# 嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长基金、嘉实稳健基金及嘉实债券基金更新招募说明书摘要

(上接 D12 版)

c. 债券选择标准

本基金的选券基本标准为:在符合本基金产品资产配置策略和组合构建策略的条件下,选择能够保持策略延续性和稳定性、投资组合流动性及风险控制要求的债券。

(i) 符合实施前述的资产配置策略、投资策略的要求;

(ii) 保持投资策略的延续性和稳定性;

(iii) 符合风险管理指标,包括 VaR 和流动性指标的要求;

(iv) 价值严重被低估且符合投资总体理念的要求;

(v) 降低积极管理风险的要求;

(vi) 银行间市场询价达到三家以上;

(vii) 在其他条件相同时,优先选择双边报价商报价债券列表中的债券;

(viii) 优先选择央行公开市场操作的品种。

(二)投资管理程序

1、研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金在其他重要股票资产类别上的具体配置计划。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定本系列基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、基金经理小组将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6、风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控,并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险分析报告。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购、赎回和转换导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。

8、在确保基金份额持有人利益的前提下,基金管理人有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

## 九、基金的业绩比较基准

嘉实增长基金:巨潮 500(小盘)指数

嘉实稳健基金:巨潮 200(大盘)指数

嘉实债券基金:中央国债登记结算公司的中国债券指数

## 十、基金的风险收益特征

1.嘉实增长基金:本基金属于中高风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

2.嘉实稳健基金:本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

3.嘉实债券基金:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金,高于货币市场基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。

本系列基金托管人中国银行股份有限公司根据本系列基金合同规定,于 2007 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2007 年 6 月 30 日("报告期末"),本报告所列财务数据未经审计。

1.嘉实增长基金

(1)报告期末基金资产组合情况

| 资产类别 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 |
|---|---|---|
| 股票 | 2,236,433,617.96 | 61.65% |
| 债券 | 727,919,362.98 | 20.07% |
| 权证 | 36,618,891.26 | 1.01% |
| 资产支持证券 | | |
| 银行存款及清算备付金合计 | 542,978,629.17 | 14.97% |
| 其他资产 | 83,800,052.31 | 2.30% |
| 合计 | 3,627,750,553.68 | 100% |

(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 | 112,021,719.42 | 3.41% |
| C 制造业 | 1,180,719,272.34 | 35.92% |
| C0 食品、饮料 | 180,093,158.58 | 5.48% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | | |
| C2 木材、家具 | | |
| C3 造纸、印刷 | 44,541,382.60 | 1.35% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 99,569,855.22 | 3.03% |
| C5 电子 | 10,433,823.08 | 0.31% |
| C6 金属、非金属 | 39,719,450.35 | 1.21% |
| C7 机械、设备、仪表 | 384,168,697.76 | 11.69% |
| C8 医药、生物制品 | 417,306,726.75 | 12.70% |
| C99 其他制造业 | 4,886,178.00 | 0.15% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 3,119,361.07 | 0.09% |
| E 建筑业 | 14,328,746.76 | 0.44% |
| F 交通运输、仓储业 | 53,771,968.76 | 1.64% |
| G 信息技术业 | 177,533,193.82 | 5.40% |
| H 批发和零售贸易 | 284,838,502.84 | 8.66% |
| I 金融、保险业 | 161,016,769.79 | 4.90% |
| J 房地产业 | 211,181,137.49 | 6.43% |
| K 社会服务业 | 35,050,700.54 | 1.07% |
| L 传播与文化产业 | 2,852,245.13 | 0.09% |
| M 综合类 | | |
| 合计 | 2,236,433,617.96 | 68.05% |

(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 | 000848 | 承德露露 | 6,005,568 | 174,161,472.00 | 5.30% |
| 2 | 600479 | 千金药业 | 6,756,754 | 155,405,342.00 | 4.73% |
| 3 | 600859 | 王府井 | 2,964,304 | 145,695,541.60 | 4.43% |
| 4 | 002097 | 山河智能 | 1,937,927 | 136,430,060.80 | 4.15% |
| 5 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,795,505 | 125,258,590.60 | 3.81% |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 3,078,070 | 108,009,476.30 | 3.29% |
| 7 | 600583 | 海油工程 | 2,585,453 | 93,593,398.60 | 2.85% |
| 8 | 600118 | 中国卫星 | 2,901,123 | 90,602,071.29 | 2.76% |
| 9 | 600675 | 中华企业 | 3,549,851 | 80,617,116.21 | 2.45% |
| 10 | 600588 | 用友软件 | 1,649,341 | 80,537,321.03 | 2.45% |

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

(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 | 010010 | 20国债⑽ | 109,619,516.50 | 3.34% |
| 2 | 010115 | 21国债⒂ | 86,460,305.40 | 2.63% |
| 3 | 030301 | 03进出 01 | 69,818,830.00 | 2.12% |
| 4 | 009908 | 99国债⑻ | 65,644,232.40 | 2.00% |
| 5 | 010214 | 02国债⒁ | 63,675,792.50 | 1.94% |

(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权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证简称 | 市值(元) | 市值占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 031001 | 侨城 HQC1 | 36,618,891.26 | 1.11% |

(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。

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。

③ 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 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

2.嘉实稳健基金

(1) 报告期末基金资产组合情况

| 资产类别 | 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% |
| 合计 | 17,414,116,798.13 | 100% |

(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% |

(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% |

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

(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 | 070304 | 07进出 04 | 429,640,850.00 | 2.55% |
| 2 | 070302 | 07进出 02 | 357,857,000.00 | 2.13% |
| 3 | 070402 | 07农发 02 | 209,590,290.00 | 1.25% |
| 4 | 060301 | 06进出 01 | 208,644,240.00 | 1.24% |
| 5 | 070301 | 07进出 01 | 195,250,403.92 | 1.16% |

(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。

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。

③ 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 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 | 权证简称 | 数量(份) | 成本总额(元) | 类别(被动持有或主动投资) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 580013 | 武钢 CWB1 | 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。

3.嘉实债券基金

(1) 报告期末基金资产组合情况

| 资产类别 | 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% |
| 合计 | 3,454,759,745.14 | 100% |

(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% |

(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% |

(4) 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% |

(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 | 010210 | 02国债⑽ | 269,550,162.00 | 8.06% |
| 2 | 009908 | 99国债⑻ | 266,846,000.40 | 7.97% |
| 3 | 010115 | 21国债⒂ | 221,273,656.80 | 6.61% |
| 4 | 0701022 | 07央行票据 22 | 194,066,095.89 | 5.80% |
| 5 | 0701013 | 07央行票据 13 | 188,252,000.00 | 5.63% |

(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证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

② 报告期末本基金持有的股票均为一级市场申购的新股或可转换公司债转换的股票。

③ 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 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 | 110021 | 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 | 权证简称 | 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。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2007 年 6 月 30 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本系列基金的招募说明书。

(一)嘉实增长基金

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至 2003 年 12 月 31 日 | 6.49% | 0.41% | -17.35% | 1.16% | 23.84% | -0.75% |
| 2004年度 | 15.56% | 0.89% | -15.41% | 1.52% | 30.97% | -0.63% |
| 2005年度 | 8.85% | 0.93% | -13.29% | 1.67% | 22.14% | -0.74% |
| 2006年度 | 114.77% | 1.16% | 92.66% | 1.59% | 22.11% | -0.43% |

2.自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况并与同期业绩比较基准的变动进行比较

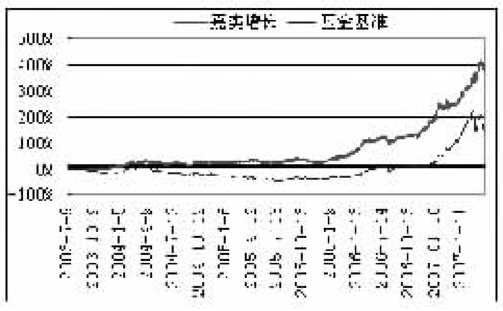

图 1:嘉实增长基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 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 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三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:

(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;(3)本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,不得超过该证券的 10%;(4) 投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(5) 本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

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,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

(二)嘉实稳健基金

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至 2003 年 12 月 31 日 | 6.29% | 0.55% | -3.73% | 0.94% | 10.02% | -0.39% |
| 2004年度 | 2.23% | 0.91% | -15.97% | 1.28% | 18.20% | -0.37% |
| 2005年度 | 2.96% | 0.87% | -7.37% | 1.31% | 10.33% | -0.44% |
| 2006年度 | 101.90% | 1.10% | 122.43% | 1.38% | -20.53% | -0.28% |

2. 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较

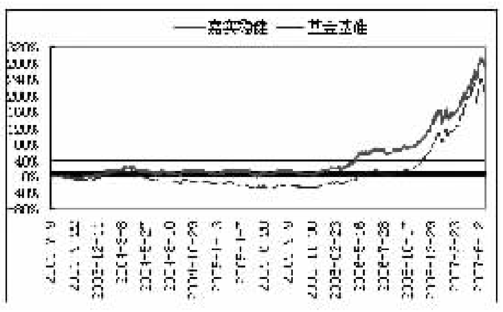

图 2:嘉实稳健基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 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 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三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:

(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;(3)本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,不得超过该证券的 10%;(4) 投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(5) 本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

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,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

(三)嘉实债券基金

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至 2003 年 12 月 31 日 | 0.70% | 0.15% | -1.24% | 0.31% | 1.94% | -0.16% |
| 2004年度 | -7.45% | 0.27% | -2.42% | 0.35% | -5.03% | -0.08% |
| 2005年度 | 13.14% | 0.19% | 10.55% | 0.18% | 2.59% | 0.01% |
| 2006年度 | 27.17% | 0.55% | 2.62% | 0.09% | 24.55% | 0.46% |

.2. 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较

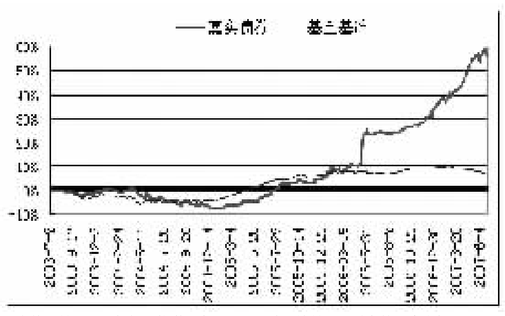

图 3:嘉实债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 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 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三部分(四、(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:

(1)投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(3)投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级;(4)本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月;(5)新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

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,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

## 十三、费用概览

(一)基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

①以下条款适用于嘉实增长基金和嘉实稳健基金

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②以下条款适用于嘉实债券基金

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.6%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.6%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的基金托管费

①以下条款适用于嘉实增长基金和嘉实稳健基金

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②以下条款适用于嘉实债券基金

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金成立后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(4)上述系列基金 / 基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

上述基金费用由相应的基金独立承担,本系列基金费用按各基金份额与各基金份额总和之比分摊。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

1.本系列基金 / 基金的申购费按申购金额采用比例费率,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。费率表如下:

| 申购金额(含申购费) | 申购费率 | |
|---|---|---|
| | 嘉实增长 / 嘉实稳健 | 嘉实债券 |
| 100万元以下 | 1.5% | 0.8% |
| 100万元(含)—500 万元 | 1.2% | 0.6% |
| 500万元(含)以上 | 每笔 1000 元 | 每笔 1000 元 |

投资者通过本系列基金管理人网上交易系统申购本系列基金 / 基金实行申购费率优惠,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的 0.6%。但对于招商银行借记卡持卡人通过本系列基金管理人网上交易系统的申购费率则按申购金额分档,优惠为基金公告规定的申购费率的 80%,优惠后费率如果低于 0.6%,则按 0.6%执行(2007 年 7 月 9 日起至 2007 年 9 月 7 日 15:00 止进一步优惠时段除外)。

基金招募说明书规定的相应申购费率低于 0.6%时,按实际费率收取申购费。

2.赎回费根据持有时间实行递减收费。费率表如下:

| 持有期限 | 赎回费率 | |
|---|---|---|
| | 嘉实增长 / 嘉实稳健 | 嘉实债券 |
| 1年之内 | 0.5% | 0.3% |
| 1年(含)-2 年 | 0.25% | 0.15% |
| 2年(含)以上 | 0 | 0 |

基金的赎回费用由赎回人承担,在扣除必要的手续费后,赎回费余额不得低于赎回费总额的 25%,并归入基金财产。

(3)转换费

基金份额持有人办理基金份额转换需要支付转换费,费率为被转出基金份额净值的 0.5%。如所转换的基金份额已被连续持有超过 3 个月时间,基金份额持有人可以免费转换。转换后的基金份额的持有时间重新开始计算。但以下情形除外:

① 嘉实保本基金保本期内, 由基金管理人管理的其他开放式基金转入嘉实保本基金执行嘉实保本基金申购费率,由嘉实保本基金转出到基金管理人管理的其他开放式基金执行嘉实保本基金赎回费率。

② 由嘉实货币市场基金、嘉实超短债基金转出至嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金(暨嘉实增长基金、嘉实稳健基金与嘉实债券基金)、嘉实服务增值行业基金、嘉实浦安保本基金、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金;嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金(暨嘉实增长基金、嘉实稳健基金与嘉实债券基金)、嘉实服务增值行业基金、嘉实策略增长基金转出至嘉实浦安保本基金,转换费率均为转入基金适用的申购费率。

计算公式如下:

净转入金额 =(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)/(1+ 转换费率)+M

转换费用 =(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)×转换费率 /(1+ 转换费率)

转入份额 = 净转入金额 / 转入当日转入基金的基金份额净值

其中 M 为嘉实货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

③ 由嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金(暨嘉实增长、嘉实稳健与嘉实债券)、嘉实服务增值行业基金、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金转出至嘉实货币市场基金、嘉实超短债基金,转换费 = 转出金额×转出基金的适用赎回费率,转换费的 25%计入转出基金的基金资产(注:此转换行为,视同赎回嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金,(暨嘉实增长、嘉实稳健与嘉实债券)、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金,再将赎回金额用于申购嘉实货币市场基金、嘉实超短债基金)。

④ 嘉实主题精选基金与嘉实债券基金之间、嘉实增长基金与嘉实策略增长基金之间未开办转换业务。

⑤ 嘉实策略增长基金转出至嘉实成长收益基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实主题精选基金,嘉实债券基金转出至嘉实策略增长基金,计算公式如下:

净转入金额 = B×C×(1-D)/(1+G)

转换补差费用 = [B×C×(1-D)/(1+G)]×G

转入份额 = 净转入金额 /E

其中,B 为转出的基金份额; C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;D 为转出基金的对应赎回费率,G 为对应的申购补差费率; E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(4)销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

(二)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(三)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低部分或全部基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告;此项调整无须召开基金份额持有人大会。

(四)基金的税收

本系列基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对 2003 年 5 月 29 日刊登的本系列基金原招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1. 在"重要提示"部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2. 在"三、基金管理人"部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在"四、基金托管人"部分:更新了托管人的相关信息。

4.在"五、相关服务机构"部分:增加中国建设银行、交通银行、北京银行和南京证券有限责任公司为本系列基金代销机构。

5. 在"八、基金份额的申购、赎回"部分:调整了申购份额的计算公式及其他相关信息。

6.在"九、基金转换"部分:更新了基金转换费率、调整了基金转换份额的计算方式。

7.在"十一、基金的投资"部分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

8.在"十二、基金的业绩"部分:说明了基金成立以来的投资业绩。

9.在"二十四、其他应披露事项"部分:增加了 2007 年 1 月 9 日至 2007 年 7 月 12 日本系列 / 基金基金的相关临时公告事项列表。

**嘉实基金管理有限公司**
2007年 8 月 30 日

---

**证券代码:600095　　证券简称:哈高科　　编号:临 2007-033**

# 哈尔滨高科技(集团)股份有限公司第四届董事会第二次临时会议决议公告

特别提示

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

哈尔滨高科技(集团)股份有限公司第四届董事会 2007 年第二次临时会议于 2007 年 8 月 29 日以通讯方式召开。公司 7 名董事全部参与了表决。会议的通知、召开、表决程序符合《公司法》等有关法律、法规以及本公司章程的规定。会议审议通过了如下议案:

一、审议通过了关于为哈高科大豆食品有限责任公司担保的议案;

同意为哈高科大豆食品有限责任公司向中国银行股份有限公司哈尔滨开发区支行借款提供 7000 万元人民币的连带责任保证担保,期限为 1 年。

由于包括本次担保在内,公司累计对外担保余额已经超过本公司 2006 年度经审计净资产的 50%,因此根据《上海证券交易所股票上市规则》的规定,本次担保事项应提交股东大会审议。

表决结果:7 票赞成;0 票弃权;0 票反对。

二、审议通过了关于公司 2007 年第三次临时股东大会延期及增加临时提案的议案。

决定将公司 2007 年第三次临时股东大会延期至 2007 年 9 月 14 日召开,并增加《关于为哈高科大豆食品有限责任公司提供担保的议案》。

表决结果:7 票赞成;0 票弃权;0 票反对。

特此公告。

**哈尔滨高科技(集团)股份有限公司**
**董事会**
**2007 年 8 月 29 日**

---

**证券代码:600095　　证券简称:哈高科　　编号:临 2007-034**

# 哈尔滨高科技(集团)股份有限公司关于 2007 年第三次临时股东大会延期及增加临时提案的通知

各位股东:

本公司董事会决定将 2007 年第三次临时股东大会延期至 2007 年 9 月 14 日召开,具体事宜如下:

一、召开时间:2007 年 9 月 14 日(星期五)上午 9 时

二、召开地点:哈尔滨开发区迎宾路集中区天平路 2 号 5 楼会议室

三、参加人员:

1、截止 2007 年 9 月 10 日上海证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的全体股东或其授权委托代理人;

2、本公司董事、监事、高级管理人员;

3、本公司聘请的律师。

四、会议议题:

1、关于为青岛临港置业有限公司担保的议案;

2、关于为哈高科大豆食品有限责任公司担保的议案;

五、会议登记事项:

1、自然人股东,请持本人身份证和股东账户卡办理;委托代理人持本人身份证、授权委托书、委托人股东账户卡办理;

2、法人股东代表需持法人股东账户卡、营业执照复印件、法定代表人授权委托书、出席人的身份证办理;

3、异地股东可以通过信函或传真方式办理;

4、参会登记时间:2007 年 9 月 13 日(上午 9:00—11:30,下午 13:00—17:00)

5、登记地点:哈尔滨开发区迎宾路集中区天平路 2 号,公司董事会办公室。

6、其他事项:

公司地址:哈尔滨开发区迎宾路集中区天平路 2 号

邮政编码:150078

联 系 人:王江风

联系电话:0451—84346722

传　真:0451—84346722

与会股东交通食宿费用自理。

特此公告。

附:授权委托书

**哈尔滨高科技(集团)股份有限公司**
**董 事 会**
**2007 年 8 月 29 日**

### 授权委托书

兹委托　　先生 / 女士,代表我单位(本人)出席哈尔滨高科技(集团)股份有限公司 2007 年第三次临时股东大会。

表决指示:

议案 1、:关于为青岛临港置业有限公司担保的议案

□赞成　　□反对　　□弃权

议案 2、:关于为哈高科大豆食品有限责任公司担保的议案

□赞成　　□反对　　□弃权

如果本委托人不作具体表示,受托人是否可以按照自己的意思表决。

□是　　□否

委托人签名(盖章):　　受委托人签名:

委托人身份证号码:　　受委托人身份证号码:

委托人持有股数:　　委托日期:

委托人股东账户:

注:授权委托书剪报、复印或按以上格式自制均有效。

---

**证券代码:600095　　证券简称:哈高科　　编号:临 2007-035**

# 哈尔滨高科技(集团)股份有限公司关于为哈高科大豆食品有限责任公司提供担保的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

一、担保情况概述

经本公司第四届董事会第二次临时会议审议通过,拟为哈高科大豆食品有限责任公司向中国银行股份有限公司哈尔滨开发区支行借款 7000 万元人民币提供连带责任保证担保。

由于包括本次担保在内, 公司累计对外担保余额已经超过本公司 2006 年度经审计净资产的 50%,因此根据《上海证券交易所股票上市规则》的规定,该担保事项应提交股东大会审议。

二、被担保人基本情况

被担保人名称:哈高科大豆食品有限责任公司

注册地点:哈尔滨开发区迎宾路集中区天平路 2 号

法定代表人:徐宽明

经营范围: 组织蛋白、分离蛋白、食用纤维、纯净水生产销售

与本公司的关系:本公司的控股子公司

主要财务状况:截止 2006 年末,该公司资产总额为 38,061.81 万元、负债总额 17,091.17 万元、净资产 20,970.64 万元 、净利润 363.1 万元。

三、担保的主要内容

担保的方式:连带责任保证担保

担保金额:7000 万元人民币

四、董事会意见

董事会认为哈高科大豆食品有限责任公司有足够的能力偿还到期债务,该项借款有利于提高其生产经营能力,增加企业效益,符合公司发展的要求。

五、累计对外担保数额

本公司目前累计担保总额为 35,940 万元(包括本次担保),其中:本公司对控股子公司担保数额为 15,740 万元, 本公司及控股子公司对外担保数额为 16,900 万元,本公司控股子公司之间担保数额为 2,000 万元。

六、备查文件:

1. 经与会董事签字生效的董事会决议;

2. 被担保人最近一期的财务报表;

3、被担保人营业执照复印件。

**哈尔滨高科技(集团)股份有限公司**
**董 事 会**
**2007 年 8 月 29 日**