嘉实优质企业股票型证券投资基金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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年8月26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	嘉实优质企业股票型证券投资基金
基金简称	嘉实优质企业股票(深交所净值揭示简称:嘉实优质)
交易代码	070099(深交所净值揭示代码:160711)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月8日
报告期末基金份额总额	6,456,134,602.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力争为基金份额持有人创造长期超额收益
投资策略	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，剩余配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资以自下而上的个股精选策略为主，结合行业配置适度均衡策略，构造和优化组合；通过新股申购、债券投资及衍生工具等投资策略，规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深300指数×95%+上证国债指数×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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	周倩芝
	联系电话	(010)65215588	(021)61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhouqz@spdb.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95528
传真		(010)65182266	(021)63602540
注册地址		上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室	上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址		北京市建国门北大街8号华润大厦8层	上海市中山东一路12号
邮政编码		100005(办公地址)	200120
法定代表人		王忠民	吉晓辉

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	本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)
本期已实现收益	-502,625,755.10
本期利润	1,212,197,394.91
加权平均基金份额本期利润	0.1712
本期加权平均净值利润率	27.88%
本期基金份额净值增长率	31.97%
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	-1,864,393,237.24
期末可供分配基金份额利润	-0.2888
期末基金资产净值	4,581,884,065.47
期末基金份额净值	0.710
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	-29.00%

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	7.25%	1.07%	13.95%	1.16%	-6.70%	-0.09%
过去三个月	17.36%	1.31%	24.87%	1.48%	-7.51%	-0.17%
过去六个月	31.97%	1.43%	69.63%	1.86%	-37.66%	-0.43%
过去一年	8.40%	1.69%	13.53%	2.45%	-5.13%	-0.76%
自基金合同生效起至今	-29.00%	1.90%	-34.96%	2.60%	5.96%	-0.70%

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数×95%+上证国债指数×5%。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:嘉实优质企业股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年12月8日至2009年6月30日)

注1:本基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日(含当日)起,本基金基金合同生效,嘉实浦安保本基金基金合同失效。

注2:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3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十八条(二)投资范围和(八)投资组合比例限制)的规定:(1)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(3)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;(4)《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘天君	本基金、嘉实成长收益混合基金经理,公司股票投资部总监	2007年12月8日	-	8年	曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副总监、嘉实泰和封闭基金经理。北京大学光华管理学院经济学硕士,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;(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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实优质企业股票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0.710元,本报告期基金份额净值增长率为31.97%,同期业绩比较基准收益率为69.63%。

报告期内,在相对宽松的货币政策和积极财政政策推动下,中国股票市场和房地产市场相继出现了明显的复苏,虚拟经济的繁荣逐步拉动实体经济出现明显复苏。年初的投资机会主要集中在新能源、产业和区域振兴计划等主题投资,但随着市场预期宏观经济逐步好转,金融地产、大宗商品等经济敏感行业表现较好,而防守或稳定类资产则被市场冷落。

整体而言,报告期内股票市场的风险偏好逐步上升,市场信心和估值水平得到快速修复,几乎所有的强周期性行业都有强劲的表现;相反,大部分的长线成长股表现较差。

报告期内,本基金显著低估了市场的风险偏好,同时部分重仓股由于缺乏业绩弹性导致涨幅较低,导致本基金收益率显著落后基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,宏观数据和上市公司业绩有望逐步改善,尤其是房地产投资的快速回升将拉动实体经济中的相关行业景气复苏,其中大宗商品和中游制造业将显著受益。同时,信贷增速在上半年的过快增长之后将明显放缓,信贷政策可能出现微调,以压制房价的过快上涨。

本基金将密切跟踪经济复苏的实际状况和市场的估值水平,保持超配受益经济复苏的部分周期性行业,同时仍将保持配置部分长期成长股,以稳中求进的策略应对市场可能出现的波动。

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

根据本报告3.1.2"期末可供分配利润"-1,864,393,237.24元,期末基金份额净值为0.710元"以及基金合同二十三(三)收益分配原则"4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值"的约定,报告期本基金未实施分配利润。

§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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对嘉实优质企业股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对嘉实优质企业股票型证券投资基金的投资运作进行了监督,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的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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)、投资组合报告等内容真实、准确、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:嘉实优质企业股票型证券投资基金

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	217,466,868.48	343,697,777.78
结算备付金		12,875,359.93	4,462,186.24
存出保证金		2,993,122.22	750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	4,280,160,699.43	3,782,980,848.71
其中:股票投资		4,105,417,699.43	2,966,081,848.71
基金投资		-	-
债券投资		174,743,000.00	816,899,000.00
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		94,800,202.61	76,548,028.42
应收利息	6.4.7.5	5,127,528.76	15,792,560.84
应收股利		1,530,905.70	-
应收申购款		2,123,006.77	260,534.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,617,077,693.90	4,224,491,936.71
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		11,004,958.46	-
应付赎回款		8,151,470.06	1,459,791.70
应付管理人报酬		5,506,755.87	5,466,651.29
应付托管费		917,792.64	911,108.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,647,226.17	1,989,437.63
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	965,425.23	854,234.17
负债合计		35,193,628.43	10,681,223.33
所有者权益			
实收基金	6.4.7.9	6,446,277,302.71	7,818,662,035.93
未分配利润	6.4.7.10	-1,864,393,237.24	-3,604,851,322.55
所有者权益合计		4,581,884,065.47	4,213,810,713.38
负债和所有者权益总计		4,617,077,693.90	4,224,491,936.71

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值0.710元,基金份额总额6,456,134,602.85份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实优质企业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

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		1,274,170,844.31	-3,006,654,996.07
1.利息收入		8,313,665.28	14,390,827.36
其中:存款利息收入	6.4.7.11	2,854,076.77	5,429,221.65
债券利息收入		5,459,588.51	8,725,451.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	236,154.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-449,842,544.24	-1,182,482,599.77
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-471,931,519.68	-1,224,448,544.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,180,971.97	1,885,389.07
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-958,756.20	6,101,660.52
股利收益	6.4.7.15	36,228,703.61	33,978,895.57
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	1,714,823,150.01	-1,840,684,523.45
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	876,573.26	2,121,299.79
二、费用		-61,973,449.40	-127,011,513.89
1.管理人报酬		-32,265,202.89	-50,647,978.03
2.托管费		-5,377,533.78	-8,441,329.61
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	-24,109,893.71	-66,147,683.47
5.利息支出		-	-1,538,859.48
其中:卖出回购金融资产支出		-	-1,538,859.48
6.其他费用	6.4.7.19	-220,819.02	-235,663.30
三、利润总额		1,212,197,394.91	-3,133,666,509.96
所得税费用		-	-
四、净利润		1,212,197,394.91	-3,133,666,509.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实优质企业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

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)	7,818,662,035.93	-3,604,851,322.55	4,213,810,713.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,212,197,394.91	1,212,197,394.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,372,384,733.22	528,260,690.40	-844,124,042.82
其中:1.基金申购款	224,341,344.37	-85,216,142.51	139,125,201.86
2.基金赎回款	-1,596,726,077.59	613,476,832.91	-983,249,244.68
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)	6,446,277,302.71	-1,864,393,237.24	4,581,884,065.47
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)	4,025,801,543.81	123,723,796.77	4,149,525,340.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,133,666,509.96	-3,133,666,509.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,207,023,481.23	179,438,569.67	4,386,462,050.90
其中:1.基金申购款	6,169,293,748.74	-71,054,369.50	6,098,239,379.24
2.基金赎回款	-1,962,270,267.51	250,492,939.17	-1,711,777,328.34
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)	8,232,825,025.04	-2,830,504,143.52	5,402,320,881.52

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
上海浦东发展银行股份有限公司	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	32,265,202.89	50,647,978.03
其中:当期已支付	26,758,447.02	43,399,046.16
期末未支付	5,506,755.87	7,248,931.87

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。

(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	5,377,533.78	8,441,329.61
其中:当期已支付	4,459,741.14	7,233,174.31
期末未支付	917,792.64	1,208,155.30

注:支付基金托管人上海浦东发展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

本期及上年度可比期间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。

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、上年度可比期间,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、上年度末,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 期末余额	当期利息收入	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
上海浦东发展银行	217,466,868.48	2,787,076.29	347,829,537.10	5,212,486.40

注:本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管,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。

6.4.5 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
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	9.71	5,400,000	41,580,000.00	52,434,000.00
002122	天马股份	2009-02-17	2010-02-19	非公开发行流通受限	47.00	25.27	1,700,000	39,950,000.00	42,959,000.00
000729	燕京啤酒	2008-12-15	2009-12-15	非公开发行流通受限	10.20	12.86	3,000,000	30,600,000.00	38,580,000.00

注:(1)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,购入数量3,600,000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1,800,000股。(2)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,购入数量850,000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850,000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

期末(2009年6月30日)本基金未持有暂时停牌的股票。

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

期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

(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。

§7 投资组合报告

7.1 报告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	4,105,417,699.43	88.92
	其中:股票	4,105,417,699.43	88.92
2	固定收益投资	174,743,000.00	3.78
	其中:债券	174,743,000.00	3.78
	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	230,342,228.41	4.99
6	其他资产	106,574,766.06	2.31
	合计	4,617,077,693.90	100.00

7.2 报告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	548,351,726.83	11.97
C	制造业	1,872,690,635.38	40.87
C0	食品、饮料	293,008,105.65	6.39
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	14,420,000.00	0.31
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	547,593,176.67	11.95
C7	机械、设备、仪表	1,006,437,031.27	21.97
C8	医药、生物制品	11,232,321.79	0.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	140,500,000.00	3.07
H	批发和零售贸易	49,674,250.19	1.08
I	金融、保险业	1,067,626,522.03	23.30
J	房地产业	426,574,565.00	9.31
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,105,417,699.43	89.60

7.3 报告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	000651	格力电器	16,000,000	334,400,000.00	7.30
2	601166	兴业银行	8,035,043	298,180,445.73	6.51
3	601318	中国平安	4,999,903	247,295,202.38	5.40
4	002242	九阳股份	8,299,877	216,626,789.70	4.73
5	600583	海油工程	19,210,457	215,811,706.31	4.71
6	600048	保利地产	7,000,000	195,230,000.00	4.26
7	000895	双汇发展	5,000,000	180,000,000.00	3.93
8	601628	中国人寿	5,912,161	162,880,035.55	3.55
9	600348	国阳新能	5,000,000	151,800,000.00	3.31
10	600005	武钢股份	18,974,250	149,517,090.00	3.26

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	322,253,179.63	7.65
2	601628	中国人寿	299,375,525.73	7.10
3	601318	中国平安	277,448,561.53	6.58
4	002122	天马股份	254,538,619.35	6.04
5	601088	中国神华	252,535,236.32	5.99
6	600089	特变电工	250,933,448.66	5.96
7	601398	工商银行	232,687,006.42	5.52
8	000063	中兴通讯	232,251,830.74	5.51
9	000983	西山煤电	225,272,736.11	5.35
10	600048	保利地产	221,959,505.39	5.27
11	600583	海油工程	215,559,984.74	5.12
12	600550	天威保变	210,941,853.40	5.01
13	600005	武钢股份	196,642,649.42	4.67
14	601699	潞安环能	189,293,668.37	4.49
15	000002	万科A	177,730,761.66	4.22
16	601939	建设银行	174,286,620.17	4.14
17	600660	福耀玻璃	145,875,189.15	3.46
18	600348	国阳新能	145,064,997.51	3.44
19	600016	民生银行	141,610,885.53	3.36
20	002028	思源电气	136,950,337.28	3.25
21	000157	中联重科	135,483,122.95	3.22
22	600001	邯郸钢铁	128,945,324.05	3.06
23	601666	平煤股份	119,794,302.36	2.84
24	600030	中信证券	112,680,292.44	2.67
25	600325	华发股份	109,703,422.26	2.60
26	600585	海螺水泥	108,868,942.81	2.58
27	002202	金风科技	94,503,385.68	2.24
28	000898	鞍钢股份	90,679,829.32	2.15
29	600900	长江电力	90,647,532.26	2.15
30	000060	中金岭南	87,031,746.39	2.07
31	002242	九阳股份	86,555,852.07	2.05
32	600010	包钢股份	85,347,822.48	2.03

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	459,547,618.47	10.91
2	600519	贵州茅台	395,221,755.99	9.38
3	000651	格力电器	288,542,977.08	6.85
4	600550	天威保变	247,362,145.73	5.87
5	000983	西山煤电	238,570,343.59	5.66
6	600089	特变电工	225,762,834.26	5.36
7	600036	招商银行	212,444,944.62	5.04
8	002122	天马股份	184,824,410.32	4.39
9	600660	福耀玻璃	173,990,735.61	4.13
10	601398	工商银行	164,357,281.28	3.90
11	600048	保利地产	161,007,420.71	3.82
12	000729	燕京啤酒	147,572,387.81	3.50
13	601628	中国人寿	140,108,274.37	3.32
14	002028	思源电气	139,442,947.94	3.31
15	002024	苏宁电器	135,549,761.21	3.22
16	600428	中远航运	135,203,941.76	3.21
17	000423	东阿阿胶	132,416,336.43	3.14
18	601699	潞安环能	124,570,631.43	2.96
19	002242	九阳股份	124,228,427.83	2.95
20	601666	平煤股份	123,880,537.39	2.94
21	600030	中信证券	123,228,411.75	2.92
22	601166	兴业银行	119,007,867.92	2.82
23	600583	海油工程	118,352,438.91	2.81
24	002202	金风科技	117,981,408.62	2.80
25	000759	武汉中百	108,813,781.12	2.58
26	600858	银座股份	103,404,792.44	2.45
27	002251	步步高	100,604,829.58	2.39
28	000063	中兴通讯	99,589,380.52	2.36
29	601186	中国铁建	97,376,857.31	2.31
30	601006	大秦铁路	96,072,489.93	2.28
31	600900	长江电力	90,526,745.78	2.15
32	600031	三一重工	89,750,765.73	2.13
33	000898	鞍钢股份	88,471,029.62	2.10
34	000895	双汇发展	85,871,210.59	2.04
35	600309	烟台万华	85,824,546.93	2.04
36	002123	荣信股份	85,503,214.10	2.03

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	7,857,710,394.61
卖出股票收入(成交)总额	7,951,827,029.51

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	-	-
2	央行票据	144,785,000.00