嘉实服务增值行业证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。公司董事Edouard Fernen Peter先生未出席本次董事会。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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2009年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实服务增值行业证券投资基金
基金简称	嘉实服务增值行业混合（深交所净值揭示简称：嘉实服务）
交易代码	070006（深交所净值揭示代码：160705）
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月1日
报告期末基金份额总额	1,498,508,511.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准，在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。
投资策略	在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上，制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。同时，根据合适的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票，获取稳定的长期回报。
业绩比较基准	投资基准指数=中信综合指数×80%+中信国债指数×20%
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	宁敏
	联系电话	010 65215588	010 66594977
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		010 65182266	010 66594942
注册地址		上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市建国门北大街8号华润大厦8层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100005（办公地址）	100818
法定代表人		王忠民	肖钢

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009年1月1日至2009年6月30日）
本期已实现收益	1,164,256,474.69
本期利润	1,772,130,599.04
加权平均基金份额本期利润	1.1196
本期加权平均净值利润率	40.97%
本期基金份额净值增长率	52.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009年1月1日至2009年6月30日）
期末可供分配利润	2,990,322,954.94
期末可供分配基金份额利润	1.9955
期末基金资产净值	4,946,675,342.40
期末基金份额净值	3.301
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009年1月1日至2009年6月30日）
基金份额累计净值增长率	283.49%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；②所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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	10.22%	0.90%	9.11%	0.85%	1.11%	0.05%
过去三个月	19.43%	1.32%	18.33%	1.20%	1.10%	0.12%
过去六个月	52.40%	1.58%	56.65%	1.57%	-4.25%	0.01%
过去一年	23.59%	1.72%	16.90%	2.04%	6.69%	-0.32%
过去三年	202.22%	1.89%	106.37%	1.94%	95.85%	-0.05%
自基金合同生效起至今	283.49%	1.56%	109.61%	1.65%	173.88%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为中信综合指数×80%+中信国债指数×20%。本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图：嘉实服务增值行业混合基金份额累计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

（2004年4月1日至2009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，建仓结束时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）投资组合比例限制规定；①在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围：股票资产25%-95%；债券资产0%-70%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的80%。②持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的10%。③本基金与由本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法律法规规定的其他限制。

§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，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII特定资产管理业务资格。

截止2009年6月30日，嘉金管理人共管理2只封闭式基金、15只开放式基金、具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈勤	本基金基金经理	2008年3月20日	-	7	曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行证券分析师、华夏基金管理有限公司基金经理助理、银华基金管理有限公司投资管理部，曾任银华优势企业混合基金经理。2007年11月加盟嘉实基金管理有限公司。工商管理硕士（MBA），经济学硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格，国籍加拿大。

注：①任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日；②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实服务增值行业证券投资基金合同》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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与其他投资组合的投资风格不同，未与其他投资组合进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

截至报告期末本基金基金份额净值为3.301元，本报告期基金份额净值增长率为52.40%，同期业绩比较基准收益率为56.65%。

回顾2009年上半年，A股市场主要指数总体呈现震荡向上的走势，截止到本报告期末，市场主要指数比上一年末上涨大约75%。从行业和板块来看，基本经历了两个阶段：第一阶段是在国内外经济复苏的前景尚不明确的情况下，以新能源和军工概念等为代表的主题投资引领了市场的第一波上升行情。进入二季度，在经济复苏迹象日益明显的情况下，与其相关性强的金融、地产、资源和采掘类等板块，成为引领市场进一步上升的主要推动力。综合来看，报告期内表现比较好的板块有房地产、金融服务和采掘，表现相对弱的板块有公用事业、农林牧渔和文化传播等防御性行业。

报告期内，本基金基本保持了较高的股票仓位配置。在行业配置上做到了去稳增较，增加了直接受益于经济复苏的资源和投资品如金融、房地产、采掘等板块的配置，减少了在医药、设备制造和综合等行业的比例。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管市场指数在本报告期创出了年内新高，市场平均估值水平也有较大提高，但我们对下阶段A股市场仍然保持谨慎乐观。主要原因是：①宏观经济继续改善，其效用正在向微观经济面传导的预期增强；②从大类资产收益率的比较角度出发，股票资产收益率吸引力尽管较前期有所下降，但其相对收益率仍较其他资产类别具备一定优势；③充裕的流动性在短期内预计不会发生逆转，前期财富效应使得市场资金保持活跃；④考虑到业绩预期的向上调整，目前的市场估值水平偏高，但仍处于合理范围内，同时板块之间仍然具有明显的估值差异，反映出市场参与者的理性；⑤市场整体抗风险的能力得到增强。

在下阶段操作中，本基金将继续保持股票资产较高的配置；在行业选择中，将集中配置受益于固定资产投资增加、特别是房地产开发投资相关的行业和上游资源品，并开始配置在经济复苏到增长中后期受益明显的板块和个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由研究、固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，研究、固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，参加估值专业委员会会议，不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十三、（四）收益分配原则）7.在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成”，报告期内本基金未实施收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实服务增值行业证券投资基金（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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产			
银行存款	6.4.7.1	691,385,754.79	210,156,059.22
结算备付金		32,987,693.33	15,375,394.62
存出保证金		4,138,597.10	1,973,341.28
交易性金融资产	6.4.7.2	4,273,899,762.42	3,327,687,837.55
其中：股票投资		3,879,322,686.32	2,750,053,269.87
基金投资		-	-
债券投资		394,577,076.10	577,634,567.68
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	95,481,575.82
应收利息	6.4.7.5	6,497,581.64	15,492,869.73
应收股利		801,832.45	-
应收申购款		16,415,418.33	235,872.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,026,126,640.06	3,666,402,950.93

负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负债			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		42,584,093.31	-
应付赎回款		7,714,487.94	2,545,337.44
应付管理人报酬		5,874,679.01	4,775,770.21
应付托管费		979,113.17	795,961.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,763,244.15	7,980,857.08
应交税费		317,240.44	317,240.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,218,439.64	1,127,261.87
负债合计		79,451,297.66	17,542,428.76
所有者权益			
实收基金	6.4.7.9	1,498,508,511.09	1,684,851,076.34
未分配利润	6.4.7.10	3,448,166,831.31	1,964,009,445.83
所有者权益合计		4,946,675,342.40	3,648,860,522.17
负债和所有者权益总计		5,026,126,640.06	3,666,402,950.93

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值3.301元，基金份额总额1,498,508,511.09份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		1,870,338,071.86	-3,000,405,835.93
1.利息收入		7,701,469.84	14,817,664.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,602,838.04	3,278,998.93
债券利息收入		6,098,631.80	11,494,505.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	44,159.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益		1,254,056,201.74	-140,216,922.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,236,057,122.69	-160,868,170.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,127,040.96	-8,209,219.08
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	3,067,104.92
股利收益	6.4.7.15	19,126,120.01	25,793,362.57
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	607,874,124.35	-2,876,681,573.16
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	706,275.93	1,674,995.51
二、费用		-98,207,472.82	-209,014,855.70
1.管理人报酬		-32,003,561.46	-57,821,577.49
2.托管费		-5,333,926.90	-9,636,929.57
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	-60,650,640.29	-140,496,789.45
5.利息支出		-	-821,925.72
其中：卖出回购金融资产支出		-	-821,925.72
6.其他费用	6.4.7.19	-219,344.17	-237,633.47
三、利润总额		1,772,130,599.04	-3,209,420,691.63
所得税费用		-	-
四、净利润		1,772,130,599.04	-3,209,420,691.63

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,684,851,076.34	1,964,009,445.83	3,648,860,522.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,772,130,599.04	1,772,130,599.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-186,342,565.25	-287,973,213.56	-474,315,778.81
其中：1.基金申购款	509,536,395.49	980,468,245.42	1,490,004,640.91
2.基金赎回款	-695,878,960.74	-1,268,441,458.98	-1,964,320,419.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,498,508,511.09	3,448,166,831.31	4,946,675,342.40
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,321,021,331.86	7,800,914,752.70	10,121,936,084.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,209,420,691.63	-3,209,420,691.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-274,894,965.66	-751,417,488.24	-1,026,312,453.90
其中：1.基金申购款	241,419,058.78	635,616,229.18	877,035,287.96
2.基金赎回款	-516,314,024.44	-1,387,033,717.42	-1,903,347,741.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-420,909,607.18	-420,909,607.18
五、期末所有者权益（基金净值）	2,046,126,366.20	3,419,166,965.65	5,465,293,331.85

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

报告期内，本基金不存在重大会计差错事项。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方，未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

①）基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	32,003,561.46	57,821,577.49
其中：当期已支付	26,128,882.45	50,666,969.40
期末未支付	5,874,679.01	7,154,608.09

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%／当年天数。

②）基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	5,333,926.90	9,636,929.57
其中：当期已支付	4,354,813.73	8,444,494.90
期末未支付	979,113.17	1,192,434.67

注：支付基金托管人中国银行的托管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。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%／当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	-	105,938,783.56	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	96,100,000.00	289,308,468.49	-	-	565,410,000.00	606,817.60

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

①）报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2009年1月1日至2009年6月30日，上年度可比期间（2008年1月1日至2008年6月30日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

②）报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2009年6月30日），上年度末（2008年12月31日），其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	691,385,754.79	1,400,168.45	478,825,111.06	2,993,066.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

①）受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
600239	云南城投	2009-04-14	2010-04-12	非公开发行流通受限	15.18	13.34	2,100,000	21,252,000.00	28,014,000.00
600522	中天科技	2009-03-06	2010-03-04	非公开发行流通受限	8.60	11.87	2,470,000	21,242,000.00	29,318,900.00
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	9.71	4,800,000	36,960,000.00	46,608,000.00
002122	天马股份	2009-02-17	2010-02-19	非公开发行流通受限	47.00	25.27	1,000,000	23,500,000.00	25,270,000.00

注：①本基金于2009年4月14日参与认购云南城投非公开发行股票，认购数量1,400,000股，该股票于2009年6月16日实施2008年度资本公积金转增股本，按每10股转增5股，新增700,000股。②本基金于2008年12月31日参与认购海油工程非公开发行股票，认购数量3,200,000股，该股票于2009年5月26日实施2008年利润分配，按每10股送1股、转增4股，新增1,600,000股。③本基金于2009年2月17日参与认购天马股份非公开发行股票，认购数量500,000股，该股票于2009年4月2日实施2008年度利润分配及资本公积转增股本，按每10股转增10股，新增500,000股。

②）受限证券类别：债券

期末（2009年6月30日）本基金未持有流通受限的债券。

③）受限证券类别：其他

期末（2009年6月30日）本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票：无

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

①）银行间市场债券正回购

期末本基金银行间市场债券正回购余额为零。

②）交易所市场债券正回购

期末本基金的交易所债券正回购余额为零。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,879,322,686.32	77.18
	其中：股票	3,879,322,686.32	77.18
2	固定收益投资	394,577,076.10	7.85
	其中：债券	394,577,076.10	7.85
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	724,373,448.12	14.41
6	其他资产	27,853,429.52	0.55
	合计	5,026,126,640.06	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	193,727,425.48	3.92
C	制造业	1,008,416,740.59	20.39
C0	食品、饮料	47,291,454.91	0.96
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	51,904,500.00	1.05
C5	电子	48,230,197.95	0.98
C6	金属、非金属	68,626,737.16	1.39
C7	机械、设备、仪表	640,158,225.70	12.94
C8	医药、生物制品	152,205,624.87	3.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	132,750,041.35	2.68
E	建筑业	293,042,718.52	5.92
F	交通运输、仓储业	192,591,681.91	3.89
G	信息技术业	196,620,288.14	3.97
H	批发和零售贸易	143,917,162.01	2.91
I	金融、保险业	1,261,611,668.43	25.50
J	房地产业	434,043,724.41	8.77
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	22,601,235.48	0.46
M	综合类	-	-
	合计	3,879,322,686.32	78.42

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	10,871,001	403,422,847.11	8.16
2	600016	民生银行	36,049,845	285,514,772.40	5.77
3	000002	万 科A	21,039,895	268,258,661.25	5.42
4	601169	北京银行	12,298,505	199,973,691.30	4.04
5	600546	中油化建	7,145,630	149,343,667.00	3.02
6	002242	九阳股份	5,573,457	145,467,227.70	2.94
7	000651	格力电器	5,843,265	122,124,238.50	2.47
8	600028	中国石化	9,386,668	100,061,880.88	2.02
9	000623	吉林敖东	2,460,001	99,556,240.47	2.01
10	601328	交通银行	10,799,959	97,307,630.59	1.97

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（http://www.jsfund.cn）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%的股票明细

金额单位：人民币元

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（%）
1	601166	兴业银行	766,613,984.30	21.01
2	601601	中国太保	571,217,168.82	15.65
3	601318	中国平安	518,939,804.87	14.22
4	600016	民生银行	440,883,089.13	12.08
5	600030	中信证券	372,952,784.30	10.22
6	000002	万 科A	360,163,212.65	9.87
7	600048	保利地产	330,745,811.10	9.06
8	601169	北京银行	320,498,648.06	8.78
9	601328	交通银行	232,003,845.50	6.36
10	600029	南方航空	228,401,019.50	6.26
11	000063	中兴通讯	226,475,939.55	6.21
12	002202	金风科技	222,609,761.36	6.10
13	601001	大同煤业	219,301,477.79	6.01
14	000825	太钢不锈	202,884,511.42	5.56
15	000758	中色股份	185,891,259.82	5.09
16	600895	张江高科	185,169,874.00	5.07
17	000792	盐湖钾肥	183,577,871.74	5.03
18	002242	九阳股份	183,368,704.18	5.03
19	600031	三一重工	182,909,737.89	5.01
20	000623	吉林敖东	174,402,530.78	4.78
21	600837	海通证券	172,018,951.46	4.71
22	000709	唐钢钢铁	171,279,009.71	4.69
23	600028	中国石化	170,361,748.37	4.67
24	000651	格力电器	169,606,318.49	4.65
25	600795	国电电力	167,512,839.48	4.59
26	600835	上海机电	167,281,229.44	4.58
27	600809	山西汾酒	164,675,945.60	4.51
28	601699	潞安环能	163,901,341.06	4.49
29	600001	邯郸钢铁	161,640,651.48	4.43
30	000527	美的电器	158,810,913.16	4.35
31	000839	中信国安	147,853,416.93	4.05
32	600196	复星医药	146,735,635.43	4.02
33	000983	西山煤电	138,206,061.79	3.79
34	600015	华夏银行	137,715,658.75	3.77
35	600325	华发股份	137,412,309.79	3.77
36	600551	时代出版	131,558,629.89	3.61
37	600973	宝胜股份	127,728,473.28	3.50
38	000597	东北制药	127,084,216.23	3.48
39	600487	亨通光电	126,870,494.87	3.48
40	000528	柳 工	125,123,163.67	3.43
41	600486	扬农化工	124,719,245.00	3.42
42	600546	中油化建	124,489,125.66	3.41
43	600290	华仪电气	119,999,928.05	3.29
44	601168	西部矿业	118,548,653.91	3.25
45	600657	信达地产	118,224,174.00	3.24
46	600582	天地科技	116,286,934.31	3.19
47	600348	国阳新能	111,514,900.11	3.06
48	600036	招商银行	110,427,388.38	3.03
49	000686	东北证券	109,701,671.23	3.01
50	600251	冠农股份	104,881,179.13	2.87
51	600900	长江电力	103,021,924.97	2.82
52	600359	新农开发	100,277,171.82	2.75
53	002024	苏宁电器	99,832,791.18	2.74
54	600655	豫园商城	99,451,760.81	2.73
55	600887	*ST伊利	98,329,494.58	2.69
56	601398	工商银行	98,023,660.71	2.69
57	000157	中联重科	97,854,648.47	2.68
58	600697	欧亚集团	97,262,826.67	2.67