嘉实超短债证券投资基金 2007年半年度报告摘要

§1 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。本半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2007年8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基金的招募说明书。

本报告期为2007年1月1日起至2007年6月30日止,本报告财务资料未经审计。本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本资料

(1)基金名称	嘉实超短债证券投资基金
(2)基金简称	嘉实超短债
(3)基金交易代码	070009(深交所净值揭示代码:160708)
(4)基金运作方式	契约型开放式
(5)基金合同生效日	2006年4月26日
(6)报告期末基金份额总额	463,644,248.50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

2.2 基金产品说明

(1)投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本金稳妥,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。
(2)投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面,将基金的大部分资产投资于货币市场工具,保持基金资产的高流动性,同时提供稳定的收益;另一方面,通过价值挖掘,将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具,为基金资产提供超额收益。
(3)业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率。
(1)投资目标	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金,低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

2.3 基金管理人

(1)名称	嘉实基金管理有限公司
(2)信息披露负责人	胡勇钦
(3)联系电话	(010)65188866
(4)传真	(010)65185678
(5)电子邮箱	service@jsfund.cn

2.4 基金托管人

(1)名称	中国银行股份有限公司
(2)信息披露负责人	宁敏
(3)联系电话	(010)66594977
(4)传真	(010)66594942
(5)电子邮箱	tgxxpl@bank-of-china.com

2.5 信息披露

(1)信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》
(2)登载半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
(3)基金半年度报告置备地点	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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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。

3.1 主要财务指标 单位:元

序号	项目	2007年1月1日至2007年6月30日
1	基金本期净收益	7,608,319.59
2	基金份额本期净收益	0.0133
3	期末可供分配基金份额收益	0.0009
4	期末基金资产净值	464,053,199.77
5	期末基金份额净值	1.0009
6	本期基金份额净值增长率	1.37%

注:本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

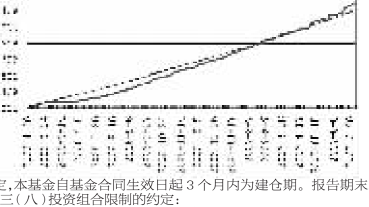
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.31%	0.02%	0.20%	0.01%	0.11%	0.01%
过去三个月	0.74%	0.01%	0.58%	0.01%	0.16%	0.00%
过去六个月	1.37%	0.01%	1.08%	0.01%	0.29%	0.00%
过去一年	2.43%	0.01%	2.07%	0.01%	0.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.01%	2.40%	0.01%	0.20%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较

图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2007年6月30日)



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。报告期末本基金的各项投资比例已符合基金合同十三(八)投资组合限制的约定:

(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年;(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%,投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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,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资格和QDII资格。2005年公司引入新股东德意志资产管理(亚洲)有限公司,成为中外合资基金管理公司。

截止2007年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、11只开放式证券投资基金,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、嘉实浦安保本基金、嘉实货币市场基金、嘉实300指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金和嘉实策略增长基金,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。

4.1.2 基金经理简介

郭林军先生,数量经济学硕士,5年证券从业经历。曾就职于中信证券金融产品开发小组从事债券研究。2002年9月加入嘉实基金管理有限公司,先后从事债券交易、债券研究、基金经理助理等工作,2006年4月至今任本基金基金经理。

吴洪坚先生,清华大学工学硕士,4年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心(上海),从事人民币固定收益投资及交易等工作。2005年加入嘉实基金管理有限公司固定收益部工作,任嘉实货币市场基金基金经理助理职务,2006年10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

在报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及其他有关法律法规、规章、行业监管规则和《嘉实超短债证券投资基金基金合同》的规定和约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末本基金份额净值为1.0009元,本报告期基金份额净值增长率为1.37%,同期业绩比较基准增长率为1.08%。

报告期内,宏观经济保持了较快的发展速度,也直接导致了债券收益率水平的大幅上升。首先,为了控制商业银行的流动性,降低商业银行的信贷冲动,控制固定资产投资增长偏快的状况,央行四次调高了存款准备金率,两次调高存贷款利率,并多次发行定向央票,并辅之以巨量的央票发行,这些政策直接导致了债券收益率的上升;其次,居民消费价格从今年二季度开始小幅攀升,6月份达到同比增长4.4%,大大改变了投资者对债券市场短期乃至中长期走势的看法;第三,巨量特别国债的发行事宜,投资者预期未来长期债券的供给增加,并将极大地吸收流动性;第四,股票市场在上半年大幅上涨,降低了债券市场的吸引力,分流了部分债券市场的投资资金。这些因素导致债券市场在二季度出现了大幅下跌,中国债券总指数上半年下跌2.64%,其中二季度下跌了2.47%,债券收益率曲线陡峭化上升。

基于对紧缩政策的预期,报告期内本基金保持较短的组合久期,组合资产受到的负面影响较小。同时适当调整类属资产配置比例,提高受升息影响较小的资产比如浮息债的配置比例,进一步降低收益率上升和升息的影响。同时调整组合的期限结构,减持了较多的中长期债券,短期债券期限结构尽量保持均衡。通过上面的积极运作,本基金净值在上半年保持了稳定增长的态势。

4.4 宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

从目前状况来看,尽管已经出台了一系列的调控政策,但是高额盈利支撑下的企业投资冲动仍然存在,商业银行流动性仍旧充足,而预期居民消费价格在今年第三季度仍将保持高位。在"遏制经济增长转为过热"的政策指引下,央行货币政策仍将适度从紧,后续仍将有一系列的紧缩政策出台,债券市场走势仍不容乐观。

因此下半年,本基金仍将在高度的政策警惕下谨慎操作,保持组合适度的久期,提高持有资产的安全边际,尽量规避紧缩政策对组合的影响。在基金管理人强大信用分析的支持下,继续保持一定的企业债(短期融资券)投资比例。关注物价指数的变化,在物价趋于平稳时,适当提高组合久期,力争提高组合收益,为基金份额持有人提供稳健的收益回报。

§5 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")在对嘉实超短债证券投资基金(以下称"本基金")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,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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。

§6 财务会计报告

6.1 基金会计报表

以下各项除特别注明外,金额单位为人民币元。

6.1.1 资产负债表

项目	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资 产			
银行存款		53,462,569.57	35,221,648.57
清算备付金		107,390.81	69,560.70
交易保证金			
应收证券清算款			
应收股利			
应收利息	5.2.4(1)	2,748,583.53	4,356,086.49
应收申购款		7,238,925.04	1,268,952.64
其他应收款			
股票投资市值			
其中:股票投资成本			
债券投资市值		387,925,698.23	980,549,986.67
其中:债券投资成本		387,925,698.23	980,564,257.06
权证投资市值			
其中:权证投资成本			
买入返售证券		162,900,000.00	
待摊费用	5.2.4(2)	32,508.24	32,432.50
其他资产			
资产合计		614,415,675.42	1,021,498,667.57
负债与持有人权益			
负 债			
应付证券清算款		140,001,575.04	
应付赎回款		9,580,548.97	1,125,238.80
应付转换费		116,890.09	7,678.75
应付管理人报酬		165,926.90	310,905.39
应付托管费		56,657.97	106,162.83
应付销售费		101,174.93	189,576.45
应付佣金			
应付利息			73,996.69
应付收益			
未交税金			
其他应付款	5.2.4(5)	274,211.06	301,149.71
卖出回购证券款			186,600,000.00
短期借款			
预提费用	5.2.4(6)	65,490.69	130,012.68
其他费用			
负债合计		150,362,475.65	188,844,721.30
持有人权益			
实收基金	5.2.4(7)	463,644,248.50	832,209,279.96
未实现利得	5.2.4(8)	−3,295.63	7,817.22
未分配收益		412,246.90	436,849.09
持有人权益合计		464,053,199.77	832,653,946.27
负债及持有人权益总计		614,415,675.42	1,021,498,667.57
附注:基金份额资产净值		1.0009	1.0005

6.1.2 经营业绩表及收益分配表

(1)经营业绩表

项 目	附注	本期	2006年4月26日至2006年6月30日
收 入			
股票差价收入			
债券差价收入	5.2.4(10)	1,077,618.43	−3,657,684.79
债券利息收入		9,296,367.57	19,854,110.67
存款利息收入		89,138.41	748,484.44
股利收入			
买入返售证券收入		1,126,117.01	1,449,317.86
权证差价收入			
其他收入			146.70
收入合计		11,589,241.42	18,394,374.88
费 用			
基金管理人报酬		1,171,629.11	3,471,282.93
基金托管费		400,068.47	1,185,316.11
销售费用		714,407.92	2,116,636.02
卖出回购证券支出		1,480,421.07	2,093,508.67
其他费用	5.2.4(13)	214,395.26	195,707.42
其中:信息披露费		80,844.37	20,841.38
审计费用		44,630.98	26,400.00
费用合计		3,980,921.83	9,062,451.15
基金净收益		7,608,319.59	9,331,923.73
加:未实现估值增值变动数		14,270.39	72,741.51
基金经营业绩		7,622,589.98	9,404,665.24

(2)收益分配表

项目	附注	本期	2006年4月26日至2006年6月30日
基金净收益		7,608,319.59	9,331,923.73
加:期初基金净收益		436,849.09	
加:本期申购基金份额的损益平准金		1,479,849.38	684,706.97
减:本期赎回基金份额的损益平准金		2,015,411.19	−4,217,286.84
可供分配基金净收益		7,509,606.87	5,799,343.86
减:本期已分配基金净收益		7,097,359.97	5,286,393.14
未分配基金净收益		412,246.90	512,950.72

6.1.3 基金净值变动表

项目	附注	本期	2006年4月26日至2006年6月30日
一、期初基金净值		832,653,946.27	6,146,255,272.70
二、本期经营活动			
基金净收益		7,608,319.59	9,331,923.73
未实现估值增值/(减值)变动数		14,270.39	72,741.51
经营活动产生的基金净值变动数		7,622,589.98	9,404,665.24
三、本期基金份额交易			
基金申购款		1,060,701,260.01	621,677,324.44
其中:分红再投资		4,510,619.14	3,185,510.20
基金赎回款		−1,429,827,236.52	−4,061,393,002.23
基金份额交易产生的基金净值变动数		−369,125,976.51	−3,439,715,677.79
四、本期向持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		−7,097,359.97	−5,286,393.14
五、期末基金净值		464,053,199.77	2,710,657,867.01

6.2 半年度会计报表附注

6.2.1 会计政策、会计估计及其变更

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

6.2.2 重大会计差错内容和更正金额

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.2.3 关联方关系及关联方交易

6.2.3.1 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	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	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
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

6.2.3.2 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

本报告期本基金未通过关联方交易席位进行证券交易。

(2)关联方报酬

① 基金管理费

支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.41%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值 × 0.41% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费1,171,629.11元(2006年4月26日基金合同生效日至2006年6月30日:3,471,282.93元)。

② 基金托管费

支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.14%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 ×0.14% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费400,068.47元(2006年4月26日基金合同生效日至2006年6月30日:1,185,316.11元)。

③ 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给嘉实基金管理有限公司,再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金持续销售费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。本基金在本会计期间需支付基金销售服务费714,407.92元(2006年4月26日基金合同生效日至2006年6月30日:2,116,636.02元)。

本基金需支付给各关联方的销售服务费

关联方名称	本期	2006.4.26-2006.6.30
嘉实基金管理有限公司	89,434.44	141,185.65
中国银行股份有限公司	467,664.92	1,218,602.40
中诚信托投资有限公司	-	-
立信投资有限公司	-	-
合计	557,099.36	1,359,788.05

(3)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

项目	本期	2006年4月26日至2006年6月30日
回购成交金额	1,039,640,000.00	5,251,400,000.00
回购利息收入		107,890.41
回购利息支出	189,652.66	979,323.10
债券成交金额	251,996,470.83	2,018,264,789.46

(4)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款和结算备付金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。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为53,462,569.57元(2006年6月30日:29,538,944.17元)。期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为84,223.87元(2006年4月26日基金合同生效日至2006年6月30日:742,756.50元)。

(5)关联方投资本基金情况

关联方名称	2007年6月30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	20,325,446.74	4.38%	20,325,446.74	2.44%
合计	20,325,446.74	4.38%	20,325,446.74	2.44%

(6)报告期末基金管理人基金从业人员持有本基金情况:无

6.2.4 报告期末流通转让受到限制的基金资产:无

§7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	387,925,698.23	63.14%
买入返售证券	162,900,000.00	26.51%
其中:买断式回购的买入返售证券		
银行存款和清算备付金合计	53,569,960.38	8.72%
资产支持证券		
其他资产	10,020,016.81	1.63%
合计	614,415,675.42	100%

7.2 报告期末债券投资组合

7.2.1 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券		
2	金融债券	149,712,068.02	32.26%
	其中:政策性金融债	149,712,068.02	32.26%
3	央行票据		
4	企业债券	238,213,630.21	51.34%
5	资产支持证券		
合计		387,925,698.23	83.60%

7.2.2 基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值的比例
1	050406	05农发06	60,020,729.07	12.93%
2	0781020	07张江CPO1	40,181,936.92	8.66%
3	0781098	07金融街CP01	40,103,105.41	8.64%
4	0681190	06湘有色CP01	40,026,105.53	8.63%
5	010210	01国开10	30,044,576.16	6.47%

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

7.4 投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明

本基金的基金份额净值的计算,精确到0.0001元,小数点第五位四舍五入。

在证券交易所市场交易的债券按市价估值;在银行间债券市场交易的债券及未上市债券按摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

(2)本报告期内需说明的证券投资决策程序:无

(3)"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离情况

本基金持有的银行间债券采用"影子定价"与"摊余成本法"确定基金资产净值,无重大偏离。

(4)其他资产的构成

序号	项目	期末金额(元)
1	交易保证金	
2	应收证券交易清算款	
3	应收利息	2,748,583.53
4	应收申购款	7,238,925.04
5	待摊费用	32,508.24
合计		10,020,016.81

§8 基金份额持有人情况

8.1 报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数(户)	6,540
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	70,893.62

8.2 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量(份)	占总份额的比例
报告期末基金份额总额	463,644,248.50	100%
其中:机构投资者持有的基金份额	105,879,638.61	22.84%
个人投资者持有的基金份额	357,764,609.89	77.16%

§9 开放式基金份额变动情况

项 目	基金份额总额(份)
基金合同生效日基金份额总额	6,146,255,272.70
报告期期初基金份额总额	832,209,279.96
报告期间基金总申购份额	1,059,206,911.74
报告期间基金总赎回份额	1,427,771,943.20
报告期期末基金份额总额	463,644,248.50

§10 重大事件揭示

10.1 报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门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:无

10.3 本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。

10.4 报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 基金收益分配事项

报告期内,基金管理人实施了6次本基金收益分配,总计派发现金红利7,097,359.97元。

10.6 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.7 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。

10.8 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债券、债券回购情况

证券公司名称	债券		债券回购		佣金	
	成交金额(元)	占债券成交总额的比例	债券回购成交金额(元)	占债券回购成交总额的比例	佣金(元)	占佣金总量比例
中国建银投资证券有限责任公司	75,272,042.90	81.41%	885,000,000.00	100%		
东海证券有限责任公司	17,187,000.00	18.59%				
合计	92,459,042.90	100%	885,000,000.00	100%		

(3)报告期内租用证券公司席位的变更情况:无

10.9 报告期内本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》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	含本基金
3	嘉实超短债证券投资基金2007年第一次收益分配公告	2007年1月27日	派发现金红利0.021元/10份
4	关于嘉实超短债基金2007年春节前暂停申购业务的公告	2007年2月13日	
5	嘉实超短债证券投资基金2007年第二次收益分配公告	2007年2月28日	派发现金红利0.019元/10份
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	含本基金
8	嘉实超短债证券投资基金2007年第三次收益分配公告	2007年3月29日	派发现金红利0.023元/10份
9	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	含本基金
11	关于嘉实超短债基金2007年五一节前暂停申购业务的公告	2007年4月25日	
12	嘉实超短债证券投资基金2007年第四次收益分配公告	2007年4月25日	派发现金红利0.016元/10份
13	嘉实超短债证券投资基金2007年第五次收益分配公告	2007年5月29日	派发现金红利0.022元/10份
14	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	含本基金
15	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	含本基金
16	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	含本基金
17	嘉实超短债证券投资基金2007年第六次收益分配公告	2007年6月26日	派发现金红利0.031元/10份
18	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	含本基金

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8月28日

(上接D99版)

(2)报告期内累计卖出价值前20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	000410	沈阳机床	183,538,923.91	7.54%
2	600859	王府井	168,325,213.93	6.91%
3	600150	沪东重机	143,137,858.35	5.88%
4	600019	宝钢股份	120,632,413.92	4.95%
5	600067	冠城大通	120,498,914.25	4.95%
6	600118	中国卫星	116,329,858.86	4.78%
7	600713	南京医药	100,583,495.40	4.13%
8	601628	中国人寿	89,875,242.11	3.69%
9	600022	济南钢铁	78,497,401.71	3.22%
10	600529	山东药玻	60,410,409.68	2.48%
11	600036	招商银行	56,732,465.60	2.33%
12	600161	天坛生物	55,736,716.92	2.29%
13	601166	兴业银行	54,947,239.90	2.26%
14	600809	山西汾酒	50,597,393.67	2.08%
15	600059	古越龙山	49,507,245.76	2.03%
16	000777	中核科技	47,170,024.05	1.94%
17	601318	中国平安	44,742,087.68	1.84%
18	000709	唐钢股份	43,087,313.66	1.77%
19	000852	江钻股份	42,009,288.56	1.73%
20	000987	广州友谊	41,707,311.80	1.71%

(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)
1,791,486,307.10	2,582,487,955.92

7.1.5 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	384,309,408.60	11.70%
2	央行票据		
3	金融债券	332,331,727.38	10.11%
4	企业债券		
5	可转换债券	11,278,227.00	0.34%
6	资产支持证券		
合计		727,919,362.98	22.15%

7.1.6 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	109,619,516.50	3.34%
2	21国债⒂	86,460,305.40	2.63%
3	03进出01	69,818,830.00	2.12%
4	99国债(8)	65,644,232.40	2.00%
5	02国债⒁	63,675,792.50	1.94%

7.1.7 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	1,289,216	36,618,891.26	1.11%
合计			1,289,216	36,618,891.26	1.11%

7.1.8 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

7.1.9 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	902,701.35
应收利息	12,257,536.66
应收申购款	
待摊费用	
应收证券清算款	70,554,151.10
其他应收款	85,663.20
合计	83,800,052.31

(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	10,876,167.00	0.33%
2	110398	凯诺转债	402,060.00	0.01%

(5)报告期内获得的权证资产:无

7.2 嘉实稳健基金

7.2.1 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	9,274,648,590.36	53.26%
债券	2,468,929,856.84	14.18%
权证		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	559,074,116.76	3.21%
其他资产	5,111,464,234.17	29.35%
资产合计	17,414,116,798.13	100%

7.2.2 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		
B 采掘业	763,298,767.09	4.53%
C 制造业	3,970,038,975.24	23.59%
C0 食品、饮料	403,111,426.86	2.39%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具	135,758,860.80	0.81%
C3 造纸、印刷	169,436,528.65	1.01%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	164,196,347.91	0.98%
C5 电子	3,408,115.83	0.02%
C6 金属、非金属	1,905,914,006.49	11.32%
C7 机械、设备、仪表	1,092,721,637.15	6.49%
C8 医药、生物制品	95,492,051.55	0.57%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	537,910,246.36	3.20%
E 建筑业	241,843,834.56	1.44%
F 交通运输、仓储业	487,454,769.68	2.90%
G 信息技术业	160,196,083.36	0.95%
H 批发和零售贸易	130,274,204.05	0.77%
I 金融、保险业	1,785,706,701.57	10.61%
J 房地产业	1,104,009,451.55	6.56%
K 社会服务业	86,063,494.22	0.51%
L 传播与文化产业	7,852,062.68	0.05%
M 综合类		
合计	9,274,648,590.36	55.11%

7.2.3 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	000878	云南铜业	34,364,548	1,185,576,906.00	7.04%
2	600036	招商银行	39,330,750	966,749,835.00	5.74%
3	000002	万 科A	27,797,134	531,481,202.08	3.16%
4	600900	长江电力	30,718,353	464,461,497.36	2.76%
5	600104	上海汽车	26,168,087	451,922,862.49	2.69%
6	600150	沪东重机	3,005,311	415,454,192.64	2.47%
7	600000	浦发银行	9,979,164	365,137,610.76	2.17%
8	601699	潞安环能	8,797,821	359,566,944.27	2.14%
9	600569	安阳钢铁	41,717,277	352,093,817.88	2.09%
10	600325	华发股份	10,494,430	318,296,061.90	1.89%

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(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.2.4 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	600036	招商银行	1,023,264,740.01	16.89%
2	000878	云南铜业	988,960,823.03	16.33%
3	000002	万 科A	583,676,223.80	9.64%
4	600030	中信证券	558,081,148.00	9.21%
5	600900	长江电力	457,627,572.07	7.56%
6	600104	上海汽车	396,669,152.21	6.55%
7	600266	北京城建	379,626,827.63	6.27%
8	000063	中兴通讯	363,760,439.17	6.01%
9	600325	华发股份	355,038,572.06	5.86%
10	600000	浦发银行	353,179,504.76	5.83%
11	601699	潞安环能	346,292,514.28	5.72%
12	000001	深发展A	316,061,695.09	5.22%
13	600004	白云机场	312,545,888.08	5.16%
14	600569	安阳钢铁	288,970,584.57	4.77%
15	000960	锡业股份	273,225,249.85	4.51%
16	600150	沪东重机	256,205,873.98	4.23%
17	600879	火箭股份	230,866,716.62	3.81%
18	000858	五 粮 液	203,926,096.15	3.37%
19	600015	华夏银行	189,600,356.24	3.13%
20	600600	青岛啤酒	178,100,831.96	2.94%
21	601006	大秦铁路	174,191,254.45	2.88%
22	000069	华侨城A	169,564,929.32	2.80%
23	600887	伊利股份	146,836,767.96	2.42%
24	000401	冀东水泥	131,662,715.19	2.17%
25	600675	中华企业	131,056,159.76	2.16%
26	600997	开滦股份	125,014,611.08	2.06%
27	600337	美克股份	123,363,906.75	2.04%

(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	600036	招商银行	749,385,706.40	12.37%
2	600019	宝钢股份	616,344,525.99	10.18%
3	000002	万 科A	560,728,939.09	9.26%
4	600028	中国石化	502,101,873.69	8.29%
5	000063	中兴通讯	498,336,450.12	8.23%
6	000858	五 粮 液	469,910,190.61	7.76%
7	600030	中信证券	432,708,146.34	7.14%
8	000898	鞍钢股份	375,427,711.56	6.20%
9	000001	深发展A	343,421,513.89	5.67%
10	600009	上海机场	335,053,316.03	5.53%
11	600690	青岛海尔	333,995,324.23	5.51%
12	600016	民生银行	295,212,072.31	4.87%
13	000970	中科三环	291,939,731.92	4.82%
14	601006	大秦铁路	198,499,727.37	3.28%
15	000069	华侨城A	181,279,246.75	2.99%
16	600348	国阳新能	163,826,579.27	2.70%
17	600004	白云机场	158,700,117.30	2.62%
18	600266	北京城建	148,665,746.21	2.45%
19	600600	青岛啤酒	144,625,317.13	2.39%
20	600005	武钢股份	126,394,836.04	2.09%

(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)
11,773,183,011.92	8,953,736,424.87

7.2.5 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	212,224,713.10	1.26%
2	央行票据		
3	金融债券	2,240,528,240.28	13.31%
4	企业债券	865,100.00	0.01%
5	可转换债券	15,311,803.46	0.09%
6	资产支持证券		
合计		2,468,929,856.84	14.67%

7.2.6 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	07进出04	429,640,850.00	2.55%
2	07进出02	357,857,000.00	2.13%
3	07农发02	209,590,290.00	1.25%
4	06进出01	208,644,240.00	1.24%
5	07进出01	195,250,403.92	1.16%

7.2.7 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

7.2.8 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

7.2.9 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	3,819,632.56
应收证券清算款	
应收股利	20,471.60
应收利息	33,127,293.54
应收申购款	5,074,496,836.47
其他应收款	
待摊费用	
买入返售证券	
合计	5,111,464,234.17

(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	580013	武钢CWB1	99,425	230,397.55	被动投资

注:报告期内,本基金认购武钢股份分离交易可转债而获派的权证武钢CWB1,按权证公允价值占该转债全部公允价值的比例,将认购该转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本,本基金获得的武钢CWB1成本为230,397.55元。

7.3 嘉实债券基金

7.3.1 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	274,068,225.87	7.93%
债券	2,839,835,570.09	82.20%
权证		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	287,476,669.97	8.32%
其他资产	53,379,279.21	1.55%
资产合计	3,454,759,745.14	100%

7.3.2 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	4,416,365.70	0.13%
C 制造业	76,390,615.68	2.29%
C0 食品、饮料	562,799.52	0.02%
C1 纺织、服装、皮毛	45,064,626.53	1.35%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	18,773,089.65	0.56%
C5 电子	6,668,769.83	0.20%
C6 金属、非金属	835,152.40	0.03%
C7 机械、设备、仪表	4,486,177.75	0.13%
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		
E 建筑业	1,554,546.84	0.05%
F 交通运输、仓储业	40,613,662.92	1.21%
G 信息技术业		
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业	46,307,508.78	1.38%
J 房地产业	85,575,556.28	2.56%
K 社会服务业	19,209,969.67	0.57%
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	274,068,225.87	8.19%

7.3.3 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	000024	招商地产	1,699,516	83,446,235.60	2.49%
2	600370	三房巷	5,320,499	45,064,626.53	1.35%
3	601919	中国远洋	1,324,232	24,180,476.32	0.72%
4	601318	中国平安	300,000	21,453,000.00	0.64%
5	601328	交通银行	1,665,082	18,299,251.18	0.55%
6	600423	柳化股份	1,000,000	17,750,000.00	0.53%
7	600874	创业环保	1,759,067	17,678,623.35	0.53%
8	601006	大秦铁路	549,510	8,319,581.40	0.25%
9	601998	中信银行	712,528	6,555,257.60	0.20%
10	600087	南京水运	469,131	6,098,703.00	0.18%

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(www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.3.4 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	000024	招商地产	59,010,853.99	16.56%
2	600370	三房巷	53,204,990.00	14.93%
3	600488	天药股份	43,422,304.36	12.18%
4	600795	国电电力	40,065,445.37	11.24%
5	600001	邯郸钢铁	29,252,797.87	8.21%
6	000488	晨鸣纸业	23,641,836.13	6.63%
7	600317	营口港	20,988,347.59	5.89%
8	600726	华电能源	19,132,357.90	5.37%
9	600423	柳化股份	18,358,406.44	5.15%
10	600874	创业环保	16,044,526.74	4.50%
11	601318	中国平安	14,917,156.80	4.19%
12	601328	交通银行	13,154,147.80	3.69%
13	601919	中国远洋	11,229,487.36	3.15%
14	601998	中信银行	6,417,862.40	1.80%
15	601166	兴业银行	5,241,440.00	1.47%
16	600087	南京水运	5,097,701.99	1.43%
17	600117	西宁特钢	4,158,851.63	1.17%
18	600527	江南高纤	2,494,820.00	0.70%
19	601002	晋亿实业	1,672,778.46	0.47%
20	601003	柳钢股份	1,563,827.00	0.44%

(2)报告期内累计卖出价值前20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	600795	国电电力	51,053,693.68	14.32%
2	600488	天药股份	45,729,825.77	12.83%
3	600001	邯郸钢铁	35,785,805.80	10.04%
4	600726	华电能源	26,512,436.09	7.44%
5	000488	晨鸣纸业	25,831,618.83	7.25%
6	600317	营口港	22,850,776.84	6.41%
7	601333	广深铁路	15,573,974.15	4.37%
8	601166	兴业银行	9,642,178.90	2.71%
9	601318	中国平安	9,636,318.76	2.70%
10	601628	中国人寿	7,531,381.78	2.11%
11	601006	大秦铁路	7,342,940.05	2.06%
12	600423	柳化股份	5,358,566.15	1.50%
13	601002	晋亿实业	4,903,864.62	1.38%
14	601003	柳钢股份	4,662,955.33	1.31%
15	601998	中信银行	4,564,946.98	1.28%
16	600874	创业环保	4,145,080.66	1.16%
17	600117	西宁特钢	3,365,236.09	0.94%
18	600527	江南高纤	2,816,663.29	0.79%
19	600017	日照港	2,578,437.87	0.72%
20	601588	北辰实业	1,942,119.38	0.54%

(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)
400,190,399.33	307,908,176.64

7.3.5 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	1,202,073,342.90	35.93%
央行票据	1,440,275,330.13	43.04%
企业债券	4,788,000.00	0.14%
金融债券	99,850,000.00	2.98%
可转换债券	92,848,897.06	2.78%
资产支持证券		
合计	2,839,835,570.09	84.87%

7.3.6 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	02国债⑽	269,550,162.00	8.06%
2	99国债(8)	266,846,000.40	7.97%
3	21国债⒂	221,273,656.80	6.61%
4	07央行票据22	194,066,095.89	5.80%
5	07央行票据13	188,252,000.00	5.63%

7.3.7 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

7.3.8 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:无

7.3.9 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	770,014.46
应收股利	
应收利息	38,343,492.51
应收申购款	13,897,987.44
其他应收款	117,784.80
待摊费用	
买入返售证券	
合计	53,379,279.21

(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	100236	桂冠转债	14,954,463.00	0.45%
2	100021	上电转债	48,167,837.20	1.44%
3	110398	凯诺转债	2,217,360.90	0.07%
4	110874	创业转债	14,370,320.00	0.43%

(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(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	580013	武钢CWB1	1,199,599	27,779,830.76	被动投资

注:报告期内,本基金认购武钢股份分离交易可转债而获派的权证武钢CWB1,按权证公允价值占该转债全部公允价值的比例,将认购该转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本,本基金获得的武钢CWB1成本为27,779,830.76元。

§8 基金份额持有人情况

8.1 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)	9,458	454,826	25,401
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	92,919.63	36,649.31	110,713.08

8.2 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		878,833,874.01	16,669,057,887.85	2,812,223,013.00
机构投资者	持有基金份额	692,919,112.56	555,598,627.05	1,094,196,730.47
	持有基金份额占总份额的比例	78.85%	3.33%	38.91%
个人投资者	持有基金份额	185,914,761.45	16,113,459,260.80	1,718,026,282.53
	持有基金份额占总份额的比例	21.15%	96.67%	61.09%

§9 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
报告期间基金总申购份额	171,709,870.83	16,140,143,881.72	3,591,827,011.85
报告期间基金总赎回份额	363,547,697.85	4,080,115,336.25	1,113,736,309.47
报告期期末基金份额总额	878,833,874.01	16,669,057,887.85	2,812,223,013.00

§10 重大事件揭示

10.1 报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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:无

10.3 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。

10.4 报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 基金收益分配

2007年5月14日,嘉实债券基金收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.50元,合计派发现金红利67,536,404.92元;

2007年6月28日,嘉实稳健基金收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.50元,合计派发现金红利568,313,838.83元。

10.6 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.7 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。

10.8 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证券公司的选择。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

(A)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	1,806,011,587.01	41.67%	1,474,213.69	42.15%
中信证券股份有限公司	1	965,553,630.82	22.28%	755,551.08	21.60%
东吴证券有限责任公司	1	159,086,401.25	3.67%	130,450.16	3.73%
中信建投证券有限责任公司	1	265,100,917.19	6.12%	217,170.30	6.21%
招商证券股份有限公司	1	283,761,169.55	6.55%	222,043.41	6.35%
渤海证券有限责任公司	1	854,467,936.68	19.71%	697,863.36	19.96%
合计	6	4,333,981,642.50	100%	3,497,292.00	100%

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	13,313,668.20	51.00%
中信证券股份有限公司	1,041,625.00	3.99%
东吴证券有限责任公司	724,500.00	2.78%
中信建投证券有限责任公司	3,023,500.00	11.58%
渤海证券有限责任公司	8,000,659.70	30.65%
合计	26,103,952.90	100%

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	1,315,000,000.00	69.43%
中信建投证券有限责任公司	36,000,000.00	1.90%
渤海证券有限责任公司	543,000,000.00	28.67%
合计	1,894,000,000.00	100%

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%
合计	11,748,885.60	100%

⑤报告期内本基金未变更租用的证券公司专用席位

(B)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	4,556,960,361.38	22.08%	3,736,665.93	22.43%
国泰君安证券股份有限公司	1	3,136,458,493.85	15.19%	2,454,299.08	14.74%
海通证券股份有限公司	1	3,646,221,281.57	17.67%	2,989,364.52	17.95%
中国国际金融有限公司	1	1,032,973,641.35	5.00%	847,032.95	5.09%
中国银河证券有限责任公司	1	280,109,491.78	1.36%	229,509.85	1.38%
申银万国证券股份有限公司	1	3,972,427,768.71	19.25%	3,108,450.39	18.66%
国信证券有限责任公司	1	718,241,979.13	3.48%	588,658.09	3.53%
湘财证券有限责任公司	1	1,283,731,893.85	6.22%	1,052,655.66	6.32%
中信建投证券有限责任公司	1	2,012,826,171.74	9.75%	1,649,690.98	9.90%
合计	9	20,639,951,083.36	100%	16,656,327.45	100%

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%
合计	18,120,885.50	100%

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	6.85%
海通证券股份有限公司	276,000,000.00	37.81%
中国银河证券有限责任公司	36,000,000.00	4.93%
国信证券有限责任公司	240,000,000.00	32.88%
中信建投证券有限责任公司	128,000,000.00	17.53%
合计	730,000,000.00	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%
合计	598,242.23	100%

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。

(C)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	268,011,950.13	86.85%	219,763.84	87.37%
联合证券有限责任公司	1	40,584,370.40	13.15%	31,757.94	12.63%
合计	2	308,596,320.53	100%	251,521.78	100%

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	1,607,833,097.06	91.03%	52,846.50	87.30%
联合证券有限责任公司	158,372,180.42	8.97%	7,688.04	12.70%
合计	1,766,205,277.48	100%	60,534.54	100%

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	7,849,000,000.00	100%
合计	7,849,000,000.00	100%

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	6,537,874.70	100%
合计	6,537,874.70	100%

⑤报告期内本基金未变更租用的证券公司专用席位

10.9 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	关于运用公司固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	

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8月28日