

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

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金合同第十五部分三、收益分配原则 3、基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。以及本报告3.1本期托管人、基金托管人、基金销售机构在基金募集过程中,对基金合同、基金招募说明书等法律文件,已经过法律意见书,并由董事签字。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况
2011年上半年,本基金托管人在对嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规,基金合同,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
2011年上半年,嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实量化阿尔法股票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、基金费用开支等方面上,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,嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对半年度报告中基金净值表现、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。

6.1 资产负债表
会计主体:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元
资产: 嘉实基金管理有限公司 2011年6月30日 2010年12月31日

负债: 嘉实基金管理有限公司 2011年6月30日 2010年12月31日

所有者权益: 嘉实基金管理有限公司 2011年6月30日 2010年12月31日

6.2 利润表
会计主体:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元
项目 附注号 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

一、收入 1,165,413,217.70 -482,602,844.21

1.利息收入 -165,153,217.70 -482,602,844.21

2.投资收益 52,779,449.29 -134,323,359.41

3.公允价值变动收益 -219,710,824.24 -350,691,634.72

4.其他收入 272,421.69 1,377,753.03

二、费用 17,471,073.34 31,563,813.04

1.管理人报酬 9,835,566.31 16,019,028.80

2.托管费 1,639,261.04 2,669,838.12

3.销售服务费 1,728,838.58 12,670,564.62

4.利息支出 5,772,434.77 13,758,440.00

5.其他费用 272,421.69 1,377,753.03

三、利润总额 1,147,942,144.36 -514,166,657.25

四、净利润 1,147,942,144.36 -514,166,657.25

五、期末所有者权益合计 1,147,942,144.36 -514,166,657.25

六、本期基金份额净值增长率 1.08% -1.02%

七、本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

八、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

九、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

十、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

十一、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

十二、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

十三、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

十四、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

十五、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

十六、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

十七、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

十八、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

十九、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

二十、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

二十一、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

二十二、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

二十三、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

二十四、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

二十五、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

二十六、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

二十七、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

二十八、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

二十九、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

三十、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 1.08% -1.02%

三十一、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 0.25% -0.36%

三十二、本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比 -0.36% 0.33%

注:1)本期 2011年1月1日至2011年6月30日,本基金无应付关联方款项。2)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券交易、经手费后的净额列示。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。

6.4.2 关联方报酬
6.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基础基金支付的管理费 9,835,566.31 16,019,028.80

其中:支付给销售机构的客户维护费 1,639,261.04 2,669,838.12

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x1.5%/当年天数。

6.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基础基金支付的托管费 1,639,261.04 2,669,838.12

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x0.25%/当年天数。

6.4.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本期 2011年1月1日至2011年6月30日 及上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日,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。

6.4.2.4 关联方投资
6.4.2.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
份额单位:份

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

基金合生收益(2009年3月20日) -- --

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 88,407,344.51 --

上期 2010年1月1日至2010年6月30日 -- --

减:期间赎回/卖出总份额 -- --

期末持有的基金份额 88,407,344.51 --

减:期间赎回/卖出总份额 -- --

期末持有的基金份额 -- --

占基金总份额比例 8.16% --

注:2010年11月12日,基金管理人持有的嘉实超短债债券109,105,470份基金份额转换为嘉实量化阿尔法股票,转换为1,000元。

6.4.2.4.2 报告期基金管理人持有的其他关联方投资本基金的情况
本期 2011年6月30日 及上年度可比期间 2010年12月31日,其他关联方未持有本基金。

6.4.2.5 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

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

银行存款 106,639,224.07 251,712.20 460,966,352.02 991,968.37

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。

6.4.2.6 本基金在承销期内参与关联方承销的情况
本期 2011年1月1日至2011年6月30日 及上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.2.7 期末本基金持有的流通受限证券
6.4.2.7.1 受限证券类别:股票
单位:人民币元

证券代码 证券名称 成功认购日期 认购类型 认购数量(单位:股) 期末市值 数量 期末总市值 期末市值占基金净资产比例

30023 冠昊 2011年6月30日 未上市 1820 1820 500 9,100.00 9,100.00 --

6.4.2.7.2 受限证券类别:债券
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

1.买入 1,147,942,144.36 -514,166,657.25

2.卖出 -- --

3.赎回 -- --

4.其他 -- --

5.其他 -- --

6.其他 -- --

7.其他 -- --

8.其他 -- --

9.其他 -- --

10.其他 -- --

11.其他 -- --

12.其他 -- --

13.其他 -- --

14.其他 -- --

15.其他 -- --

16.其他 -- --

17.其他 -- --

18.其他 -- --

7.4.2 累计卖出金额前20名的股票投资明细
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 占期末基金资产净值比例(%)

1 601699 燕安环保 35,362,494.54 2.30

2 000039 中集集团 30,022,393.56 2.03

3 600125 铁龙物流 29,374,622.96 1.99

4 002106 莱宝高科 29,205,550.72 1.98

5 002182 云海金属 29,060,977.29 1.97

6 601808 中海油服 26,418,227.64 1.79

7 600498 烽火通信 25,090,262.93 1.70

8 600111 招商局A 24,983,896.54 1.69

9 601299 中国远洋 23,643,440.60 1.60

10 000581 威孚高科 23,412,764.82 1.58

11 600709 人福医药 23,385,944.00 1.58

12 000858 广汇能源 23,315,796.19 1.58

13 601888 中国国旅 23,241,484.21 1.57

14 002086 东方海洋 22,850,791.58 1.55

15 000651 格力电器 22,813,568.24 1.54

16 601989 中国重工 22,627,263.95 1.53

17 002285 世联地产 22,558,558.71 1.53

18 600967 北方地产 21,615,259.19 1.46

19 600118 中国国旅 21,458,253.48 1.45

20 000663 中兴通讯 20,431,618.38 1.38

7.4.3 买入股票的成本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 1,732,381,023.12

卖出股票收入(成交)总额 1,986,473,388.43

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 国债券 -- --

2 央行票据 59,549,000.00 5.09

3 政策性金融债 -- --

4 企业债 -- --

5 金融债 -- --

6 中期票据 -- --