

嘉实策略增长混合型证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 日

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2009 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示和目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	4
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
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.....	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	8
§5 托管人报告.....	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	9
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.....	9
§6 半年度财务会计报告.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	10
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	11
6.4 报表附注.....	12
§7 投资组合报告.....	25

7.1 期末基金资产组合情况.....	25
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	25
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	26
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	28
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	29
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	30
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	30
7.9 投资组合报告附注.....	30
§8 基金份额持有人信息.....	31
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	31
§9 开放式基金份额变动.....	31
§10 重大事件揭示.....	31
10.1 基金份额持有人大会决议.....	31
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.....	31
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	31
10.4 基金投资策略的改变.....	31
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	31
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	31
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	31
10.8 其他重大事件.....	33
§11 备查文件目录.....	34

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实策略增长混合型证券投资基金
基金简称	嘉实策略混合（深交所净值揭示简称：嘉实策略）
交易代码	070011（深交所净值揭示代码：160710）
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 12 日
报告期末基金份额总额	7,926,562,768.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过有效的策略组合，为基金持有人创造较高的中长期资产增值
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面进行综合分析，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，优先考虑股票类资产配置，剩余资产配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资采用自上而下和自下而上相结合的方法，主策略为积极成长策略，辅之以廉价证券策略和周期反转策略等；债券投资采取“自上而下”策略，以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010) 65182266	(010)66105798
注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 1702 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005（办公地址）	100140
法定代表人	王忠民	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	嘉实基金管理有限公司

办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
------	-----------------------

§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	本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	187,120,042.73
本期利润	2,753,725,885.37
加权平均基金份额本期利润	0.3251
本期加权平均净值利润率	36.43%
本期基金份额净值增长率	44.43%
3.1.2 期末数据和指标	本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	496,419,238.28
期末可供分配基金份额利润	0.0626
期末基金资产净值	8,422,982,006.67
期末基金份额净值	1.063
3.1.3 累计期末指标	本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	24.03%

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	10.16%	0.90%	10.86%	0.91%	-0.70%	-0.01%
过去三个月	20.11%	1.30%	19.38%	1.17%	0.73%	0.13%
过去六个月	44.43%	1.51%	52.34%	1.47%	-7.91%	0.04%
过去一年	12.85%	1.73%	13.52%	1.93%	-0.67%	-0.20%
自基金合同生效起至今	24.03%	1.82%	63.09%	1.93%	-39.06%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数 × 75% + 上证国债指数 × 25%，采用该业绩比较基准主要基于：① 沪深 300 指数和上证国债指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性；② 作为混合型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

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：

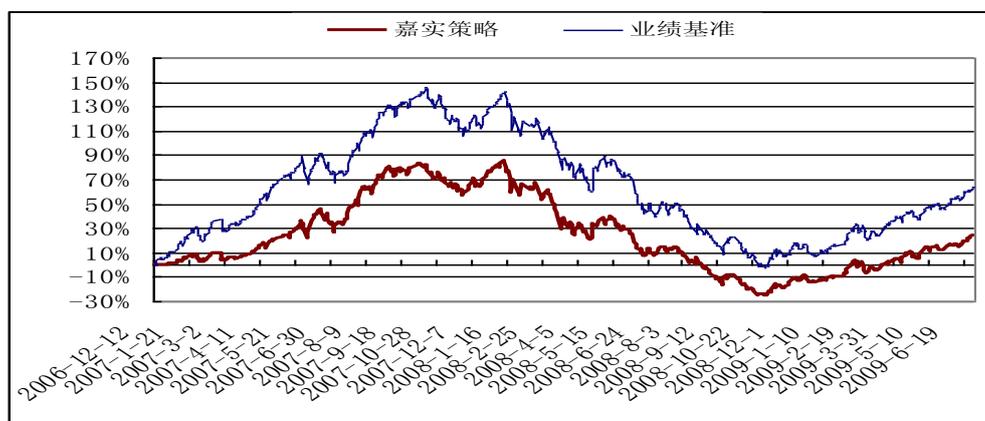
$$Benchmark_0 = 1000$$

$$Return_t = 75\% \times (\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}_{t-1} - 1) + 25\% \times (\text{上证国债指数}_t / \text{上证国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{t-1}$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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：嘉实策略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

(2006 年 12 月 12 日至 2009 年 6 月 30 日)

注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分（二、投资范围和六、（二）投资组合限制）的有关约定。

§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，基金管理人共管理 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		

邵健	本基金基金经理、嘉实增长混合基金经理、公司总经理助理。	2006 年 12 月 12 日	-	11	曾任国泰君安证券研究所研究员、行业投资策略组组长、行业公司部副经理，从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司投资部工作。经济学硕士，具有基金从业资格、中国国籍。
----	-----------------------------	------------------	---	----	--

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日或公司作出决定后公告之日，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合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》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 1.063 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.43%，同期业绩比较基准收益率为 52.34%。

报告期内，在政策、流动性、基本面改善几重因素的先后推动下，A 股市场的宏观氛围、盈利前景、供求关系及投资者信心都出现了明显的改善，在刚刚经历了金融危机引致的巨幅下跌后，A 股市场又迎来了一波波澜壮阔的上涨。

我们虽然在本基金 2008 年四季报及年报中对宏观经济转暖与流动性推动等因素已有预见，因此在 09 年上半年绝大多数时间中，基本保持了接近满仓的操作，在仓位配置上相对合理。但由于经济反转速度与投资者信心反转速度之快超出了我们的预期，以及我们对估值相对较高的要求，在过去一段时间里，本基金在结构上的进攻性略有不足，主要体现为周期性资产配置偏低，因而未能充分分享这一轮上涨的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2009 年下半年，我们认为，在宏观经济方面，从全球的角度来看，经济将停止下滑，缓步走向复苏，流动性充裕的格局将继续存在，金融市场总体趋暖；从中国的角度来看，经济进入三季度后将继续快速反弹，宽松的政策基调有望继续维持，企业盈利将逐步好转，流动性仍较为充裕。在这种情况下，A 股市场仍有望保持振荡向上的格局。

在结构方面，随着中国与全球经济的逐步转暖，投资品行业的需求将继续提升，与此同时，金融、消费、出口等相关行业也将逐步受益于整体经济的回暖。未来一阶段，可望有更多的行业体现出基本面的显著改善，并带动市场的上涨。

本基金在此过程中，一方面将积极把握经济整体回暖所带来的行业性投资机会；另一方面，将积极寻找中国的经济转型所带来的未来中长期的机会，以及自下而上的角度来看，能够穿越周期的结构性的投资机会，力争给广大持有人带来更好的回报。

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验。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

截至报告期末本基金基金份额净值为 1.063 元，报告期末可供分配利润 496,419,238.28 元。根据本基金基金合同（第十五部分三、基金收益分配原则第 1 款、第 5 款）“在符合有关基金分红条件的情况下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，全年分配比例不得低于年度可分配收益的 30%。”、“基金收益分配后基金份额净值不能低于面值”，本期本基金未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2009年上半年，本基金托管人在对嘉实策略增长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2009年上半年，嘉实策略增长混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实策略增长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实策略增长混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实策略增长混合型证券投资基金2009年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：嘉实策略增长混合型证券投资基金

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	185,791,608.64	199,576,555.92
结算备付金		8,521,529.95	4,103,633.44
存出保证金		5,432,141.10	2,591,778.13
交易性金融资产	6.4.7.2	8,206,954,857.73	6,065,273,484.80
其中：股票投资		7,950,356,857.73	4,843,544,722.68
基金投资		-	-
债券投资		256,598,000.00	1,221,728,762.12
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	18,603,712.63	17,042,125.35
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		45,143,036.86	126,113,672.38
应收利息	6.4.7.5	3,894,676.32	29,894,789.83
应收股利		789,457.25	-
应收申购款		4,382,134.77	181,963.46

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,479,513,155.25	6,444,778,003.31
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		-	-
应付赎回款		33,661,460.22	3,822,757.20
应付管理人报酬		10,070,933.73	8,331,992.45
应付托管费		1,678,488.94	1,388,665.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,929,199.34	2,956,543.99
应交税费		210,467.70	201,931.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,980,598.65	1,892,591.61
负债合计		56,531,148.58	18,594,482.34
所有者权益			
实收基金	6.4.7.9	7,926,562,768.39	8,725,617,372.30
未分配利润	6.4.7.10	496,419,238.28	-2,299,433,851.33
所有者权益合计		8,422,982,006.67	6,426,183,520.97
负债和所有者权益总计		8,479,513,155.25	6,444,778,003.31

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.063 元，基金份额总额 7,926,562,768.39 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实策略增长混合型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2009年1月1日至2009年6月30日	2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		2,846,975,201.68	-5,944,136,464.59
1.利息收入		9,842,527.14	26,454,126.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,470,789.40	6,281,190.39
债券利息收入		8,371,737.74	19,466,115.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	706,820.71
其他利息收入		-	-
2.投资收益		270,276,052.20	911,483,316.45

其中：股票投资收益	6.4.7.12	204,192,792.78	865,797,609.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	25,110,893.98	2,546,877.52
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	32,307.11
股利收益	6.4.7.15	40,972,365.44	43,106,522.49
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	2,566,605,842.64	-6,884,380,599.39
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	250,779.70	2,306,691.39
二、费用		-93,249,316.31	-185,004,886.44
1. 管理人报酬		-55,884,531.37	-98,904,306.24
2. 托管费		-9,314,088.53	-16,484,051.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-27,804,994.90	-65,972,755.70
5. 利息支出		-	-3,361,870.97
其中：卖出回购金融资产支出		-	-3,361,870.97
6. 其他费用	6.4.7.19	-245,701.51	-281,902.48
三、利润总额		2,753,725,885.37	-6,129,141,351.03
所得税费用		-	-
四、净利润		2,753,725,885.37	-6,129,141,351.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实策略增长混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

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）	8,725,617,372.30	-2,299,433,851.33	6,426,183,520.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,753,725,885.37	2,753,725,885.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-799,054,603.91	42,127,204.24	-756,927,399.67
其中：1.基金申购款	154,654,333.62	-13,193,832.13	141,460,501.49
2.基金赎回款	-953,708,937.53	55,321,036.37	-898,387,901.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	7,926,562,768.39	496,419,238.28	8,422,982,006.67
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）	10,470,240,677.95	8,002,632,653.39	18,472,873,331.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,129,141,351.03	-6,129,141,351.03

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,242,694,326.88	-736,788,382.04	-1,979,482,708.92
其中：1.基金申购款	996,734,476.81	215,071,953.33	1,211,806,430.14
2.基金赎回款	-2,239,428,803.69	-951,860,335.37	-3,191,289,139.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,673,359,493.44	-1,673,359,493.44
五、期末所有者权益（基金净值）	9,227,546,351.07	-536,656,573.12	8,690,889,777.95

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实策略增长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 242 号《关于同意嘉实策略增长混合型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 41,916,951,504.01 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 184 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 41,916,951,504.01 份基金份额,未发生认购资金利息折基金份额的情况。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产的配置占基金资产的 30-95%,债券资产的配置占基金资产的 0-65%,权证的配置占基金资产净值的 0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	185,791,608.64
定期存款	-

其他存款	-
合计	185,791,608.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009年6月30日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		6,543,864,075.77	7,950,356,857.73	1,406,492,781.96
债券	交易所市场	19,706,725.57	20,074,000.00	367,274.43
	银行间市场	237,711,400.00	236,524,000.00	-1,187,400.00
	合计	257,418,125.57	256,598,000.00	-820,125.57
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,801,282,201.34	8,206,954,857.73	1,405,672,656.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注 (成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	18,603,712.63	-	26,971,243.74
认购权证	-	18,603,712.63	-	26,971,243.74
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	18,603,712.63	-	26,971,243.74

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末，本基金未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	33,570.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,684.34
应收债券利息	3,858,421.91

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,894,676.32

6.4.7.6 其他资产

本期末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,929,199.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,929,199.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	12,408.58
预提费用	218,190.07
其他应付款	-
合计	1,980,598.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,725,617,372.30	8,725,617,372.30
本期申购	154,654,333.62	154,654,333.62
本期赎回	-953,708,937.53	-953,708,937.53
本期末	7,926,562,768.39	7,926,562,768.39

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,499,797,285.37	-4,799,231,136.70	-2,299,433,851.33
本期利润	187,120,042.73	2,566,605,842.64	2,753,725,885.37
本期基金份额交易产生的变动数	-222,031,045.31	264,158,249.55	42,127,204.24
其中：基金申购款	42,545,557.72	-55,739,389.85	-13,193,832.13
基金赎回款	-264,576,603.03	319,897,639.40	55,321,036.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,464,886,282.79	-1,968,467,044.51	496,419,238.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
活期存款利息收入	1,388,173.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	82,054.32
其他	561.24
合计	1,470,789.40

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出股票成交总额	9,051,652,972.77
卖出股票成本总额	-8,847,460,179.99
买卖股票差价收入	204,192,792.78

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交金额	1,242,431,384.62
卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	-1,181,473,197.26
应收利息总额	-35,847,293.38
债券投资收益	25,110,893.98

6.4.7.14 衍生工具收益：无**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,972,365.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	40,972,365.44

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
1.交易性金融资产	2,565,044,255.36
——股票投资	2,586,413,220.22
——债券投资	-21,368,964.86

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	1,561,587.28
——权证投资	1,561,587.28
3.其他	-
合计	2,566,605,842.64

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
基金赎回费收入	130,427.45
转换基金补偿收入	76,769.94
印花税返还收入	15,337.14
其他	28,245.17
合计	250,779.70

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
交易所市场交易费用	27,802,344.90
银行间市场交易费用	2,650.00
合计	27,804,994.90

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	18,511.44
其他	-
合计	245,701.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

报告期内，本基金不存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金不存在资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国都证券有限责任公司	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国都证券有限责任公司	4,388,303,447.38	24.01%	1,193,520,951.23	6.23%

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比 例
国都证券有限责任公司	3,730,045.75	24.37%	2,098,878.07	23.51%
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			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比 例
国都证券有限责任公司	1,014,489.80	6.32%	0.00	0.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	55,884,531.37	98,904,306.24
其中：当期已支付	45,813,597.64	87,345,493.65

期末未支付	10,070,933.73	11,558,812.59
-------	---------------	---------------

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 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年6月30日	2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	9,314,088.53	16,484,051.05
其中: 当期已支付	7,635,599.59	14,557,582.27
期末未支付	1,678,488.94	1,926,468.78

注: 支付基金托管人中国工商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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期本基金未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

上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日						
银行间市场交易 的各关联方名称	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
中国工商银行	-	-	-	-	1,200,800,000.00	635,601.53

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年6月30日		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
中国工商银行	185,791,608.64	1,388,173.84	172,075,189.13	6,160,704.06

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内及上年度可比期间, 本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

报告期内, 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券****6.4.12.1.1 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	2009.4.14	2010.4.12	非公开发行 流通受限	15.18	13.34	3,270,000	33,092,400.00	43,621,800.00
600522	中天科技	2009.3.6	2010.3.4	非公开发行 流通受限	8.60	11.87	3,930,000	33,798,000.00	46,649,100.00
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
000401	冀东水泥	2008.6.30	2009.7.9	非公开发行 流通受限	11.83	13.80	3,000,000	35,490,000.00	41,400,000.00
002122	天马股份	2009.2.17	2010.2.19	非公开发行 流通受限	47.00	25.27	1,640,000	38,540,000.00	41,442,800.00

注：（1）本基金于 2009 年 4 月 14 日参与云南城投（600239）非公开发行，购入数量 2,180,000 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 1,090,000 股。（2）本基金于 2008 年 12 月 31 日参与海油工程（600583）非公开发行，购入数量 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 日参与天马股份（002122）非公开发行，购入数量 820,000 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 820,000 股。

6.4.12.1.2 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。

6.4.12.1.3 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

期末（2009 年 6 月 30 日）本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

期末本基金无交易所债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，以实现通过有效的策略组合为基金持有人创造较高的中长期资产增值的投资目标。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金

的托管人中国工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	185,791,608.64	-	-	-	185,791,608.64
结算备付金	8,521,529.95	-	-	-	8,521,529.95
存出保证金	-	-	-	5,432,141.10	5,432,141.10
交易性金融资产	256,598,000.00	-	-	7,950,356,857.73	8,206,954,857.73
衍生金融资产	-	-	-	18,603,712.63	18,603,712.63
应收证券清算款	-	-	-	45,143,036.86	45,143,036.86
应收股利	-	-	-	789,457.25	789,457.25
应收利息	-	-	-	3,894,676.32	3,894,676.32
应收申购款	18,333.72	-	-	4,363,801.05	4,382,134.77
资产总计	450,929,472.31	-	-	8,028,583,682.94	8,479,513,155.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	33,661,460.22	33,661,460.22
应付管理人报酬	-	-	-	10,070,933.73	10,070,933.73
应付托管费	-	-	-	1,678,488.94	1,678,488.94
应付交易费用	-	-	-	8,929,199.34	8,929,199.34
应交税费	-	-	-	210,467.70	210,467.70
其他负债	-	-	-	1,980,598.65	1,980,598.65
负债总计	-	-	-	56,531,148.58	56,531,148.58
利率敏感度缺口	450,929,472.31	-	-	7,972,052,534.36	8,422,982,006.67
上年度末 2008年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	199,576,555.92	-	-	-	199,576,555.92
结算备付金	4,103,633.44	-	-	-	4,103,633.44
存出保证金	-	-	-	2,591,778.13	2,591,778.13
交易性金融资产	841,820,000.00	375,468,975.12	4,439,787.00	4,843,544,722.68	6,065,273,484.80
衍生金融资产	-	-	-	17,042,125.35	17,042,125.35
应收证券清算款	-	-	-	126,113,672.38	126,113,672.38

应收利息	-	-	-	29,894,789.83	29,894,789.83
应收申购款	10,934.40	-	-	171,029.06	181,963.46
资产总计	1,045,511,123.76	375,468,975.12	4,439,787.00	5,019,358,117.43	6,444,778,003.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,822,757.20	3,822,757.20
应付管理人报酬	-	-	-	8,331,992.45	8,331,992.45
应付托管费	-	-	-	1,388,665.39	1,388,665.39
应付交易费用	-	-	-	2,956,543.99	2,956,543.99
应交税费	-	-	-	201,931.70	201,931.70
其他负债	-	-	-	1,892,591.61	1,892,591.61
负债总计	-	-	-	18,594,482.34	18,594,482.34
利率敏感度缺口	1,045,511,123.76	375,468,975.12	4,439,787.00	5,000,763,635.09	6,426,183,520.97

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资在一年以内(2008 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2008 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 30%-95%，债券投资比例为 0%-65%，权证投资比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金所持有的权益类金融资产及负债面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2009年6月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
----	------------------	--------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	7,950,356,857.73	94.39	4,843,544,722.68	75.37
衍生金融资产-权证投资	18,603,712.63	0.22	17,042,125.35	0.27
其他	-	-	-	-
合计	7,968,960,570.36	94.61	4,860,586,848.03	75.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币万元)	
		本期末 (2009年6月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	增加约 33,529	增加约 27,777
	业绩比较基准下降 5%	减少约 33,529	减少约 27,777

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项: 无

§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	7,950,356,857.73	93.76
	其中:股票	7,950,356,857.73	93.76
2	固定收益投资	256,598,000.00	3.03
	其中:债券	256,598,000.00	3.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	18,603,712.63	0.22
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	194,313,138.59	2.29
6	其他资产	59,641,446.30	0.70
	合计	8,479,513,155.25	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	647,080,718.35	7.68
C	制造业	3,308,144,068.62	39.28
C0	食品、饮料	365,973,906.59	4.34
C1	纺织、服装、皮毛	23,395,300.39	0.28

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	140,930,398.88	1.67
C4	石油、化学、塑胶、塑料	195,671,176.20	2.32
C5	电子	7,214,121.53	0.09
C6	金属、非金属	641,864,207.99	7.62
C7	机械、设备、仪表	1,113,173,750.15	13.22
C8	医药、生物制品	819,921,206.89	9.73
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,428,850.22	0.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	302,856,935.90	3.60
H	批发和零售贸易	214,111,569.69	2.54
I	金融、保险业	2,271,797,552.97	26.97
J	房地产业	1,088,977,506.78	12.93
K	社会服务业	20,966,566.50	0.25
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	77,993,088.70	0.93
	合计	7,950,356,857.73	94.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	14,199,766	702,320,426.36	8.34
2	601166	兴业银行	12,855,856	477,080,816.16	5.66
3	000651	格力电器	15,566,500	325,339,850.00	3.86
4	600216	浙江医药	10,284,104	273,968,530.56	3.25
5	600325	华发股份	11,558,798	261,113,246.82	3.10
6	000983	西山煤电	8,719,793	260,721,810.70	3.10
7	600583	海油工程	22,549,819	256,588,358.77	3.05
8	000002	万科A	18,906,040	241,052,010.00	2.86
9	600383	金地集团	13,535,022	218,184,554.64	2.59
10	601328	交通银行	23,999,832	216,238,486.32	2.57
11	600887	*ST 伊利	12,516,114	185,363,648.34	2.20
12	600036	招商银行	8,129,896	182,190,969.36	2.16
13	600048	保利地产	6,449,124	179,866,068.36	2.14
14	000001	深发展A	7,999,835	174,556,399.70	2.07
15	002202	金风科技	5,507,008	165,871,080.96	1.97
16	600307	酒钢宏兴	11,914,015	161,911,463.85	1.92
17	600750	江中药业	9,564,305	143,368,931.95	1.70
18	000063	中兴通讯	5,001,932	140,554,289.20	1.67
19	600015	华夏银行	10,999,856	137,828,195.68	1.64
20	600005	武钢股份	17,299,881	136,323,062.28	1.62

21	600315	上海家化	6,227,066	134,193,272.30	1.59
22	000528	柳 工	7,630,184	126,966,261.76	1.51
23	600016	民生银行	15,000,000	118,800,000.00	1.41
24	000060	中金岭南	5,435,313	116,804,876.37	1.39
25	000825	太钢不锈	14,499,773	111,358,256.64	1.32
26	601009	南京银行	5,999,864	107,937,553.36	1.28
27	002024	苏宁电器	6,542,265	105,134,198.55	1.25
28	000910	大亚科技	12,478,438	103,571,035.40	1.23
29	600590	泰豪科技	8,032,542	101,049,378.36	1.20
30	000538	云南白药	2,790,973	97,684,055.00	1.16
31	601169	北京银行	5,999,986	97,559,772.36	1.16
32	600196	复星医药	6,654,136	96,418,430.64	1.14
33	000895	双汇发展	2,593,059	93,350,124.00	1.11
34	600348	国阳新能	2,808,358	85,261,748.88	1.01
35	600276	恒瑞医药	2,400,000	83,784,000.00	0.99
36	600479	千金药业	4,469,324	77,319,305.20	0.92
37	002073	青岛软控	3,528,400	70,426,864.00	0.84
38	600581	八一钢铁	6,017,633	70,105,424.45	0.83
39	600519	贵州茅台	463,855	68,655,178.55	0.82
40	600239	云南城投	4,020,529	62,309,972.10	0.74
41	000887	中鼎股份	5,999,263	58,912,762.66	0.70
42	600582	天地科技	2,830,953	58,176,084.15	0.69
43	000157	中联重科	2,599,732	58,052,015.56	0.69
44	601939	建设银行	9,499,989	57,284,933.67	0.68
45	600052	浙江广厦	5,096,800	54,841,568.00	0.65
46	600498	烽火通信	3,321,892	54,479,028.80	0.65
47	000402	金 融 街	3,941,509	54,235,163.84	0.64
48	600067	冠城大通	3,656,605	47,499,298.95	0.56
49	002007	华兰生物	1,289,898	47,377,953.54	0.56
50	600522	中天科技	3,930,000	46,649,100.00	0.55
51	600895	张江高科	3,000,470	46,477,280.30	0.55
52	000401	冀东水泥	3,287,038	45,361,124.40	0.54
53	601001	大同煤业	1,200,000	43,656,000.00	0.52
54	002028	思源电气	1,931,163	42,350,404.59	0.50
55	002122	天马股份	1,640,000	41,442,800.00	0.49
56	600588	用友软件	2,159,393	41,006,873.07	0.49
57	002235	安妮股份	3,187,659	37,359,363.48	0.44
58	000671	阳 光 城	1,175,963	31,515,808.40	0.37
59	002258	利尔化学	1,025,245	30,982,903.90	0.37
60	600486	扬农化工	950,000	30,495,000.00	0.36
61	600655	豫园商城	1,649,932	28,510,824.96	0.34

62	600058	五矿发展	1,500,000	27,435,000.00	0.33
63	600177	雅戈尔	1,696,541	23,395,300.39	0.28
64	000069	华侨城A	1,003,185	20,966,566.50	0.25
65	600859	王府井	773,778	20,520,592.56	0.24
66	000848	承德露露	1,154,870	18,604,955.70	0.22
67	002081	金螳螂	1,009,247	18,428,850.22	0.22
68	000608	阳光股份	1,783,873	17,374,923.02	0.21
69	600693	东百集团	1,509,708	13,240,139.16	0.16
70	600031	三一重工	455,698	13,110,431.46	0.16
71	002093	国脉科技	678,454	10,129,318.22	0.12
72	600118	中国卫星	572,637	10,038,326.61	0.12
73	002269	美邦服饰	562,122	10,022,635.26	0.12
74	600697	欧亚集团	490,880	9,248,179.20	0.11
75	600551	时代出版	500,633	7,214,121.53	0.09
76	002242	九阳股份	152,357	3,976,517.70	0.05
77	600028	中国石化	80,000	852,800.00	0.01

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	601318	中国平安	453,071,874.61	7.05
2	601166	兴业银行	312,472,108.28	4.86
3	601601	中国太保	299,737,216.43	4.66
4	601001	大同煤业	268,998,616.08	4.19
5	000983	西山煤电	267,383,446.15	4.16
6	600216	浙江医药	258,471,792.37	4.02
7	000002	万科A	247,650,128.30	3.85
8	002202	金风科技	222,245,212.48	3.46
9	600325	华发股份	215,850,373.25	3.36
10	601328	交通银行	200,730,780.65	3.12
11	600036	招商银行	188,404,547.48	2.93
12	600887	*ST 伊利	187,808,170.73	2.92
13	000157	中联重科	178,634,268.50	2.78
14	600005	武钢股份	170,833,441.09	2.66
15	600016	民生银行	164,212,883.48	2.56
16	000825	太钢不锈	163,737,199.03	2.55
17	000001	深发展A	162,599,903.77	2.53
18	600590	泰豪科技	151,470,535.70	2.36
19	600307	酒钢宏兴	147,000,754.57	2.29
20	600015	华夏银行	137,437,704.32	2.14
21	002007	华兰生物	133,857,713.65	2.08

22	600289	亿阳信通	131,037,696.53	2.04
23	600741	华域汽车	128,597,699.71	2.00

7.4.2 累计卖出金额前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601601	中国太保	422,728,457.10	6.58
2	601166	兴业银行	302,525,654.90	4.71
3	002028	思源电气	295,833,621.67	4.60
4	601001	大同煤业	285,810,500.40	4.45
5	600588	用友软件	278,929,538.85	4.34
6	600196	复星医药	241,823,202.07	3.76
7	000651	格力电器	201,373,895.84	3.13
8	000538	云南白药	201,319,800.09	3.13
9	600779	水井坊	189,261,093.18	2.95
10	600036	招商银行	182,403,991.93	2.84
11	600518	康美药业	180,337,513.24	2.81
12	600741	华域汽车	167,551,269.39	2.61
13	600516	方大炭素	156,040,210.07	2.43
14	601808	中海油服	153,338,349.59	2.39
15	000002	万科A	141,056,863.70	2.20
16	600519	贵州茅台	136,141,749.88	2.12
17	600030	中信证券	134,484,317.95	2.09
18	000157	中联重科	128,578,158.30	2.00
19	600649	城投控股	126,001,405.28	1.96
20	000338	潍柴动力	124,388,384.61	1.94

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,368,109,909.82
卖出股票收入（成交）总额	9,051,652,972.77

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	20,074,000.00	0.24
2	央行票据	96,720,000.00	1.15
3	金融债券	139,804,000.00	1.66
	其中：政策性金融债	139,804,000.00	1.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-

7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
合计		256,598,000.00	3.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	090404	09 农发 04	1,400,000	139,804,000.00	1.66
2	0801106	08 央票 106	1,000,000	96,720,000.00	1.15
3	010210	02 国债(0)	200,000	20,074,000.00	0.24

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	580019	石化 CWB1	10,974,428	17,383,493.95	0.21
2	580018	中远 CWB1	218,638	1,220,218.68	0.01

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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和处罚。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,432,141.10
2	应收证券清算款	45,143,036.86
3	应收股利	789,457.25
4	应收利息	3,894,676.32
5	应收申购款	4,382,134.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		59,641,446.30

注：7.9.3 “其他资产”为报告期末（2009年6月30日）的金额。

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净值	流通受限情况说明
----	------	------	---------	---------	----------

			公允价值	比例 (%)	
1	600583	海油工程	46,608,000.00	0.55	非公开发行流通受限

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
238,297	33,263.38	37,526,280.13	0.47%	7,889,036,488.26	99.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	124,847.77	0.0016%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年12月12日)基金份额总额	41,916,951,504.01
报告期期初基金份额总额	8,725,617,372.30
报告期期间基金总申购份额	154,654,333.62
报告期期间基金总赎回份额	953,708,937.53
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,926,562,768.39

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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的重大人事变动情况

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、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务

所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 股票交易

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券有限责任公司	1	4,388,303,447.38	24.01%	3,730,045.75	24.37%	
中信证券股份有限公司	2	2,489,558,424.83	13.62%	2,112,509.45	13.80%	
广发华福证券有限责任公司	1	2,200,302,734.51	12.04%	1,787,759.17	11.68%	
北京高华证券有限责任公司	2	1,433,352,191.87	7.84%	1,164,609.73	7.61%	
联合证券有限责任公司	1	1,345,260,754.48	7.36%	1,143,472.72	7.47%	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,210,194,790.52	6.62%	998,617.81	6.53%	
华泰证券股份有限公司	1	1,204,689,144.00	6.59%	1,023,985.04	6.69%	
长城证券有限责任公司	1	1,178,386,011.41	6.45%	1,001,622.23	6.55%	
海通证券股份有限公司	2	772,362,771.35	4.23%	627,552.56	4.10%	新增
中国建银投资证券有限责任公司	1	538,433,565.82	2.95%	457,666.45	2.99%	
中信建投证券有限责任公司	1	396,903,583.68	2.17%	337,364.36	2.20%	
招商证券股份有限公司	2	382,576,714.11	2.09%	310,845.63	2.03%	
广发证券股份有限公司	1	246,072,027.27	1.35%	199,934.72	1.31%	
国金证券股份有限公司	1	205,616,574.57	1.13%	167,064.85	1.09%	
兴业证券股份有限公司	1	156,427,175.91	0.86%	132,961.99	0.87%	
国信证券股份有限公司	1	126,360,423.49	0.69%	107,404.86	0.70%	
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商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) 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租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议,并通知基金托管人。

10.7.2 债券交易

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券股份有限公司	26,667,908.99	81.04%
联合证券有限责任公司	4,427,029.09	13.45%
广发证券股份有限公司	1,401,848.31	4.26%
中信建投证券有限责任公司	411,213.23	1.25%

10.7.3 债券回购交易

报告期内本基金无债券回购交易。

10.7.4 权证交易

报告期内本基金无权证交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金通过深圳发展银行开办定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年1月12日
2	关于提示投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月7日
3	关于旗下基金投资天马股份非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月18日
4	关于成立嘉实国际资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月19日
5	关于成立福州、南京分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月19日
6	关于旗下基金参加中国工商银行开展基智定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月26日
7	关于通过交通银行网上银行申购嘉实旗下基金费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月27日
8	嘉实基金管理有限公司关于电话总机变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年2月27日
9	关于增加天相投资顾问有限公司为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年3月7日
10	关于旗下基金投资中天科技非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2009年3月7日
11	关于旗下开放式基金通过宁波银行、山西证券开	中国证券报、上海证券报、	2009年3

	办定投业务的公告	证券时报、管理人网站	月 19 日
12	关于增加东莞银行为嘉实旗下开放式基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 3 月 20 日
13	关于增加世纪证券为嘉实主题等开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 3 月 30 日
14	关于通过中国工商银行个人网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 4 月 1 日
15	关于对广发银行理财通卡和中行广东分行借记卡持有人开通嘉实网上定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 4 月 9 日
16	关于旗下基金投资云南城投非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 4 月 16 日
17	关于旗下基金参加中国银行开展的基金定投和网上银行基金交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 6 日
18	关于旗下开放式基金通过恒泰证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 8 日
19	关于旗下开放式基金通过光大证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 9 日
20	关于旗下开放式基金通过中山证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 20 日
21	关于增加广发银行为嘉实成长收益混合等开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 5 月 20 日
22	关于增加中国民族证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 2 日
23	关于旗下开放式基金通过广发银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 3 日
24	关于增加厦门证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 5 日
25	关于增加江海证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 6 月 25 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实策略增长混合型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实策略增长混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实策略增长混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2009年8月29日