

嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金

2007年第一季度报告

§1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

§2 基金产品概况 (1)基金名称 嘉实浦安保本(深交所净值显示简称:嘉实保本) (2)基金代码 070007 (深交所净值显示代码:160707)

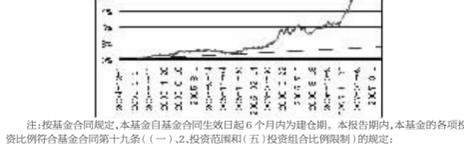
(3)基金运作方式 契约型开放式 (4)基金合同生效日 2004年12月1日 (5)报告期末基金份额总额 249,790,519.65份 (6)投资目标 运用投资组合保险技术,力争在保本到期日,保证投资本金安全的同时,谋求基金资产的增值。

(7)投资策略 在保本周期内,按照固定比例投资组合保险机制,动态调整股票、债券投资比例... (8)业绩比较基准 保本周期内前3年定期存款利率加上同期活期存款利率

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:元 序号 主要财务指标 2007年1月1日至2007年3月31日

3.2 基金净值表现 (1)报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同约定,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符合基金合同第十九条(一)、2.投资范围和(五)投资组合比例限制的规定;



(1)持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(3)基金财产参与股票发行申购,本基金所申购的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

§4 管理人报告 4.1 基金经理情况介绍 邹唯先生,硕士研究生,5年证券从业经历。曾任职于长城证券研发中心,2003年6月进入嘉实基金管理有限公司研究工作,2006年8月至今任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明 报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金合同》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。

4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现 (1)行情回顾及运作分析 报告期内,宏观经济运行大幅超越市场预期,贷款增速达到2004年宏观调控以来的新高,贸易顺差持续扩大,投资增速保持高位,宏观经济活动以及市场流动性空前推动通胀中枢前移。

4.4 基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.345元,本报告期基金份额净值增长率为8.04%,业绩比较基准收益率为0.73%。

§5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition as of the end of the reporting period. It lists categories like Stocks (99,264,332.62), Bonds (232,240,460.00), and Cash (1,023,254.59).

5.2 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 2,095,627.00 0.26%

5.3 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 600899 王府井 39,980 9,997,984.80 27.1%

§6 开放式基金资产净值及基金份额持有人情况 截至本报告期末,本基金资产净值为1,345,000,000.00元,基金份额持有人总数为1,234,567,890人。

§7 基金管理人承诺 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,不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

§8 基金托管人承诺 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

§9 基金份额持有人承诺 基金份额持有人承诺遵守基金合同,按时缴纳基金款项,并承担基金投资风险。

§10 基金销售机构 本基金的销售机构包括:嘉实基金管理有限公司直销中心,以及各大商业银行、证券公司、信托公司等代销机构。

§11 基金管理人联系方式 嘉实基金管理有限公司 北京经济技术开发区景研二街1号 邮编:100176 电话:400-888-888

§12 基金管理人网址 嘉实基金官方网站:www.jsfund.cn

§13 基金管理人承诺 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,不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

§14 基金托管人承诺 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

§15 基金份额持有人承诺 基金份额持有人承诺遵守基金合同,按时缴纳基金款项,并承担基金投资风险。

§16 基金销售机构 本基金的销售机构包括:嘉实基金管理有限公司直销中心,以及各大商业银行、证券公司、信托公司等代销机构。

§17 基金管理人联系方式 嘉实基金管理有限公司 北京经济技术开发区景研二街1号 邮编:100176 电话:400-888-888

§18 基金管理人网址 嘉实基金官方网站:www.jsfund.cn

§19 基金管理人承诺 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,不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

§20 基金托管人承诺 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

§21 基金份额持有人承诺 基金份额持有人承诺遵守基金合同,按时缴纳基金款项,并承担基金投资风险。

§22 基金销售机构 本基金的销售机构包括:嘉实基金管理有限公司直销中心,以及各大商业银行、证券公司、信托公司等代销机构。

§23 基金管理人联系方式 嘉实基金管理有限公司 北京经济技术开发区景研二街1号 邮编:100176 电话:400-888-888

§24 基金管理人网址 嘉实基金官方网站:www.jsfund.cn

§4 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 81,659,960.00 24.30%

§5 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 040215 04国开15 56,363,000.00 16.47%

§6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证明细:无 §7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

§8 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。

§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。

§10 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。

§11 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。

§12 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。

§13 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。

§14 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。

§15 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。

§16 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。

§17 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。

§18 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。

§19 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。

§20 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。

§21 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。

§22 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。

§23 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。

§24 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。

§25 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。

§26 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。

§27 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。

§28 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。

§29 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。

§30 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。

§31 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。

§32 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。

§33 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。

§34 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。

§35 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。

嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)

2007年第一季度报告

§1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

§2 基金产品概况 (1)基金名称 嘉实300 (2)基金代码 160706 (3)基金运作方式 上市契约型开放式

(4)基金合同生效日 2006年8月29日 (5)报告期末基金份额总额 5,330,801,167.66份 (6)投资目标 本基金投资于被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争跟踪沪深300指数净值增长率,并超越业绩比较基准之内的日均跟踪误差小于0.3%,以实现沪深300指数的有效跟踪,谋求通过中国证券市场分享中国经济持续增长、快速发展的成果。

(7)投资策略 本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重配置指数化投资组合。 (8)业绩比较基准 沪深300指数增长率×95%+银行同业存款收益率×5%

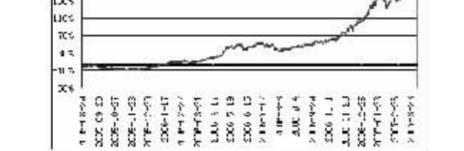
(9)风险收益特征 本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.3%。 (10)基金管理人 嘉实基金管理有限公司 (11)基金托管人 中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:元 序号 主要财务指标 2007年1月1日至2007年3月31日

3.2 基金净值表现 (1)报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金属于上市开放式基金(LOF),报告期内进行了两次分红,如采用基金份额净值登记日收盘后净值方式,并按照上表“过去三个月净值增长率”的计算公式,本基金过去三个月参考累计净值增长率为31.11%。

注:本基金属于上市开放式基金(LOF),报告期内进行了两次分红,如采用基金份额净值登记日收盘后净值方式,并按照上表“过去三个月净值增长率”的计算公式,本基金过去三个月参考累计净值增长率为31.11%。



§4 管理人报告 4.1 基金经理情况介绍 杨宇先生,南开大学经济学硕士,8年证券从业经历。曾任担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理兼基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司,2005年8月至今任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明 报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现 (1)行情回顾及运作分析 报告期内,本基金日均跟踪误差为0.18%,年化度拟合偏差率为2.85%,符合基金合同约定的年度化跟踪误差率不超过3%的限制。在沪深300指数持续走高的高推推动下,本基金越来越得到投资者的认同,报告期内本基金规模大幅增加。

4.4 基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.113元,本报告期基金份额净值增长率为27.76%,业绩比较基准收益率为34.34%。

§5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition as of the end of the reporting period. It lists categories like Stocks (5,582,637,003.04), Bonds (199,180,792.61), and Cash (203,679,087.40).

5.2 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 2,795,686.60 0.05%

5.3 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 600088 中铝国际 14,226,244 287,252,120.72 41.7%

§6 开放式基金资产净值及基金份额持有人情况 截至本报告期末,本基金资产净值为5,985,911,167.66元,基金份额持有人总数为1,234,567,890人。

§7 基金管理人承诺 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,不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

§8 基金托管人承诺 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

嘉实服务增值行业证券投资基金

2007年第一季度报告

§1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

§2 基金产品概况 (1)基金名称 嘉实服务增值行业基金(深交所净值显示简称:嘉实服务) (2)基金代码 070006 (深交所净值显示代码:160706)

(3)基金运作方式 契约型开放式 (4)基金合同生效日 2004年4月1日 (5)报告期末基金份额总额 2,150,987,411.31份 (6)投资目标 在全面评估证券市场风险的前提下,追求超越业绩比较基准,在追求长期增值的基础上,力争取得短期收益。

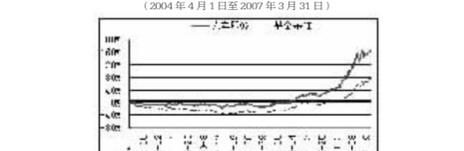
(7)投资策略 在全面评估证券市场风险的前提下,追求超越业绩比较基准,在追求长期增值的基础上,力争取得短期收益。 (8)业绩比较基准 投资基准指数×中债综合指数×90%+中债国债指数×10%

(9)风险收益特征 本基金属于中高风险证券投资基金。 (10)基金管理人 嘉实基金管理有限公司 (11)基金托管人 中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:元 序号 主要财务指标 2007年1月1日至2007年3月31日

3.2 基金净值表现 (1)报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效以来,本基金资产净值的变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的变动比较图: 嘉实服务增值行业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 (2004年4月1日至2007年3月31日)



注:按基金合同约定,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符合基金合同第十八条(二)投资范围和(六)投资组合比例限制的规定;

(1)在正常市场情况下,本基金资产配置的比重范围:股票资产25%-95%,债券资产0%-70%;现金或到期日在一年以内的债券资产不低于基金资产净值的5%。其中,基金投资于服务增值行业的资产不低于基金资产净值的30%。(2)持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%。(3)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%。(4)法律法规规定的

其他限制。 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,但在10个工作日内进行调整,并符合相应的规定。

§4 管理人报告 4.1 基金经理情况介绍 尹丹女士,上海交通大学管理科学与工程专业,CPA,5年证券从业经历。2001年4月至2003年10月任招商证券股份有限公司证券投资部副经理,2003年10月至2006年1月任平安平衡基金基金经理,2005年9月至2006年9月任诺安平衡基金基金经理,2006年12月至2006年9月任诺安服务增值基金基金经理。2006年9月至今任嘉实基金管理有限公司,2006年12月至今任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明 报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现 (1)行情回顾及运作分析 报告期内,表现最好的市场指数是深综指和沪深300指数,分别上涨了50%和36%,涵盖了绝大多数基金。从可投资的私募信托的1季度业绩来看,公募业绩的组合没有取得明显的超额收益,这个现象一方面说明国内资金的紧张,另一方面说明绝大多数机构对一季度行情持相对谨慎的态度,提前锁定了现金仓位的选择。市场发展到这个阶段,不妨用行为金融学角度解释这一现象——当绝大多数机构投资者在一家机构的快速建仓向思维降低仓位避险的时候,也不免变成大众行为而成为被逆向思维的牺牲品。

4.4 基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为2.395元,本报告期基金份额净值增长率为22.90%,业绩比较基准收益率为20.94%。

§5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition as of the end of the reporting period. It lists categories like Stocks (4,641,807,909.28), Bonds (240,207,790.50), and Cash (172,343,683.71).

5.2 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 2,795,686.60 0.05%

5.3 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 600899 王府井 13,829,770 370,084,645.20 7.18%

§4 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 199,582,960.00 3.87%

§5 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 060305 06进出05 119,932,300.00 2.33%

§6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证明细:无 §7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

§8 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。

§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。

§10 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。

§11 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。

§12 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。

§13 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。

§14 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。

§15 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。