

(上接D97版)
(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。
7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
(1) 嘉实稳健基金

Table with columns: 关联方名称, 基金买入, 基金卖出, 交易金额, 利息收入, 利息支出. Includes data for 2008年1月1日至2008年12月31日 and 2007年1月1日至2007年12月31日.

Table with columns: 关联方名称, 基金买入, 基金卖出, 交易金额, 利息收入, 利息支出. Includes data for 2008年1月1日至2008年12月31日 and 2007年1月1日至2007年12月31日.

Table with columns: 关联方名称, 基金买入, 基金卖出, 交易金额, 利息收入, 利息支出. Includes data for 2008年1月1日至2008年12月31日 and 2007年1月1日至2007年12月31日.

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本系列基金的情况
7.4.4.4.2 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

Table with columns: 项目, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Includes data for 期初持有的基金份额, 期间申购/买入基金份额, etc.

注: (1) 期间申购/买入总份额无红利再投资, 转换为份额, 期间赎回/卖出总份额无赎回费用; (2) 基金管理人于2007年2月5日通过本系列基金代纳机构申购嘉实债券基金1500万元, 申购费为1000元; 2006年8月22日, 申购嘉实债券基金1200万元, 申购费为1000元; 2005年10月19日, 申购嘉实债券基金1000万元, 申购费为1000元。

7.4.4.5 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
(1) 嘉实增长基金
基金管理人、基金管理人主要股东及其控制机构于2008年及2007年末均未持有本系列基金中的嘉实增长基金的份额。

Table with columns: 关联方名称, 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例. Includes data for 立信投资有限责任公司.

Table with columns: 关联方名称, 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例. Includes data for 中诚信託有限责任公司.

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
(1) 嘉实增长基金

Table with columns: 关联方名称, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Includes data for 中国银行股份有限公司.

Table with columns: 关联方名称, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Includes data for 中国银行股份有限公司.

Table with columns: 关联方名称, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日. Includes data for 中国银行股份有限公司.

7.4.4.6 本系列基金在承销期间参与认购承销证券的情况
7.4.4.6.1 本系列基金在本承销期间参与认购承销证券的情况
7.4.5 期末(2008年12月31日)本系列基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 受限证券类别: 股票
(1) 嘉实增长基金

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 成功认购日, 可流通日, 流通受限类型, 数量(单位), 期末成本总额, 期末估值总额. Includes data for 060853 海油工程, etc.

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 到期日, 期末估值总额, 数量(单位). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金总资产的比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的持有股票明细, 应阅读该证券于基金管理人网站(http://www.jfunds.cn)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
8.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600036 招商银行, etc.

8.1.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600036 招商银行, etc.

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 4,250,766,647.20 and 3,405,859,166.49.

注: 8.1.4.1至8.1.4.3“买入金额”、“卖出金额”及8.1.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801046 08央行票据46, etc.

8.1.7 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

8.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.1.9 投资组合报告附注
8.1.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.1.9.2 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。

8.1.9.3 期末其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 存出保证金, etc.

8.1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 101598 大荒转债, etc.

8.1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.2 嘉实稳健证券投资基金
8.2.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

8.2.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 000792 盐湖钾肥, etc.

注: (1) 报告期末, 本基金持有的“盐湖钾肥”市值占基金资产净值比例为9.9971%, 表中数据为保留小数点后两位, 四舍五入所致; (2) 投资者欲了解本报告期末基金投资的持有股票明细, 应阅读该证券于基金管理人网站(http://www.jfunds.cn)的年度报告正文。

8.2.4 累计买入金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600036 招商银行, etc.

8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 630,176,998.84 and 946,243,818.83.

注: 8.2.4.1至8.2.4.3“买入金额”及8.2.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801092 08央行票据92, etc.

8.2.7 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

8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 580019 石化CWB1, etc.

8.2.9 投资组合报告附注
8.2.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600036 招商银行, etc.

8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 32,542,654,139.03 and 33,544,202,056.00.

注: 8.2.4.1至8.2.4.3“买入金额”及8.2.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801092 08央行票据92, etc.

8.2.7 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

8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 580019 石化CWB1, etc.

8.2.9 投资组合报告附注
8.2.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.2.9.2 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。

8.2.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 存出保证金, etc.

8.2.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 125528 鼎工转债, etc.

8.2.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.3 嘉实债券证券投资基金
8.3.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

8.3.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

8.3.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 002257 立立电子, etc.

8.3.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.3.4.1 累计买入金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600026 中海发展, etc.

8.3.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 630,176,998.84 and 946,243,818.83.

注: 8.3.4.1至8.3.4.3“买入金额”及8.3.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.3.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.3.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801092 08央行票据92, etc.

8.3.7 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

8.3.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 580019 石化CWB1, etc.

8.3.9 投资组合报告附注
8.3.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.3.9.2 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。

8.3.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 存出保证金, etc.

8.3.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 125528 鼎工转债, etc.

8.3.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 010203 02国债(3), etc.

8.3.9.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

8.3.9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.3.9.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.3.9.9 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.3.9.10 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。

8.3.9.11 期末其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 存出保证金, etc.

8.3.9.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 002257 立立电子, etc.

8.3.9.13 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4 嘉实债券证券投资基金
8.4.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

8.4.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

8.4.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 002257 立立电子, etc.

8.4.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.4.1 累计买入金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600026 中海发展, etc.

8.4.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 630,176,998.84 and 946,243,818.83.

注: 8.4.4.1至8.4.4.3“买入金额”及8.4.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.4.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.4.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801092 08央行票据92, etc.

8.4.7 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

8.4.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 580019 石化CWB1, etc.

8.4.9 投资组合报告附注
8.4.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.4.9.2 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。

8.4.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额. Includes data for 1 存出保证金, etc.

8.4.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 125528 鼎工转债, etc.

8.4.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5 嘉实增长证券投资基金
8.5.1 期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Includes data for 1 权益投资, etc.

8.5.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for A 农林、牧、渔业, etc.

8.5.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 000051 格力电器, etc.

8.5.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.5.4.1 累计买入金额前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Includes data for 1 600036 招商银行, etc.

8.5.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Includes data for 630,176,998.84 and 946,243,818.83.

注: 8.5.4.1至8.5.4.3“买入金额”及8.5.4.3“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

8.5.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 国债债券, etc.

8.5.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 0801092 08央行票据92, etc.

8.5.7 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

8.5.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证简称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Includes data for 1 580019 石化CWB1, etc.

8.5.9 投资组合报告附注
8.5.9.1 报告期内本基金投资的前十名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前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.5.9.2 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。

8.5.9.3 其他资产构成