嘉实研究精选股票型证券投资基金2009年半年度报告摘要

§ 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 Femen 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。 基金社管人中国操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 增

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 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」 |
|---|---|------|------|---|---|---|---|-----|------|---|---|---|----|----|
| | | 基金管 | | | | | | | | | | | | |
| 2 | 1 | 比全土: | 木桔刈 | J | | | | | | | | | | |

| 3 2 基金 面介 .1 基金基本情况 | |
|-------------------------------|------------------------------------|
| 基金名称 | 嘉实研究精选股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实研究精选股票(深交所净值揭示简称:嘉实精选) |
| 交易代码 | 070013(深交所净值揭示代码;160712) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年 5 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,451,336,124.93 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 2 基金产品说明 | • |
| | 通过持续 系统 深太的基本面研究 挖掘企业内在价值 寻找具条长期增长 |

| | 投资目标 | | 通过持续、系统、深入的基本面研究,挖掘企业内在价值,寻找具备长期增长潜力的上市公司,以获取基金资产长期稳定增值。 | | | | |
|-----|------------|----------------------|--|--|--|--|--|
| | 投资策略 | | 用"自下而上"的精选策略,定量分析与定性 建股票投资组合;剩余资产配置于固定收益 {采取"自上而下"的策略。 | | | | |
| | 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×95%+上证国债指数 | 效×5% | | | | |
| | 风险收益特征 | 较高风险,较高收益。 | | | | | |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管 | 人 | | | | | |
| | 項目 | 基金管理人 | 基金托管人 | | | | |

| 2.3 | 3 垄並目理人和垄並忙員人 | | | | | | |
|-----|-------------------|----------|----------------------------------|--------------------------|--|--|--|
| | 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 | | | |
| | Charles Into 1989 | 姓名 | 胡勇钦 | 宁敏 | | | |
| | 信息披露 负责人 | 联系电话 | (010)65215588 | (010)66594977 | | | |
| | 54.54.74 | 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 | 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 |
| 8 | 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 | 1 主安云口双插作网 为相你 |
|-------------------------------------|----------------------------------|
| 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) | 3.1.1 期间数据和指标 |
| 785,202,730.23 | 本期已实现收益 |
| 884,151,151.81 | 本期利润 |
| 0.4384 | 加权平均基金份额本期利润 |
| 34.48% | 本期加权平均净值利润率 |
| 43.85% | 本期基金份额净值增长率 |
| 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) | 3.1.2 期末数据和指标 |
| 857,442,204.71 | 期末可供分配利润 |
| 0.3498 | 期末可供分配基金份额利润 |
| 3,541,856,266.52 | 期末基金资产净值 |
| 1.445 | 期末基金份额净值 |
| 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) | 3.1.3 累计期末指标 |
| 48.02% | 基金份额累计净值增长率 |
| 到6.1 机密收丝 甘油6.1 在泰八公6.66金元66光 图641至 | 6)本期口空和收长长其众本期 |

| 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 | 6.80% | 0.74% | 13.95% | 1.16% | -7.15% | -0.42% |
| | 过去三个月 | 18.41% | 1.21% | 24.87% | 1.48% | -6.46% | -0.27% |
| | 过去六个月 | 43.85% | 1.45% | 69.63% | 1.86% | -25.78% | -0.41% |
| | 过去一年 | 51.50% | 1.33% | 13.53% | 2.45% | 37.97% | -1.12% |
| | 自基金合同生效 起至今 | 48.02% | 1.29% | -9.80% | 2.52% | 57.82% | -1.23% |
| 注: | 木其全业缔比较 | 其准为沪滔 | 300 指数シの5ペー | 上证国债指数。 | 50%. 沪深 300 指数. | 黒沪深証券ス | 2.显而联合 |

注:本基金业绩比较基准为沪深 300 指数x95%+上证国债指数x5%。沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的 反转的 股市场整体走势价指数、由上海和深圳证券市场中选取 300 月 4 是作为样本编制而成的成份股指数,具有良 好的 A 股市场代表性。上证国债指数是以上海证券会易所上市的所有固定利率国债为样本、按照国债发产量加权而 成,具有良好的债券市场代表性。由于本基金优先定置股票资产。债券、现金类资产主要作为流动性管理工具,因此本 基金采用上运两个指数组成的复合指数作为业绩比较基础。 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;

其中 $1=1,2,3,\cdots$ 。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:嘉实研究精选股票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 2008年5月27日至2009年6月30日) 注:按基金合同约定:本基金自基金合同但实付起6个月内办造仓期;建仓期结束时本基金的投资组合比例符合 基金合同"中四"基金的投资 C. 股资范围、化 2.投资组合比例限制"的约定。

| 姓名 | 职务 | 任本基金的 | 基金经理期限 | 证券从业 | 说明 | |
|-------|--|----------------|--------|------|---|--|
| 双: 石: | DT 93 | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | 150.91 | |
| 党开宇 | 本基金基惠合 金字基企 稳健经理 不完 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 | 2008年5月 | _ | 8年 | 曾任招商证券公司证券投资部投资 经理。2003年10月加入语安基金、管 任语安平衡混合基金经理。2006年9 月加盟泰安基金。管任每实集略混合基金经理。3006年9 基金经理,嘉实服务增值行业混合基 金经理。硕士、CFA、具有基金从业资 桥、中国国籍 | |
| 刘红辉 | 本基金基金 经理 | 2008年5月 27日 | - | 5年 | 2004年7月加入嘉实基金管理公司, 任产品经理、基金经理助理。经济学 硕士,具有基金从业资格,中国国籍。 | |

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1.445元,本报告期基金份额净值增长率为43.85%,同期业绩比较基准收

| | | | 1 |
|-----------|----------|-----------------------|---|
| 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 | 652,334,493.26 | 120,781,029.4 |
| 结算备付金 | | 14,927,014.72 | 8,392,440.2 |
| 存出保证金 | | - | |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,177,059,556.61 | 1,512,836,805.2 |
| 其中:股票投资 | | 2,982,475,556.61 | 1,280,698,805.2 |
| 基金投资 | | - | |
| 债券投资 | | 194,584,000.00 | 232,138,000.0 |
| 资产支持证券投资 | | - | |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | |
| 买人返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | |
| 应收证券清算款 | | - | 18,769,583.8 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 5,283,357.31 | 7,375,122.4 |
| 应收股利 | | - | |
| 应收申购款 | | 7,372,796.18 | 12,873,998. |
| 递延所得税资产 | | - | |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | |
| 资产总计 | | 3,856,977,218.08 | 1,681,028,979.9 |
| 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 | | 184,895,868.07 | 12,950,179. |
| 应付赎回款 | | 112,629,672.70 | 15,790,572. |
| 应付管理人报酬 | | 4,307,630.63 | 2,015,558.8 |
| 应付托管费 | | 717,938.45 | 335,926. |
| 应付销售服务费 | | - | |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 12,330,642.14 | 3,173,980. |
| 应交税费 | | - | |
| 应付利息 | | - | |
| 应付利润 | | - | |
| 递延所得税负债 | | - | |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 239, 199.57 | 149,511. |
| 负债合计 | | 315,120,951.56 | 34,415,729. |
| 所有者权益 | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,451,336,124.93 | 1,600,892,516. |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,090,520,141.59 | 45,720,734. |
| 京友書相並入以 | | 2 541 856 266 52 | 1,646,613,250. |
| 所有者权益合计 | 1 1 | 3,541,856,266.52 | 1,040,013,230. |

| | | 1 | 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 5 月 27 日(基金合同 生效日) 至 2008年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 943,067,265.71 | -37,268,586.19 |
| 1.利息收入 | | 4,823,096.17 | 1,558,314.44 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,396,077.00 | 989,534.17 |
| 债券利息收入 | | 3,427,019.17 | 352,602.74 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | |
| 买人返售金融资产收入 | | - | 216,177.53 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 | | 835,901,713.74 | 125,293.83 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 819,025,777.29 | -141,052.79 |
| 基金投资收益 | | - | _ |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 415,930.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 16,460,006.45 | 266,346.62 |
| 3.公允价值变动收益 | 6.4.7.16 | 98,948,421.58 | -38,952,194.46 |
| 4.汇兑收益 | | - | |
| 5.其他收入 | 6.4.7.17 | 3,394,034.22 | |
| 二、费用 | | -58,916,113.90 | -4,155,838.76 |
| 1.管理人报酬 | | -18,809,095.31 | -2,486,343.85 |
| 2.托管费 | | -3,134,849.17 | -414,390.64 |
| 3.销售服务费 | | - | |
| 4.交易费用 | 6.4.7.18 | -36,762,539.34 | -1,213,807.02 |
| 5.利息支出 | | - | |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | - | |
| 6.其他费用 | 6.4.7.19 | -209,630.08 | -41,297.25 |
| 三、利润总额 | | 884,151,151.81 | -41,424,424.95 |
| 所得税费用 | | - | |
| 四、净利润 | | 884, 151, 151.81 | -41,424,424.95 |

| | | | 单位:人民币元 | | | |
|-------------------------------|---|------------------|-------------------|--|--|--|
| 項目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | | | | |
| 坝目 | 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) | 1,600,892,516.15 | 45,720,734.59 | 1,646,613,250.74 | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 884,151,151.81 | 884,151,151.81 | | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数 | 850,443,608.78 | 219,259,332.55 | 1,069,702,941.33 | | | |
| 其中:1.基金申购款 | 2,929,804,079.03 | 853,637,176.09 | 3,783,441,255.12 | | | |
| 2.基金赎回款 | -2,079,360,470.25 | -634,377,843.54 | -2,713,738,313.79 | | | |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动 | - | -58,611,077.36 | -58,611,077.36 | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,451,336,124.93 | 1,090,520,141.59 | 3,541,856,266.52 | | | |
| 項目 | 上年度可比期间 2008年5月27日(基金合同生效日)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) | 1,810,823,226.74 | - | 1,810,823,226.74 | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润) | - | -41,424,424.95 | -41,424,424.95 | | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数 | - | - | - | | | |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - | | | |
| 2.基金赎回款 | - | - | _ | | | |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动 | - | - | - | | | |
| 工 加士庇有老权光/社会洛佐\ | 1 910 922 226 74 | -41 424 424 05 | 1 760 309 901 70 | | | |

本报告前州宋州的尝订取课、尝订临订与成红一州牛设板首相一致。 6.4.2 差清宜正的说明 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 上来招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

基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 基金托管人、基金代销机构

| 17 基並日柱以 | | 单位:人民币元 |
|--------------------|---------------------|---------------------|
| | 本期 | 上年度可比期间 |
| 项目 | 2009年1月1日至2009年6月30 | 2008年5月27日(基金合同生效日) |
| | Ħ | 至 2008 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的管理费 | 18,809,095.31 | 2,486,343.85 |
| 其中:当期已支付 | 14,501,464.68 | 296,697.05 |
| 期末未支付 | 4,307,630.63 | 2,189,646.80 |
| :支付基金管理人嘉实基金管 | 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 |
| 月底,按月支付。其计算公式 | 大为:日管理人报酬=前一日基金资产有 | ₱值×1.50%/当年天数。 |
| 1 12 A.4 C.00 alds | | |

|) 基金托管费 | 八分:口目注八成闸-荆 口墨亚贝 | FEXISON / STRONG |
|-------------------------|---------------------|---------------------|
| 7 007301 0 11 74 | | 单位:人民币元 |
| | 本期 | 上年度可比期间 |
| 项目 | 2009年1月1日至2009年6月30 | 2008年5月27日(基金合同生效日) |
| | H | 至 2008 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的托管费 | 3,134,849.17 | 414,390.6 |
| 其中:当期已支付 | 2,416,910.72 | 49,449.5 |
| Here is a second of the | | |

| / IK日朔内基並自任八座用回有页3 | E1X贝华基亚印用UL | 份额单位:份 |
|-----------------------|--------------------------------|---|
| 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5月27日(基金合同生效 日)至2008年6月30日 |
| 期初持有的基金份额 | 40,034,200.00 | |
| 期间认购总份额 | - | 40,034,200.00 |
| 期间申购/买人总份额 | | |
| 期间因拆分增加的份额 | - | |
| 期间赎回/卖出总份额 | 40,034,200.00 | - |
| 期末持有的基金份額 | - | 40,034,200.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额 比例 | - | 2.21% |

| 6.4 | .4.5 由关联方 | 保管的银行存款余额 | 页及当期产生的利息收 | [人 | |
|-----|-----------|----------------|-------------------------|-------------------------------------|--------------|
| | | | | | 单位:人民币元 |
| | 关联方 名称 | | ×期 至 2009 年 6 月 30 日 | 上年度可 2008年 5 月 27 日(基金台 6 月 3 | 合同生效日)至2008年 |
| | | 期末余額 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | 中国银行 | 652,334,493.26 | 1,239,650.00 | 128,956,022.25 | 988,148.48 |
| 注 | 本基金的银行 | 存款由基金托管人 | 中国银行保管,按银行 | 同业利率计良 | |

| 2009年 | 6 | 月 | 30 | 日 |
|-------|---|---|----|---|
|-------|---|---|----|---|

| | | | 2007 | 1 0 7 7 5 0 1 | | | | | | | | | | |
|--------|---------|--|-------------------------|---------------|----------|--------------|------------------|-------------------|---------------------|--------------|----------|---------------------|----------------------------|---------------|
| 青选股票型证 | 券投资基金 | | | _ | | | | | | | | | 金额单位 | 立:人民币元 |
| 6月30日 | | | 单位:人民币元 | | 证券 | 证券 | 成功 | 可流 | 流通受限类 | | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末 |
| | | 本期末 | 単位:人民用元 上年度末 | | 代码 | 名称 | 认购日 | 通日 | 型 | 价格 | 值单价 | (单位:股) | 成本总额 | 估值总额 |
| E . | 附注号 | 本期末 2009年 6 月 30 日 | 上平度木 2008年 12 月 31 日 | | 600239 | 云南 城投 | 09.04.14 | 10.04.12 | 非公开发行 流通受限 | 15.18 | 13.34 | 1,080,000 | 10,929,600.00 | 14,407,200.00 |
| | | | | | 600583 | 海油 | 08.12.31 | 09.12.31 | 非公开发行 | 11.55 | 9.71 | 1 950 000 | 15,015,000.00 | 18 934 500.00 |
| | 6.4.7.1 | 652,334,493.26 | 120,781,029.46 | | | 上程 | | | 流通受限 | | | | | |
| | | 14,927,014.72 | 8,392,440.26 | 注: 6 日 16 | : (1)本z | 基金士: | 2009年4 | ,月 14 日3 八和会結4 | 参与认购云[歯Bb 末 歩気 | 和城技 : | 非公廾友 | 行股票,1人则 新增360,00 | 均数量 720,000 00 股。 2)本基 | 股,该股票寸 |
| | | _ | - | | | | | | | | | | 5 月 26 日实施 | |
| | 6.4.7.2 | 3,177,059,556.61 | 1,512,836,805.21 | 每10股 | 送1股 | と、转增4 | 4股,新增 | ₫ 650,000 | | | | | | |
| | | 2,982,475,556.61 | 1,280,698,805.21 | | | 证券类别 | | レサム土は | 寺有流通受阻 | 1 44 th il | 16 | | | |
| | | - | - | | | | ∃ 30 日 冯 引:其他 | 1本宝型4 | 守有沉ш′文四 | とわり回去 | Fo | | | |
| | | 194,584,000.00 | 232,138,000.00 | | | | | 4基金未持 | 寺有流通受阻 | l的其他 | 也证券。 | | | |
| | | _ | - | | | | 的暂时停 | | to Audotto Libbello | - samma | | | | |
| | 6.4.7.3 | _ | - | | | | | | 寺有暂时停牌 抵押的债券 | | 40 | | | |
| | 6.4.7.4 | _ | - | | | | | | 1601TH 211402F | | | | | |
| | - | _ | 18,769,583.83 | 期 | 末本基金 | 金无银行 | 行间市场 | 债券正回 | 购余额。 | | | | | |
| | 6.4.7.5 | 5,283,357,31 | 7,375,122.47 | | | | 债券正回! 目 所供类 | 购 正回购余律 | dos | | | | | |
| | 0.4.7.0 | 31203100 | /13/3/1 | | | 並元父∛ 劉祖合报 | | 止回购水 | 29U o | | | | | |
| | + | 7,372,796,18 | 12.873.998.74 | | | | 生组合情况 | 兄 | | | | | | |
| | + | 7,372,790.10 | 12,073,990.74 | | | | | | | | | | | 立:人民币元 |
| | 6.4.7.6 | - | - | . | 序号 | <u> </u> | | 项目 | | <u> </u> | 金额 | | 占基金总资产 | 的比例(%) |
| | 0.4.7.0 | 2 056 057 210 00 | 1 (01 020 070 07 | . | 1 | 权益投 | ł 资 | | | | 2,982,47 | 75,556.61 | | 77.33 |
| | + | 3,856,977,218.08 | 1,681,028,979.97 | . | <u> </u> | 其中:用 | 投票 | | | | 2,982,47 | 75,556.61 | | 77.33 |
| 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 | | | 固定收 | 7益投资 | | | | 194,58 | 34,000.00 | | 5.04 |
| | + | 2007 0 / 1 30 % | 2000-7-12/1311. | . | 2 | 其中:作 | 债券 | | | | 194,58 | 34,000.00 | | 5.04 |
| | + | | | . | | 资产支 | 7.持证券 | | | | | - | | - |
| | + | - | - | | 3 | 金融行 | 5生品投资 | ŧ | | | | - | | - |
| | 6472 | - | - | | | 买人返 | 医售金融资 | E jiha | | | | - | | - |
| this. | 6.4.7.3 | | _ | . | 4 | 其中: | 买断式回归 | | 医售金融资产 | | | - | | _ |
| 款 | + | 104 005 000 05 | 12.050.150.44 | | 5 | 银行存 | 款和结算 | 备付金合 | 计 | _ | 667,26 | 51,507.98 | | 17.30 |
| | | 184,895,868.07 | 12,950,179.44 | | 6 | 其他资 | E jiha | | | _ | 12,65 | 56,153.49 | | 0.33 |
| | | 112,629,672.70 | 15,790,572.46 | | | | 合i | it | | +- | 3,856,97 | 77.218.08 | | 100.00 |
| | | 4,307,630.63 | 2,015,558.81 | 7.2 | 期末担 | 安行业分 | }类的股票 | 票投资组合 | <u> </u> | | | | | |
| | | 717,938.45 | 335,926.46 | | | | | | | | | | | 单位:人民币元 |
| | | _ | - | . | 代码 | | fi | i业类别 | | | 公允价(| 值 | 占基金资产净 | 值比例(%) |
| | 6.4.7.7 | 12,330,642.14 | 3,173,980.14 | . | A 2 | 农、林、牡 | 女、渔业 | | | | | - | | - |
| | | - | - | | В 3 | 采掘业 | | | | | 389,0 | 33,530.49 | | 10.98 |
| | | - | | | C f | 制造业 | | | | Т | 1,152,43 | 32,902.37 | | 32.54 |
| | | - | - | | C0 1 | 食品、饮 | 料 | | | | 385,1 | 74,000.00 | | 10.87 |
| | | - | - | | C1 : | 纺织、服 | 装、皮毛 | | | | | - | | - |
| | 6.4.7.8 | 239,199.57 | 149,511.92 | | C2 2 | 木材、家 | 具 | | | | | - | | _ |
| | | 315,120,951.56 | 34,415,729.23 | | С3 3 | 造纸、印 | 剧 | | | _ | 57,2 | 68,779.90 | | 1.62 |
| | | | | | C4 . | 石油、化 | 学、塑胶、 | 塑料 | | _ | 203.0 | 73,266.53 | | 5.73 |
| | | | | | | | | | | | | | | |

| | 负债和所有者权益总计 | | 3,856,977,218.08 | -,,,- |
|-----|---|---------------|--------------------|-------------------|
| Ė | :报告截止日 2009 年 6 月 30 日, | 基金份额净值 | 11.445 元,基金份额总额 2, | 451,336,124.93 份。 |
| .2 | 利润表 | | | |
| . 1 | 1 h - A.L white his TYP of a date bit. BIT. THE MAINTEN AND | A 11 Mc 114 A | | |

| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
|------------|----------|----------------|----------------|
| 买人返售金融资产收入 | | - | 216,177.53 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 | | 835,901,713.74 | 125,293.83 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 819,025,777.29 | -141,052.79 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 415,930.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 16,460,006.45 | 266,346.62 |
| 3.公允价值变动收益 | 6.4.7.16 | 98,948,421.58 | -38,952,194.46 |
| 4.汇兑收益 | | - | - |
| 5.其他收入 | 6.4.7.17 | 3,394,034.22 | - |
| 二、费用 | | -58,916,113.90 | -4,155,838.76 |
| 1.管理人报酬 | | -18,809,095.31 | -2,486,343.85 |
| 2.托管费 | | -3,134,849.17 | -414,390.64 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.18 | -36.762.539.34 | -1.213.807.02 |

6.3 所有者权益 基金净值)变动表 会计主体:嘉实研究精选股票型证券投资基金 本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

| | | | 单位:人民币元 |
|-------------------------------|---|------------------|-------------------|
| | anna iri | 本期1月1日至2009年6 | II ao II |
| 项目 | | | |
| | 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) | 1,600,892,516.15 | 45,720,734.59 | 1,646,613,250.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润) | - | 884,151,151.81 | 884,151,151.8 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数 | 850,443,608.78 | 219,259,332.55 | 1,069,702,941.3 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,929,804,079.03 | 853,637,176.09 | 3,783,441,255.12 |
| 2.基金赎回款 | -2,079,360,470.25 | -634,377,843.54 | -2,713,738,313.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动 | - | -58,611,077.36 | -58,611,077.3 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,451,336,124.93 | 1,090,520,141.59 | 3,541,856,266.52 |
| 项目 | 上年度可比期间 2008年5月27日(基金合同生效日)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) | 1,810,823,226.74 | - | 1,810,823,226.7 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润) | - | -41,424,424.95 | -41,424,424.95 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数 | - | - | |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | |
| 2.基金赎回款 | - | _ | |
| 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) | 1,810,823,226.74 | -41,424,424.95 | 1,769,398,801.79 |

| 4 | 报表附注 |
|---|------------------------------------|
| | 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 |
| 排 | 2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。 |

0.4.5.2 平成官期与癌症发生无联交易的各关联方 类联方名称 畫实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司("中国银行") 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汇第40条党围内水是一般商业条款订立。 6.4.4 通过关联方交易单元进行的交易 来提出期本社企业部分平均分享

| 报告期本基金未通过 4.4.2 关联方报酬 1)基金管理费 | 关联方交易单元进行交易。 | 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 5 月 27 日 (基金合同生效日 至 2008 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的管理费 | 18,809,095.31 | 2,486,343.8 |

| | 项目 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年 5 月 27 日(基金合同生效日) 至 2008年 6 月 30 日 | |
|---|-----------|-------------------------------------|---|-----|
| | 当期应支付的管理费 | 18,809,095.31 | 2,486,343.85 | |
| | 其中:当期已支付 | 14,501,464.68 | 296,697.05 | |
| | 期末未支付 | 4,307,630.63 | 2,189,646.80 | |
| 玥 | | 有限公司的管理人报酬按前一日基 :日管理人报酬=前一日基金资产净 | 5金资产净值 1.50%的年费率计提,逐 净值×1.50%/当年天数。 | 日累记 |
| ~ | / 签並托目页 | | 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5月27日(基金合同生效日) 至2008年6月30日 | | | | |
|-----------------------------------|--------------------------------|---|------|--|--|--|
| 当期应支付的托管费 | 3,134,849.17 | 414,390.64 | | | | |
| 其中:当期已支付 | 2,416,910.72 | 49,449.50 | | | | |
| 期末未支付 | 717,938.45 | 364,941.14 | | | | |
| E:支付基金托管人中国银行的托管 | 管费按前一日基金资产净值 0.25% | 6的年费率计提,逐日累计至每月月底 | ₹,按月 | | | |
| 其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值x0.25%/当年天数。 | | | | | | |

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 侩回购)交易 报告期内,本基金米与关联方进行银行间同业市场的债券 侩回购)交易。 6.4.4.4 条关联方投资本基金的情况 0)报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

| f 的基金份额 | 40,034,200.00 | _ | | 70 | 000070 | PUPITULE. | |
|--|---------------------------------------|--------------------|-----|----|--------|-----------|--|
| 均总份额 | _ | 40,034,200.00 | | 71 | 002109 | 兴化股份 | |
| 5/买人总份额 | _ | | | 72 | 600208 | 新湖中宝 | |
| 京分增加的份额 | | | | 73 | 600591 | *ST 上航 | |
| 7.实出总份额 | 40.034.200.00 | _ | | 74 | 600185 | *ST 海星 | |
| i的基金份額 | 10,031,200.00 | 40,034,200,00 | | 75 | 601398 | 工商银行 | |
| T的基金份额占基金总份额 | _ | | | 76 | 002106 | 莱宝高科 | |
| THE SECULIAR CONTRACTOR OF SECULAR SEC | - | 2.21% | | 77 | 002215 | 诺普信 | |
| | 投、转换入份额,期间赎回/卖出总 | 分额含转换出份额。 2)在本基金 | 发售期 | 78 | 000718 | 苏宁环球 | |
| | 000 万元,认购费为 1,000 元。 | 時回弗泰为 0.500 | | 79 | 002269 | 美邦服饰 | |
| | 机构赎回 40,034,200 份基金份额 他关联方投资本基金的情况 | , 灰凹 页 平 /J U.30%。 | | 80 | 600470 | 六国化工 | |
| F度末其他关联方未投资本 | | | | 81 | 600439 | 瑞贝卡 | |
| | | | | | | | |

| 600239 | 云南 城投 | 09.04.14 | 10.04.12 | 非公开发行 流通受限 | 15.18 | 13.34 | 1,080,000 | 10,929,600.00 | 14,407,200.00 | 3 | |
|----------|----------------|---------------|--------------------|--|------------|-----------|-------------|----------------|---------------|---------|----------|
| 600583 | 海油 | 08.12.31 | 09.12.31 | 非公开发行 游诵受限 | 11.55 | 9.71 | 1,950,000 | 15,015,000.00 | 18,934,500.00 | 5 | 5 |
| | -1- TE | 009年4 | 月14日参 | | 城投 | 非公开发 | 行股票,认顺 | 均数量 720,000 | 股,该股票干 | 2009年 7 | 7 |
| 日实施 | 2008年 | 度资本 | 公积金转增 | 搬本,按每 | 10 股牟 | 专增5股, | 新增360,00 | 00股。 2)本基 | 金于 2008 年 1 | 2月31 | |
| | | | | | 0,000 | 股,该股 | 票于 2009年 | 5月26日实施 | E 2008 年利润分 | 分配,按 | |
| | と、特増 4 证券类別 | | ₿ 650,000 | 股。 | | | | | | 11 | |
| ナ 之限 | 証券矢カ 0 任 6 日 | 30日)7 | * 主会 去お | 持有流通受限 | 的信件类 | 16 | | | | 12 | |
|) 受限 | 证券类别 | 1:其他 | L-997F\z1 | 1 171/1/11/11/11/11 | H 2 (94.5) | J-0 | | | | 13 | |
| | | | 本基金未持 | 持有流通受限 | 的其他 | 也证券。 | | | | 14 | |
| .5.2 募 | 末持有的 | 的暂时停 | 牌股票 | | | | | | | 16 | |
| 末 200 | 9年6月 | 30日)2 | 4基金未织 | 好有暂时停 牌 | 的股易 | ii. | | | | 17 | |
| .5.3 期 | 末惯券 间市场信 | 上回购交 | 易中作为 | 抵押的债券 | | | | | | 18 | |
| ナ 木 払 | 全无组织 | が正凹 | 内 债券正回り | 协全额. | | | | | | 19 | |
|) 交易 | 所市场信 | 券正回 | 购 | 63/4/10/0 | | | | | | 21 | |
| 末本基 | 金无交易 | 易所债券 | 正回购余额 | 领。 | | | | | | 22 | |
| | 组合报 | | - | | | | | | | 23 | |
| 期末 | 基金资产 | 组合情况 | 兄 | | | | | A demak I | | 24 | |
| | 1 | | | | _ | | | | 7:人民币元 | 25 | |
| 序号 | | | 项目 | | | 金额 | | 占基金总资产 | | 20 | |
| 1 | 权益投 | 资 | | | | 2,982,47 | 75,556.61 | | 77.33 | 28 | 8 |
| 1 | 其中: 图 | 支票 | | | | 2,982,47 | 75,556.61 | | 77.33 | 29 | 9 |
| | 固定收 | 益投资 | | | | 194,58 | 34,000.00 | | 5.04 | 30 | |
| 2 | 其中:他 | | | | | | 34,000.00 | | 5.04 | 31 | |
| - | | | | | | 194,30 | ,,,000.00 | | 3.04 | 32 | |
| | 资产支 | | _ | | - | | - | | | 34 | 4 |
| 3 | 金融衍 | 生品投资 | 1 | | | | - | | _ | 35 | |
| 4 | 买人返 | 售金融资 | £ ji ^{te} | | | | - | | - | 36 | |
| 4 | 其中:3 | (断式回 | 购的买人返 | 語售金融资产 | | | - | | - | 37 | |
| 5 | 银行存 | 款和结算 | 备付金合 | it | | 667.20 | 51,507.98 | | 17.30 | 39 | |
| 6 | 其他资 | | | | | | 56,153.49 | | 0.33 | 40 | |
| 0 | 大臣贝 | , 合 | 2.1 | | | | | | | 41 | |
| #0-1-1 | obed= II. A | | | | | 3,856,9 | 77,218.08 | | 100.00 | 42 | |
| - 別木1 | 女仃业为 | '尖的胶》 | 票投资组合 | î | | | | A-WEI | 位:人民币元 | 43 | |
| 43-411 | | 41 | 5.11, We Did | | _ | 11 42 11 | hts: | | | 45 | |
| 代码 | | | f业类别 | | | 公允价 | IH. | 占基金资产净 | 且比例(%) | 46 | |
| A | 农、林、书 | (、渔业 | | | | | - | | _ | 47 | |
| В | 采掘业 | | | | | 389,0 | 33,530.49 | | 10.98 | 48 | |
| С | 制造业 | | | | | 1,152,4 | 32,902.37 | | 32.54 | 49 | |
| CO | 食品、饮 | 料 | | | | 385.1 | 74,000.00 | | 10.87 | 51 | |
| _ | 纺织、服 | | | | | ,. | , | | | 52 | |
| - | | | | | | | _ | | | 53 | |
| C2 | 木材、家 | | | | | | - | | | 54 | |
| C3 | 造纸、印 | | | | | | 68,779.90 | | 1.62 | 55 | |
| C4 | 石油、化 | 学、塑胶、 | ,塑料 | | | 203,0 | 73,266.53 | | 5.73 | 57 | |
| C5 | 电子 | | | | | | - | | - | 58 | |
| C6 | 金属、非 | 金属 | | | | | - | | - | 59 | |
| C7 | 机械、设 | 各位表 | | | | 211_6 | 97,726.30 | | 5.98 | 60 | |
| C8 | 医药、生 | | | | | | 19,129.64 | | 8.34 | 61 | |
| | | | | | | 293,2 | 19,129.04 | | 0.34 | 63 | |
| C99 | 其他制设 | | | to II | | | - | | | . 64 | 4 |
| D | 电力、煤 | 气及水的 | 生产和供品 | 並业 | | 69,7 | 00,000.00 | | 1.97 | 65 | |
| E | 建筑业 | | | | | 269,2 | 43,397.01 | | 7.60 | 66 | |
| F | 交通运输 | 1、仓储业 | | | | | - | | - | 68 | |
| G | 信息技术 | | | | | 298.1 | 65,765.12 | | 8.42 | 69 | |
| Н | 批发和零 | | | | | | _ | | | 70 | |
| I | | | | | - | 720 | 42 045 52 | | 20.59 | 71 | |
| - | 金融、保 | | | | | | 43,045.53 | | | 72 | |
| J | 房地产业 | | | | | 74,4 | 56,916.09 | | 2.10 | 74 | |
| K | 社会服务 | ·业 | | | | | - | | - | 75 | |
| L | 传播与文 | 化产业 | | | | | - | | - | 76 | |
| M | 综合类 | | | | | | - | | _ | 77 | |
| | 合计 | | | | | 2 982 4 | 75,556.61 | | 84.21 | 78 | |
| 加末 | | 値占其る | 会资产净值 | 1比例大小排 | 序的官 | | | | 04.21 | 80 | |
| 791/11/1 | ~~/6// | Per 1-1 SIR 2 | mc 947 19711 | ************************************** | - 1- H3 H | o i diang | V1×7×19.120 | 金額自 | 位:人民币元 | 81 | |
| 序号 | 股票代 | 673 80 | 2票名称 | 数量(股) | | 公允任 | · 佰 | 占基金资产净 | | 82 | 2 |
| | 60058 | | A | 24,681,6 | 16 | | 49.860.35 | H CH M. J. 199 | 8.13 | 83 | _ |
| 1 | | | | 2.,,,. | | | | | | 84 | <u> </u> |
| 2 | 00000 | _ | F发展 A | 12,500,0 | _ | | 50,000.00 | | 7.70 | 82 | |
| 3 | 60001 | 6 🗵 | 是生银行 | 29,499,7 | 55 | 233,6 | 38,059.60 | | 6.60 | 87 | |
| 4 | 60139 | D # | 国中铁 | 27,529,2 | 9 | 186,9 | 23,397.01 | | 5.28 | 88 | |
| 5 | 60051 | _ | t州茅台 | 900,0 | | | 09,000.00 | | 3.76 | 89 | <u>_</u> |
| 6 | 00089 | | 江发展 | 3,700,0 | _ | ,- | 00.000,00 | | 3.76 | 90 | |
| 7 | | _ | | | _ | | | | | 92 | |
| | 00096 | _ | - 东医药 | 9,199,3 | _ | | 96,252.26 | | 3.34 | 93 | |
| 8 | 60005 | U I | 国联通 | 16,200,0 | Ю | 111,1 | 32,000.00 | | 3.14 | 94 | 4 |
| | | | | | | | | | | | |

9 600169 太原東工 8,000,000 109,840,000,00 10 000063 中兴重报 3,860,000 108,466,000,000 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 fup:# 半年度报告正义。 7.4 报告期以股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产单值 2%的股票明细

| 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 | 000001 | 深发展 A | 656,402,794.35 | 39.86 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 519,487,016.00 | 31.55 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 428,167,342.28 | 26.00 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 425,908,552.75 | 25.87 |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 405,126,379.60 | 24.60 |
| 6 | 600050 | 中国联通 | 378,042,528.06 | 22.90 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 341,896,173.99 | 20.76 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 336,753,900.79 | 20.4 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 325,041,099.48 | 19.7 |
| 10 | 600583 | 海油工程 | 275,289,867.72 | 16.7 |
| 11 | 601390 | 中国中铁 | 232,081,309.73 | 14.0 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 218,637,445.14 | 13.2 |
| 13 | 601628 | 中国人寿 | 205,392,849.40 | 12.4 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 194,392,490.57 | 11.8 |
| 15 | 600795 | 国电电力 | 191,249,647.97 | 11.6 |
| 16 | 601666 | 平煤股份 | 177,099,010.94 | 10.7 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 172,595,827.05 | 10.4 |
| 18 | 000568 | 泸州老客 | 172,228,086.32 | 10.4 |
| 19 | 601088 | 中国神华 | 163,140,166.58 | 9.9 |
| 20 | 600029 | 南方航空 | 163,011,725.69 | 9.9 |
| 21 | 000002 | 万 科 A | 157,732,666.60 | 9.5 |
| 22 | 600048 | 保利地产 | 156,405,299.47 | 9.5 |
| 23 | 601186 | 中国铁建 | 155,259,779.02 | 9.4 |
| 24 | 600169 | 太原重工 | 153,061,960.88 | 9.3 |
| 25 | 600973 | 宝胜股份 | 139,048,676.84 | 8.4 |
| 26 | 000963 | 华东医药 | 125,429,042.97 | 7.6 |
| 27 | 000063 | 中兴通讯 | 124,123,015.22 | 7.5 |
| 28 | 600030 | 中信证券 | 119,241,271.28 | 7.2 |
| 29 | 000895 | 双汇发展 | 115,528,303.12 | 7.0 |
| 30 | 600664 | 哈药股份 | 113,227,973.13 | 6.8 |
| 31 | 000651 | 格力电器 | 113,035,590.12 | 6.8 |
| 32 | 600015 | 华夏银行 | 108,528,281.53 | 6.5 |
| 33 | 601857 | 中国石油 | 107,659,404.91 | 6.5 |
| 34 | 000059 | 辽通化工 | 106,735,789.34 | 6.4 |
| 35 | 000527 | 美的电器 | 106,256,654.18 | 6.4 |
| 36 | 000402 | 金融街 | 103,474,708.05 | 6.2 |
| 37 | 600887 | *ST 伊利 | 99,927,840.10 | 6.0 |
| 38 | 600325 | 华发股份 | 96,641,375.77 | 5.8 |
| 39 | 600804 | 鹏博士 | 96,446,860.69 | 5.8 |
| 40 | 600383 | 金地集团 | 94,597,302.47 | 5.7 |
| 41 | 000910 | 大亚科技 | 94,494,454.28 | 5.7 |
| 42 | 600104 | 上海汽车 | 93,434,755.13 | 5.6 |
| 43 | 600582 | 天地科技 | 88,494,985.20 | 5.3 |
| 44 | 600027 | 华电国际 | 86,685,134.67 | 5.2 |
| 45 | 600005 | 武钢股份 | 85,370,820.87 | 5.1 |
| 46 | 000858 | 五 粮 液 | 84,296,965.66 | 5.1 |
| 47 | 600089 | 特変电工 | 81,750,253.05 | 4.9 |

| 25 | 000,10 | | | |
|----|--------|--------|----------------|------|
| 26 | 000963 | 华东医药 | 125,429,042.97 | 7.62 |
| 27 | 000063 | 中兴通讯 | 124,123,015.22 | 7.54 |
| 28 | 600030 | 中信证券 | 119,241,271.28 | 7.24 |
| 29 | 000895 | 双汇发展 | 115,528,303,12 | 7.02 |
| 30 | 600664 | 哈药股份 | 113,227,973.13 | 6.88 |
| | | | | |
| 31 | 000651 | 格力电器 | 113,035,590.12 | 6.86 |
| 32 | 600015 | 华夏银行 | 108,528,281.53 | 6.59 |
| 33 | 601857 | 中国石油 | 107,659,404.91 | 6.54 |
| 34 | 000059 | 辽通化工 | 106,735,789.34 | 6.48 |
| 35 | 000527 | 美的电器 | 106,256,654.18 | 6.45 |
| 36 | 000402 | 金融街 | 103,474,708.05 | 6.28 |
| 37 | 600887 | *ST 伊利 | 99,927,840.10 | 6.07 |
| 38 | 600325 | 华发股份 | | |
| | | | 96,641,375.77 | 5.87 |
| 39 | 600804 | 鹏博士 | 96,446,860.69 | 5.86 |
| 40 | 600383 | 金地集团 | 94,597,302.47 | 5.74 |
| 41 | 000910 | 大亚科技 | 94,494,454.28 | 5.74 |
| 42 | 600104 | 上海汽车 | 93,434,755.13 | 5.67 |
| 43 | 600582 | 天地科技 | 88,494,985,20 | 5.37 |
| 44 | 600027 | 华电国际 | 86,685,134.67 | 5.26 |
| 44 | | | | |
| | 600005 | 武钢股份 | 85,370,820.87 | 5.18 |
| 46 | 000858 | 五粮液 | 84,296,965.66 | 5.12 |
| 47 | 600089 | 特变电工 | 81,750,253.05 | 4.96 |
| 48 | 000709 | 唐钢股份 | 75,624,962.72 | 4.59 |
| 49 | 600289 | 亿阳信通 | 74,175,509.25 | 4.50 |
| 50 | 600396 | 金山股份 | 71,067,886.36 | 4.32 |
| | | | | |
| 51 | 600037 | 歌华有线 | 70,888,298.06 | 4.31 |
| 52 | 000061 | 农产品 | 70,259,046.67 | 4.27 |
| 53 | 600001 | 邯郸钢铁 | 68,642,451.82 | 4.17 |
| 54 | 600231 | 凌钢股份 | 68,226,076.60 | 4.14 |
| 55 | 000525 | 红太阳 | 59,914,668.38 | 3.64 |
| 56 | 601998 | 中信银行 | 59,864,598.91 | 3.64 |
| 57 | 600352 | 浙江龙盛 | 59,238,222,78 | 3.60 |
| 58 | 000322 | 湖北宜化 | 57,590,483.66 | 3.50 |
| 59 | 000422 | 中联重科 | 56,682,371.43 | 3.44 |
| | | | | |
| 60 | 600693 | 东百集团 | 56,347,167.83 | 3.42 |
| 61 | 601699 | 潞安环能 | 55,674,951.10 | 3.38 |
| 62 | 002242 | 九阳股份 | 55,160,207.39 | 3.35 |
| 63 | 000550 | 江铃汽车 | 54,577,042.11 | 3.31 |
| 64 | 600277 | 亿利能源 | 53,563,429.10 | 3.25 |
| 65 | 000960 | 锡业股份 | 51,322,452.39 | 3.12 |
| 66 | 600406 | 国电南瑞 | 50,689,442.69 | 3.08 |
| 67 | 601939 | 建设银行 | | 2.95 |
| | | | 48,627,366.00 | |
| 68 | 600067 | 冠城大通 | 48,620,460.91 | 2.95 |
| 69 | 600348 | 国阳新能 | 47,817,126.04 | 2.90 |
| 70 | 000698 | 沈阳化工 | 46,843,738.00 | 2.84 |
| 71 | 002109 | 兴化股份 | 45,327,623.03 | 2.75 |
| 72 | 600208 | 新湖中宝 | 44,474,596.95 | 2.70 |
| 73 | 600591 | *ST 上航 | 44,106,885.78 | 2.68 |
| 74 | 600185 | *ST 海星 | 43,732,468.94 | 2.66 |
| | | | | |
| 75 | 601398 | 工商银行 | 42,840,000.00 | 2.60 |
| 76 | 002106 | 莱宝高科 | 41,742,377.25 | 2.54 |
| 77 | 002215 | 诺普信 | 40,971,703.67 | 2.49 |
| 78 | 000718 | 苏宁环球 | 40,750,985.69 | 2.47 |
| 79 | 002269 | 美邦服饰 | 40,049,463.59 | 2.43 |
| 80 | 600470 | 六国化工 | 39,082,755.31 | 2.37 |
| 81 | 600439 | 瑞贝卡 | 38,579,750.03 | 2.34 |
| | | | | |
| 82 | 000839 | 中信国安 | 37,856,323.53 | 2.30 |
| 83 | 000024 | 招商地产 | 36,950,002.79 | 2.24 |
| 84 | 600196 | 复星医药 | 35,855,999.16 | 2.18 |
| 85 | 002254 | 烟台氨纶 | 35,464,295.68 | 2.15 |
| 86 | 600723 | 西单商场 | 35,363,021.73 | 2.15 |
| 87 | 600031 | 三一重工 | 35,279,795.61 | 2.14 |
| 88 | 000623 | 吉林敖东 | 34.947.222.21 | 2.14 |
| | | | | |
| 89 | 002028 | 思源电气 | 34,095,911.54 | 2.07 |
| 90 | 601328 | 交通银行 | 33,457,319.12 | 2.03 |
| 91 | 600754 | 锦江股份 | 32,949,494.17 | 2.00 |

| | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计实出金额 | 金额单位:人民币元 占期初基金资产净值比例(%) |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 598,662,105.93 | 36. |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 473,826,081.25 | 28. |
| 4 | 000001 600028 | 深发展 A 中国石化 | 445,231,548.32 410,608,051.39 | 27. |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 352,724,206.05 | 21. |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 339,233,552.51 | 20. |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 334,570,571.88 | 20. |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 中国联通 | 275,770,523.13 | 16. |
| 10 | 600050 601628 | 中国状理 | 261,093,977.02 211,189,324.85 | 15. |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 196,794,123.82 | 11 |
| 12 | 601601 | 中国太保 | 192,926,315.83 | - 11 |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 188,762,713.46 | - 11 |
| 14 15 | 601088 600029 | 中国神华南方航空 | 184,146,589.25 179,723,394.67 | 11 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 165,635,779.03 | 10 |
| 17 | 600015 | 华夏银行 | 162,283,914.76 | 9 |
| 18 | 000568 | 泸州老客 | 156,815,609.34 | 9 |
| 19 | 601666 | 平煤股份 | 149, 122, 003.59 | 9 |
| 20 21 | 000002 600795 | 万 科 A 国电电力 | 138,031,030.76 135,146,679.36 | 8 |
| 22 | 600000 | 油发银行 | 128,206,683.75 | 7 |
| 23 | 600383 | 金地集团 | 127, 164, 622.65 | 7 |
| 24 | 600030 | 中信证券 | 123,390,576.72 | 7 |
| 25 | 000059 | 辽通化工 | 115,752,016.32 | 7 |
| 26 | 600325 | 华发股份 | 113,814,669.95 | 6 |
| 27 28 | 600396 600804 | 金山股份 | 111,371,853.93 | 6 |
| 28 29 | 601857 | 鹏博士 中国石油 | 109,943,286.07 109,569,658.30 | 6 |
| 30 | 000402 | 金融街 | 105,705,879.48 | 6 |
| 31 | 600104 | 上海汽车 | 100,928,974.63 | 6 |
| 32 | 600582 | 天地科技 | 95,328,661.75 | 5 |
| 33 | 601186 | 中国铁建 | 95,042,294.95 | |
| 34 35 | 600406 000895 | 国电南瑞 双汇发展 | 92,970,977.79 88,952,983.41 | 5 |
| 36 | 000895 | 五 粮 液 | 88,952,983.41 88,257,410.88 | 5 |
| 37 | 600005 | 武钢股份 | 87,370,926.65 | 5 |
| 38 | 002269 | 美邦服饰 | 87,033,290.93 | 5 |
| 39 | 600027 | 华电国际 | 82,799,400.57 | 5 |
| 40 | 600289 | 亿阳信通 | 81,350,139.04 | 4 |
| 41 | 600089 000709 | 特变电工 唐钢股份 | 79,948,506.29 76,979,558.25 | 4 |
| 43 | 600231 | 凌钢股份 | 76,848,478.16 | 4 |
| 44 | 600001 | 邯郸钢铁 | 73,307,159.83 | 4 |
| 45 | 002202 | 金风科技 | 70,999,344.23 | 4 |
| 46 | 000061 | 农产品 | 70,483,379.58 | 4 |
| 47 | 600037 | 歌华有线 | 68,103,956.63 | 4 |
| 48 49 | 600693 002242 | 东百集团 九阳股份 | 68,026,289.80 65,555,331.82 | 4 |
| 50 | 000157 | 中联重科 | 63,814,137.02 | 3 |
| 51 | 000550 | 江铃汽车 | 61,623,108.82 | 3 |
| 52 | 601699 | 潞安环能 | 60,584,592.99 | 3 |
| 53 | 600277 | 亿利能源 | 58,601,049.49 | 3 |
| 54 55 | 000422 600315 | 湖北宜化 上海家化 | 56,955,437.81 | 3 |
| 56 | 600973 | 宝胜股份 | 56,939,325.49 56,241,181.96 | 3 |
| 57 | 600067 | 冠城大通 | 55,828,603.80 | 3 |
| 58 | 000538 | 云南白药 | 54,007,229.25 | 3 |
| 59 | 600348 | 国阳新能 | 53,995,221.34 | 3 |
| 60 | 600859 | 王府井 | 52,540,543.53 | 3 |
| 61 62 | 002106 002028 | 業宝高科 思源电气 | 51,865,322.94 51,195,040.84 | 3 |
| 63 | 600208 | 新湖中宝 | 49,027,002.70 | 2 |
| 64 | 000960 | 锡业股份 | 48,780,243.04 | 2 |
| 65 | 601390 | 中国中铁 | 48,613,730.86 | 2 |
| 66 | 601939 | 建设银行 | 48,122,798.07 | 2 |
| 67 68 | 601001 600185 | 大同煤业 *ST海星 | 47,617,250.22 47,297,753.78 | 2 |
| 69 | 002109 | 兴化股份 | 47,297,753.78 | 2 |
| 70 | 000910 | 大亚科技 | 46,130,786.89 | |
| 71 | 000698 | 沈阳化工 | 45,793,810.51 | 2 |
| 72 | 000848 | 承德露露 | 45,739,381.16 | 2 |
| 73 74 | 601398 | 工商银行 姜的电器 | 45,175,022.66 | 2 |
| 74 75 | 000527 600169 | 表的电器 太原重工 | 43,624,169.45 43,303,652.72 | 2 |
| 76 | 000680 | 山推股份 | 43,090,039.28 | |
| 77 | 000729 | 燕京啤酒 | 42,924,188.49 | 2 |
| 78 | 600470 | 六国化工 | 42,865,558.78 | 2 |
| 79 | 000718 | 亦宁环球 ★ST上航 | 42,738,097.58 | 2 |
| 80 81 | 600591 600551 | サ代出版 时代出版 | 41,840,305.34 40,262,440.68 | 2 |
| 82 | 600439 | 瑞贝卡 | 39,970,158.04 | |
| 83 | 600588 | 用友软件 | 39,650,594.79 | 2 |
| 84 | 000400 | 许继电气 | 38,555,847.00 | 2 |
| 85 | 000839 | 中信国安 | 38,418,127.58 | 2 |
| 86 | 600024 | 招商地产 | 36,851,918.33 | 2 |
| 87 88 | 600031 600196 | 三一重工 复星医药 | 36,844,523.71 36,347,534.02 | 2 |
| 89 | 600196 | 天威保变 | 35,586,853.82 | 2 |
| 90 | 600664 | 哈药股份 | 35,107,762.37 | 2 |
| | 000623 | 吉林敖东 | 34,253,691.38 | 2 |
| | 600754 | 锦江股份 | 33,663,142.33 | 2 |
| 91 92 | 600694 | 大商股份 | 33,537,958.81 | 2 |
| 92 93 | | \$17 ASS TO VALUE | | |
| 92 93 94 | 600660 | 福耀玻璃 S上石化 | 33,387,435.41 | 2 |
| 92 93 94 95 96 | 600660 600688 600479 | 福耀玻璃 S上石化 千金药业 页及实出股票的收 | 33,362,832.94 33,031,052.42 | 2 2 2 |

| | 94 | 600660 | TSH JHE ACK JUST | | 33,367,433.41 | 2.03 | | |
|---|------------------------------------|---|--|------------------------------------|--------------------|---|-----|--|
| | 95 | 600688 | S上石化 | | 33,362,832.94 | 2.03 | | |
| | 96 | 600479 | 千金药业 | | 33,031,052.42 | 2.01 | | |
| 7.4 | .3 买入 | 股票的成本总 | 额及卖出股票的收 | 文人总额 | | 单位:人民币元 | | |
| | 买人股? | 票成本(成交)总 | 京 额 | | | 12,515,674,206.21 | | |
| | 零出股3 | 票收入(成交)总 | ė. 1996 | | | 11,734,307,978.68 | | |
| 注 | | | | " 15 7 4 3 Int 1 | 工人股票成本"。 | 、实出股票收入"均按头入或卖出 | 成なる | |
| 60×3 | 单价乘 | 以成交数量量 | 直列,不考虑相关? | 5易费用。 | 277 (1122)11/104-1 | SHIPS AND | /4/ | |
| | | | 的债券投资组合 | | | | | |
| | | | | | | 金额单位:人民币元 | | |
| | 序号 | | 债券品种 | - 2 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | | |
| | 1 | 国家债券 | | | - | _ | | |
| | 2 | 央行票据 | | | 154,640,000.00 | 4.37 | | |
| | 3 | 金融债券 | | | 39,944,000.00 | 1.13 | | |
| | | 其中:政策性 | E金融债 | | 39,944,000.00 | 1.13 | | |
| | 4 | 企业债券 | | | | _ | | |
| | 5 | 企业短期融 | 贸 券 | | - | | | |
| | - 6 | 可转债 | uli . | | | | | |
| | 7 8 | 资产支持证 | | | | | | |
| | - 8 | 其他 | + | | 194,584,000.00 | 5,49 | 1 | |
| 7.6 | 101-1739 | | xx 金安产净值比例: | F/1311-72 00100 | | | 1 | |
| 7.0 | 3917/~13 | | SME DU PHELLIPI. | V/J 19H-4DHJHI | ユエイコ川クアススパウ | 金额单位:人民币元 | | |
| | 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | | |
| | 1 | 0801104 | 08央票 104 | 1,600,000 | 154,640,000.0 | 00 4.37 | | |
| | 2 | 090404 | 09农发 04 | 400,000 | 39,944,000.0 | 00 1.13 | | |
| 7.7 报 7.8 报 7.9 7.9 (4) | 期期期末接, 指来接, 指来接, 指,指,并是一个人,并不是一个人。 | 公允价值占基本基金 公允价值占基本基金价值占基本基金 法持有 人名英格兰 人名英格兰人姓氏格兰 人名英格兰人姓氏格兰人名 人名英格兰人姓氏格兰人名 人名英格兰人姓氏格兰人名 化二苯基 人名英格兰人姓氏格兰人名 人名英格兰人姓氏格兰人名 人名英格兰人姓氏格兰人名 化二苯基氏 化二苯基 化二苯基氏 化二苯基 化二苯基氏 化二苯基 化二苯基氏 化二苯基 化二苯基氏 化二苯基 化二苯基 化二苯基 化二苯基 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基氏 化二苯基 化二苯 | 有上述2只债券。 金资产净值比例: 资产支持证券。 金资产净值比例: 权证。 资的前十名证券的 未受到公开谴责和 名股票中,没有超 | 大小排名的前 大小排名的前 以发行主体未补 处罚。 | 五名权证投资明 坡监管部门立案 | 月细 调查,在本报告编制日前一年内本 享之外的股票。 | 基金投 | |
| | | | | | | 66 AV 1 EP EF EF | | |

| | 单位:人民币元 |
|---|---|
| 名称 | 金额 |
| 存出保证金 | - |
| 应收证券清算款 | _ |
| 应收股利 | - |
| 应收利息 | 5,283,357.31 |
| 应收申购款 | 7,372,796.18 |
| 其他应收款 | _ |
| 待摊费用 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 12,656,153.49 |
| 也资产"为报告期末 2009 年 6 月 30 日 有的处于转股期的可转换债券明细 基金未持有处于转股期的可转换债券。 一名股票中存在流通受限情况的说明 | 的金额。 金额单位, 人民币 |
| | 好出降 证金 近程度原列 近程度限列 近程度利息 近程度利息 近程性的原 方程度的原 方种度用 支性。 方种度用 支性。 方种度用 大性。 方性。 方性。 方性。 方性。 方性。 方性。 方性。 方 |

| 序号 股票代码 股票名 | | 称 | 流通受限部分 公允价值 | 的 占基金资产净值 比例(%) | | 流通受限情况说明 | | | | | |
|-------------|----------------------------|---------|---------------------|--------------------|----|-----------------|------------|------------|----------|---------|------------|
| | 1 | |)583 | 海油工 | 程 | 18,934,50 | 00.00 | | 0.53 | 非公开 | 发行流通受限 |
| § 8.1 | 8 基金 期末基 | 份额持金份 | 持有人信 领持有。 | 息 人户数及 | 持有 | | | | | | 份额单位:份 |
| | | | | | | | | 持有 | 人结构 | | |
| | 持有人 户均持有的 | | | 机构投资者 | | | 个人投资者 | | | 者 | |
| | 户数(| 中数(户) 基 | | 基金份额 | | 持有份额 | 占总份额 比例 | | 持有份额 | | 占总份额 比例 |
| | 25 | 5,554 | 95 | ,927.69 | 1 | ,777,955,814.14 | | 72.53% | 673,380 | ,310.79 | 27.47% |
| 8.2 | 期末基 | 金管理 | 里人的人 | 人业人员 | 持有 | 本井放式基金的 | 情况 | | | | |
| | 项目 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | | | | | | 持有份额总数(份) | | 占基金总份额比例 | | |
| | | | | | | | | 832,835.16 | | | 0.0340% |
| 8 | 9 开放 | 式基金 | 6份额4 | 5.3 | | | | | | | |

| 3 | O 71 MARGE III 10 10 20 47 | 单位:份 |
|----------|--|------------------|
| | 基金合同生效日(2008年5月27日)基金份额总额 | 1,810,823,226.74 |
| | 报告期期初基金份额总额 | 1,600,892,516.15 |
| | 报告期期间基金总申购份额 | 2,929,804,079.03 |
| | 报告期期间基金总赎回份额 | 2,079,360,470.25 |
| | 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| | 报告期期末基金份额总额 | 2,451,336,124.93 |
| \$ 10 | 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换人份额, 10 重大事件揭示 1 基金份额持有人大会决议 | 甚金总赎回份额含转换出份额。 |

8 10 重大事件制定 10.1 基金价额特有人大会决议 报告期外来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的重大人事变动。 报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。 10.3 涉及基金管理人、基金附产、基金托管业务的诉讼 报告期外无涉及本基金管理人、基金附产、基金托管业务的诉讼事项。 10.4 基金投资额的改变 报告期内本基金投资额路次变生改变。 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 报告期内本基金未改顺为其审计的会计师事务所,会计师事务所为曹华永道中天会计师事务所有限公司。 10.6 宫型人、社管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。 10.7 基金使用让多公司交易单元的有关情况。 10.7 基金使用让多公司交易单元的有关情况。 金额单位:人民币元

| | | 股單字級 | 应支付该券商 | | | |
|-------------------|---------|------------------|-------------|--------------|-----------|-----------|
| | 交易 | | 占当期股 | | 占当期 | |
| 券 । 名 称 | 单元 | 成交金額 | 300 | 9H :0: | 佣金 | 备注 |
| | 70 Mile | | 成交总额 的比例 | D 13 | 总量的 比例 | |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2 | 3,273,768,362.09 | 13.51% | 2,659,959.16 | 13.07% | 粉汁给 1 1 |
| 中国国际金融有限公司 | 3 | 2,708,863,671.68 | 11.18% | 2,302,516.64 | 11.31% | 和1倍2 |
| 安信证券股份有限公司 | 2 | 2,453,067,235.27 | 10.12% | 2,085,100.37 | 10.25% | 新地 1 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 3 | 2,120,469,270.65 | 8.75% | 1,802,387.27 | 8.86% | 新増 2 |
| 瑞银证券有限责任公司 | 1 | 2,050,368,658.70 | 8.46% | 1,742,810.76 | 8.56% | 8F; 100 |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 1,791,395,177,71 | 7.39% | 1,522,676,76 | 7.48% | _ |
| 国金证券股份有限公司 | 2 | 1,694,551,561.07 | 6.99% | 1,440,362,03 | 7.08% | 新培 1 |
| 英大证券有限责任公司 | 2 | 1.299.548.639.27 | 5.36% | 1.055.894.03 | 5.19% | _ |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 4 | 1.226.556.589.33 | 5.06% | 1.041.839.29 | 5.12% | 新地 2 イ |
| 海通证券股份有限公司 | 3 | 1.225.242.212.44 | 5.05% | 1.041.453.56 | 5.12% | 9万199 2 イ |
| 中信建投证券有限责任公司 | 3 | 1.101.199.336.35 | 4.54% | 936,016.62 | 4.60% | 9万199 2 イ |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 904.149.616.07 | 3.73% | 734.629.12 | 3.61% | _ |
| 中信证券股份有限公司 | 3 | 867,965,456,79 | 3.58% | 718,246,77 | 3.53% | 新増 1 1 |
| 湘財证券有限责任公司 | 1 | 685,839,220.16 | 2.83% | 582,958.21 | 2.86% | |
| 齐鲁证券有限公司 | i | 356,144,692,23 | 1.47% | 289,369,77 | 1.42% | _ |
| 长江证券股份有限公司 | i | 328.872.158.68 | 1.36% | 267.210.62 | 1.31% | SH: 100 |
| 国信证券股份有限公司 | i | 106.930.332.65 | 0.44% | 90.892.76 | 0.45% | |
| 集宝证券经纪有限责任公司 | i | 44.120.393.75 | 0.18% | 37,503.03 | 0.18% | |
| 謝海证業股份有限公司 | i | | | | - | 817 109 |
| 长城证券有限责任公司 | 2 | _ | _ | _ | _ | 粉柱的 2 イ |
| 大通证券股份有限公司 | 1 | _ | _ | | _ | 8F 199 |
| 东北证券股份有限公司 | 2 | _ | _ | | - | 新增 2 1 |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | _ | _ | | _ | 8F 199 |
| 东海证券有限责任公司 | i | _ | _ | _ | _ | 8行 2倍 |
| 东吴证券有限责任公司 | i | _ | _ | _ | _ | 8行 2倍 |
| 北京高华证券有限责任公司 | i | _ | _ | _ | _ | 8F; ±99 |
| 广发华福证券有限责任公司 | i | _ | _ | _ | _ | 817 109 |
| 广发证券股份有限公司 | i | _ | _ | _ | _ | 817 109 |
| 宏源证券股份有限公司 | - 1 | _ | _ | | _ | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 2 | _ | _ | | _ | 新増21 |
| 江南证券有限责任公司 | 1 | | _ | | _ | 8F 199 |
| 联合证券有限责任公司 | 2 | _ | _ | | _ | - |
| 平安证券有限责任公司 | 1 | _ | _ | | _ | 20T F首 |
| 新时代证券有限责任公司 | 1 | _ | _ | _ | - | 817 ±10 |
| 信泰证券有限责任公司 | 1 | _ | _ | _ | - | SEE 199 |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | _ | _ | _ | - | 857.700 |
| 海南证券有限青年公司 | i | _ | _ | | _ | 817 199 |
| 中国建银投资证券有限责任 | _ | | _ | | _ | |
| 公司 | 2 | _ | - | - | - | 新始 2 个 |
| 中信金通证券有限责任公司 | 1 | _ | - | | _ | 8F 20 |
| 中银国际证券有限责任公司 | i | _ | _ | | _ | 817 109 |
| 1:本表 佣金"指本基金通过 | | | | | | |

□理問題等為提供於20日 1 分面的交易单元进行股票,权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。注:2、交易单元的选择标准和程序 1 整管 7 为规范 在少一年内无重大违规行为; 2 公司财务状况限转; 2 公司财务状况限转; 3 有良好的声誉; 3 有良好的冲控制度, 在业内有良好的声誉; 4 有权强的研究能力,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基本,提供有1的研究报告; 6 建立了广泛的信息网络,能发射播供准确地信息资讯服务。 6 建立了广泛的信息网络,能发射播供准确地信息资讯服务。 基金管理人与被选择的券商签订协议,并通知基金代偿人。 10.2 债券交易,无 10.3 债券归购交易。 10.2 债券交易,无 10.3 债券归购交易。 10.2 债券公易,无 10.1 投证交易,无 10.1 投证交易,无 10.1 投证交易,无 10.1 投证交易,无 10.1 投证交易,无 10.1 经证证分别。 10.2 债券公易,无 10.3 债券归购交易,元 10.3 债券归购交易,元 10.4 投证交易,元 10.4 投证交易,元 10.5 债务归购交易,元 10.5 债务归购公司,否询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话 400-600~8800.或发 E-mail: service(新加州人西