证金	250,000.00
应收证券清算款	973,524.08
应收股利	
应收利息	2,687,968.01
应收申购款	4,511,122.87
其他应收款	
待摊费用	
买入返售证券	
合计	8,422,614.96

（4）基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	110317	营港转债	13,388.00	0.0038%

（5）报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	成本总额	类别（被动持有或主动投资）
1	580006	雅戈 QCB1	358,209	0	被动持有
2	580992	雅戈 QCP1	2,507,462	0	被动持有
3	580997	招行 CMP1	674,157	0	被动持有

§9 基金份额持有人情况

9.1 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）	13,631	104,567	5,843
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	78,546.82	44,077.28	57,185.06

9.2 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		1,070,671,701.03	4,609,029,342.38	334,132,310.62
机构投资者	持有基金份额	753,406,440.30	520,918,035.49	132,360,806.35
	持有基金份额占总份额的比例	70.37%	11.30%	39.61%
个人投资者	持有基金份额	317,265,260.73	4,088,111,306.89	201,771,504.27
	持有基金份额占总份额的比例	29.63%	88.70%	60.39%

§10 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	1,536,901,368.28	805,081,074.73	118,935,852.38
报告期间基金总申购份额	1,063,500,001.14	5,563,020,988.20	525,984,104.22
报告期间基金总赎回份额	1,529,729,668.39	1,759,072,720.55	310,787,645.98
报告期期末基金份额总额	1,070,671,701.03	4,609,029,342.38	334,132,310.62

§11 重大事件揭示

（一）报告期内未召开本系列基金 / 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. 2006 年 12 月 22 日，基金管理人发布了《关于增聘嘉实稳健证券投资基金基金经理的公告》，增聘忻怡先生任嘉实稳健基金基金经理，与现任基金经理邹唯先生共同管理嘉实稳健基金。

2. 基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

（三）报告期内无涉及本系列基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

（四）报告期内本系列基金 / 基金投资策略未发生改变。

（五）基金收益分配事项

1. 嘉实增长基金：报告期内实施了四次基金收益分配，合计每 10 份基金份额派发现金红利 2.10 元；

2. 嘉实稳健基金：报告期内实施了四次基金收益分配，合计每 10 份基金份额派发现金红利 5.88 元；

3. 嘉实债券基金：报告期内实施了七次基金收益分配，合计每 10 份基金份额派发现金红利 2.20 元。

（六）报告期内本系列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 180,000.00 元，该审计机构已连续 4 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	1,406,597,139.93	21.64%	1,149,943.00	22.04%
中信证券股份有限公司	1	1,398,642,363.46	21.52%	1,094,451.46	20.97%
东吴证券有限责任公司	1	299,136,347.68	4.60%	243,361.94	4.66%
中信建投证券有限责任公司	1	1,181,466,366.52	18.17%	958,161.88	18.36%
汉唐证券有限责任公司	1				
招商证券股份有限公司	1	927,395,131.17	14.27%	725,694.14	13.91%
渤海证券有限责任公司	1	1,287,102,650.29	19.80%	1,047,095.19	20.06%
合计	7	6,500,339,999.05	100.00%	5,218,707.61	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	136,696,483.40	24.55%
东吴证券有限责任公司	3,022,500.00	0.54%
中信建投证券有限责任公司	153,980,178.00	27.65%
渤海证券有限责任公司	263,183,066.90	47.26%
合计	556,882,228.30	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	427,000,000.00	11.44%
东吴证券有限责任公司	330,000,000.00	8.84%
中信建投证券有限责任公司	1,815,000,000.00	48.64%
渤海证券有限责任公司	1,160,000,000.00	31.08%
合计	3,732,000,000.00	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
国泰君安证券股份有限公司	5,257,035.27	36.04%
中信证券股份有限公司	3,842,310.38	26.34%
招商证券股份有限公司	1,961,665.10	13.45%
渤海证券有限责任公司	3,525,839.57	24.17%
合计	14,586,850.32	100%

⑤报告期内，本基金减少租用大鹏证券有限责任公司 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	506,123,666.26	5.13%	414,741.67	5.19%
国泰君安证券股份有限公司	1	1,225,399,757.10	12.42%	958,883.32	12.01%
海通证券股份有限公司	1	1,378,186,367.92	13.97%	1,128,627.19	14.13%
中国国际金融有限公司	1	1,149,522,027.87	11.65%	941,264.77	11.78%
中国银河证券有限责任公司	1	787,015,108.88	7.98%	644,833.00	8.07%
申银万国证券股份有限公司	1	1,322,567,108.66	13.41%	1,034,918.31	12.96%
国信证券有限责任公司	1	2,473,016,218.83	25.07%	2,025,813.30	25.36%
湘财证券有限责任公司	1	1,023,218,002.87	10.37%	838,979.83	10.50%
合计	8	9,865,048,258.39	100.00%	7,988,061.39	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
联合证券有限责任公司	27,182,618.50	11.74%
海通证券股份有限公司	28,047,964.80	12.11%
中国国际金融有限公司	132,593,742.90	57.27%
中国银河证券有限责任公司	28,415,117.20	12.27%
国信证券有限责任公司	10,379,336.50	4.48%
湘财证券有限责任公司	4,924,987.50	2.13%
合计	231,543,767.40	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
海通证券股份有限公司	240,000,000.00	20.24%
中国银河证券有限责任公司	45,000,000.00	3.80%
国信证券有限责任公司	900,500,000.00	75.96%
合计	1,185,500,000.00	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
联合证券有限责任公司	2,401,217.40	9.39%
国泰君安证券股份有限公司	3,771,701.32	14.75%
海通证券股份有限公司	4,370,139.63	17.09%
申银万国证券股份有限公司	15,025,902.87	58.77%
合计	25,568,961.22	100%

⑤本报告期内，本基金新增租用湘财证券有限责任公司 1 个专用交易席位。

（3）嘉实债券基金

①股票交易量及佣金情况

证券公司名称	租用席位数量（个）	股票成交金额(元)	占股票成交总金额比例	佣金	占佣金总量比例
中信证券股份有限公司	1	96,197,083.01	82.69%	116,571.86	86.83%
联合证券有限责任公司	1	20,137,508.67	17.31%	17,688.10	13.17%
合计	2	116,334,591.68	100.00%	134,259.96	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	1,169,301,796.80	96.80%	37,690.30	95.13%
联合证券有限责任公司	38,604,090.23	3.20%	1,930.32	4.87%
合计	1,207,905,887.03	100.00%	39,620.62	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	2,202,100,000.00	100.00%
合计	2,202,100,000.00	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	5,842,210.37	100%
合计	5,842,210.37	100%

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	关于旗下开放式基金开办定期定额投资业务的公告	2006年 1 月 6 日	包括本系列基金
2	关于旗下开放式基金代销机构华夏证券变更为中信建投证券的公告	2006年 2 月 10 日	包括本系列基金
3	关于嘉实成长收益基金、嘉实服务增值基金和嘉实稳健基金暂停申购和转入业务公告	2006年 2 月 23 日	
4	关于旗下开放式基金通过兴业银行开办定期定额投资业务的公告	2006年 2 月 25 日	包括本系列基金
5	关于旗下开放式基金开展促销活动的公告	2006年 3 月 1 日	包括本系列基金
6	关于招商银行参与嘉实旗下开放式基金开展促销活动的公告	2006年 3 月 2 日	包括本系列基金
7	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金分红预告	2006年 4 月 5 日	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券：分别派发现金红利 0.30 元 /10 份、0.40 元 /10 份、0.20 元 /10 份。
8	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金分红公告	2006年 4 月 8 日	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券：分别派发现金红利 0.30 元 /10 份、0.40 元 /10 份、0.20 元 /10 份。
9	关于网上交易开通“北京银行银基通”的公告	2006年 4 月 11 日	所有开放式基金
10	关于旗下开放式基金增加国盛证券代销机构的公告	2006年 4 月 12 日	包括本系列基金
11	关于开通“好易联基金网上交易”的公告	2006年 4 月 24 日	所有开放式基金
12	关于变更公司住所的公告	2006年 4 月 27 日	
13	关于嘉实债券证券投资基金暂停申购和转入业务的公告	2006年 5 月 11 日	
14	关于嘉实增长基金暂停大额申购和转入业务的公告	2006年 5 月 25 日	
15	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金分红公告	2006年 6 月 13 日	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券：分别派发现金红利 0.40 元 /10 份、0.30 元 /10 份、0.20 元 /10 份
16	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券基金 2006 年第三次收益分配公告	2006年 6 月 26 日	嘉实增长、嘉实稳健和嘉实债券：分别派发现金红利 0.80 元 /10 份、0.30 元 /10 份、0.20 元 /10 份
17	关于所管理的部分证券投资基金运用基金财产投资资产支持证券的公告	2006年 6 月 29 日	包括本系列基金
18	关于嘉实增长证券投资基金恢复大额申购和转入业务的公告	2006年 7 月 27 日	2006年 5 月 25 日起暂停
19	关于变更基金泰和、嘉实稳健及嘉实浦安保本基金经理的公告	2006年 8 月 3 日	邹唯任嘉实稳健基金经理
20	关于运用公司固有资金申购嘉实债券证券投资基金的公告	2006年 8 月 18 日	申购嘉实债券基金 1200 万元
21	关于旗下开放式基金通过东北证券开办定期定额投资业务的公告	2006年 8 月 26 日	包括本系列基金
22	嘉实债券证券投资基金 2006 年第四次收益分配公告	2006年 8 月 28 日	
23	关于对中国农业银行金穗卡持有人办理嘉实基金网上交易业务的公告	2006年 9 月 15 日	包括本系列基金
24	嘉实债券证券投资基金 2006 年第五次收益分配公告	2006年 9 月 22 日	
25	关于嘉实成长收益、嘉实增长及嘉实服务基金暂停申购和转入业务的公告	2006年 10 月 26 日	
26	关于嘉实稳健基金 2006 年第四次收益分配预告与暂停申购及转入业务的公告	2006年 10 月 31 日	
27	关于开展嘉实稳健证券投资基金限量促销活动的公告	2006年 10 月 31 日	
28	嘉实稳健证券投资基金 2006 年第四次收益分配公告	2006年 11 月 3 日	
29	关于旗下开放式基金通过国泰君安证券等 13 家代销机构开办定期定额投资业务的公告	2006年 11 月 4 日	包括本系列基金
30	关于嘉实稳健基金提前结束限量促销活动的公告	2006年 11 月 9 日	
31	关于开通中国建设银行龙卡储蓄卡基金网上交易的公告	2006年 11 月 15 日	包括本系列基金
32	关于恢复嘉实稳健证券投资基金申购和转入业务的公告	2006年 11 月 16 日	
33	关于恢复嘉实成长收益、嘉实增长及嘉实服务基金申购和转入业务的公告	2006年 11 月 22 日	
34	嘉实增长基金 2006 年第四次收益分配与嘉实债券基金 2006 年第六次收益分配公告	2006年 11 月 28 日	
35	关于增聘嘉实稳健证券投资基金基金经理的公告	2006年 12 月 22 日	忻怡任嘉实稳健基金经理
36	嘉实债券证券投资基金 2006 年第七次收益分配公告	2006年 12 月 27 日	

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400–600–8800、(010)65185566，或发电子邮件，E–mail：service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2007 年 3 月 31 日