基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2011年8月24日

嘉实增长开放式证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式,适用一个基金合同和招募说明书。

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。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实增长开放式证券投资基金
基金简称	嘉实增长混合
基金主代码	070002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	928,624,120.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。
投资策略	从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票,重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票。投资组合比例范围为股票40%-75%,债券20%-55%,现金5%左右。
业绩比较基准	巨潮500(小盘)指数
风险收益特征	本基金属于中高风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	唐州歌
	联系电话	(010)65215588	(010)66594855
	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	14,651,831.75
本期利润	-563,307,498.20
加权平均基金份额本期利润	-0.5725
本期加权平均净值利润率	-11.51%
本期基金份额净值增长率	-10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	3,519,812,811.19
期末可供分配基金份额利润	3.7904
期末基金资产净值	4,448,436,931.85
期末基金份额净值	4.790
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	546.89%

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	1.76%	0.84%	4.05%	1.45%	-2.29%	-0.61%
过去三个月	-4.64%	0.79%	-7.77%	1.43%	3.13%	-0.64%
过去六个月	-10.70%	0.99%	-3.79%	1.45%	-6.91%	-0.46%
过去一年	14.85%	1.13%	30.74%	1.60%	-15.89%	-0.47%
过去三年	49.77%	1.30%	80.71%	2.26%	-30.94%	-0.96%
自基金合同生效起至今	546.89%	1.26%	262.05%	2.15%	284.84%	-0.89%

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

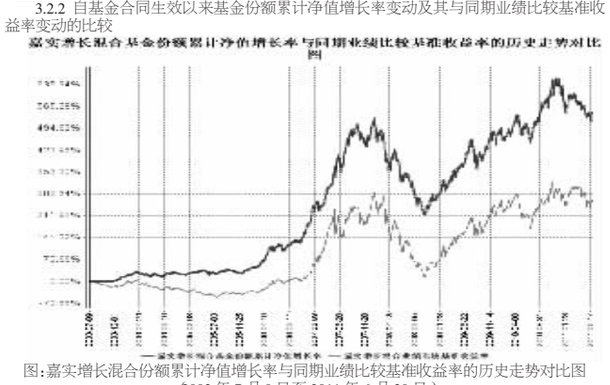

图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2003年7月9日至2011年6月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)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、广州设有分公司。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2011年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式基金、23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、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵健	本基金、嘉实策略混合基金经理、公司总经理助理	2004年4月6日	-	13	曾任职于国泰君安证券研究所,历任研究员、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月加盟嘉实基金。经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,在前期超量流动性释放与地方政府持续的投资冲动的推动下,中国经济面临的通胀压力迅速增大,为此,政府采取了从房地产到货币到物价的一系列调控政策。但由于利率、社保、出口退税、经济结构、地方政绩考核方法、中小银行改革等方面的调整相对滞后,通胀的控制过度依赖准备金率的调整,带来社会资金成本的急剧推升甚至变相高利贷的大面积出现,在这种背景下,尽管经济增速得以放缓,通胀压力有所缓和,但中小企业的当期成本上升较快,并压制利润,金融企业的当期利润虽较快增长,但资产质量留下明显隐患。资本市场在此种经济格局以及供给快速扩张的背景下,受到明显的压制,多数企业尤其是基本面受到较大冲击及供给增长较快的中小企业,估值下跌较多。

本基金在上半年基本继续保持仓位稳定,结构持续优化的策略,结构上主要投资于中小盘个股,此策略在2011年的一季度受到中小企业估值重心下移的较大冲击。为了应对这种冲击,我们对于组合从两个角度进行了调整与优化:一是对估值提出了更高的要求,二是对于成长确定性的要求进一步提高,在2季度后期,这种调整已显现一定的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为4.790元;本报告期基金份额净值增长率为-10.70%,同期业绩比较基准收益率为-3.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从下半年的资本市场面临的经济与投资环境来看,仍较复杂。一方面,美国与欧洲面临主权债务问题的困扰,并且经济短期之内仍难出现较快增长;另一方面,国内的通胀压力依然较大,前期过度依赖准备金率,资金价格双轨制的负面效应正在凸现,与此同时,资本市场供给仍然增长较快。因而,尽管市场的估值处于低位,企业盈利仍在增长,但预期A股市场仍难以出现明显改观,市场将仍以结构性机会为主。

在这种背景下,我们将仍以成长性的投资策略为主,重点投资受益于中国扩大内需和经济转型的、具有良好的成长的持续性,并且估值相对合理的股票,重点关注的领域包括食品饮料、医药、家电、信息服务、保险、地产、先进制造等,力争继续为投资人获得良好的投资回报。

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与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,委员由固定收益、交易、基金运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成,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,基金经理参加估值专业委员会会议,但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《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金基金合同》第三部分十一(二)收益分配原则5、如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配",以及本报告3.1"本期利润"为-563,307,498.20元,因此报告期内本基金未实施当期利润分配。

附说明:本基金的基金管理人于2011年1月18日发布《嘉实增长证券投资基金2010年年度收益分配公告》,实施本基金2010年度利润分配,每10份基金份额发放红利0.10元,具体参见本报告6.4.11利润分配情况"。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实增长开放式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:嘉实增长开放式证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	237,162,115.47	284,800,315.33
结算备付金		243,585.67	5,716,354.98
存出保证金		2,420,546.47	2,212,756.78
交易性金融资产	6.4.7.2	4,114,305,076.08	5,066,110,112.90
其中:股票投资		3,115,271,889.54	3,898,526,504.90
基金投资		-	-
债券投资		999,033,186.54	1,167,583,608.00
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	160,000,000.00	-
应收证券清算款		1,102,039.52	233,950,772.97
应收利息	6.4.7.5	10,936,257.34	31,005,656.88
应收股利		817,058.34	-
应收申购款		593,918.85	20,647,634.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,527,580,597.74	5,644,443,604.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债:			
短期借款			
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付证券清算款		65,700,469.83	20,763,273.70
应付赎回款		4,862,653.03	5,743,461.65
应付管理人报酬		5,391,913.44	6,958,459.59
应付托管费		898,652.26	1,159,743.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,784,901.17	3,690,860.17
应交税费		159,800.80	159,800.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	345,275.36	340,416.69
负债合计		79,143,665.89	38,816,015.87
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	928,624,120.66	1,042,960,374.02
未分配利润	6.4.7.10	3,519,812,811.19	4,562,667,214.69
所有者权益合计		4,448,436,931.85	5,605,627,588.71
负债和所有者权益总计		4,527,580,597.74	5,644,443,604.58

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值4.790元,基金份额总额928,624,120.66份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实增长开放式证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-512,236,074.32	-178,447,067.76
1.利息收入		18,463,578.66	8,460,643.90
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,234,404.86	1,063,101.97
债券利息收入		17,050,314.37	7,397,541.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		178,859.43	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		45,943,378.80	80,074,383.98
其中:股票投资收益	6.4.7.12	36,090,142.97	70,583,785.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-8,455,203.85	-33,741.97
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	18,308,439.68	9,524,340.82
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-577,959,329.95	-267,556,574.61
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	1,316,298.17	574,478.97
减:二、费用		51,071,423.88	30,273,538.79
1.管理人报酬		36,519,486.65	21,489,536.82
2.托管费		6,086,581.14	3,581,589.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	7,286,853.87	4,946,869.22
5.利息支出		1,073,960.09	160,273.77
其中:卖出回购金融资产支出		1,073,960.09	160,273.77
6.其他费用	6.4.7.19	104,542.13	95,269.48
三、利润总额		-563,307,498.20	-208,720,606.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-563,307,498.20	-208,720,606.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实增长开放式证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	1,042,960,374.02	4,562,667,214.69	5,605,627,588.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-563,307,498.20	-563,307,498.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-114,336,253.36	-469,116,259.18	-583,452,512.54
其中:1.基金申购款	109,646,330.79	440,998,428.99	550,644,759.78
2.基金赎回款	-223,982,584.15	-910,114,688.17	-1,134,097,272.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-10,430,646.12	-10,430,646.12
五、期末所有者权益(基金净值)	928,624,120.66	3,519,812,811.19	4,448,436,931.85
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	423,637,417.66	1,420,638,657.91	1,844,276,075.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-208,720,606.55	-208,720,606.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	601,953,902.71	2,069,415,138.62	2,671,369,041.33
其中:1.基金申购款	717,214,239.77	2,460,317,157.41	3,177,531,397.18
2.基金赎回款	-115,260,337.06	-390,902,018.79	-506,162,355.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-21,178,894.40	-21,178,894.40
五、期末所有者权益(基金净值)	1,025,591,320.37	3,260,154,295.58	4,285,745,615.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

赵学军 李松林 王红

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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、基金注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(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),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	36,519,486.65	21,489,536.82
其中,支付销售机构的客户维护费	3,006,845.32	1,105,918.92

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。

6.4.4.2.2 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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,086,581.14	3,581,589.50

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011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
中国银行	158,992,923.08	104,440,430.14	-	-	700,210,000.00	1,073,960.09
上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国银行	232,651,103.69	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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(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),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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(2011年6月30日)及上年度末(2010年12月31日),其他关联方未持有本基金。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	237,162,115.47	1,203,698.36	571,378,752.50	971,002.88

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.5 期末(2011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

6.4.5.1.1 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	备注
002241	歌尔声学	2010年10月20日	2011年10月21日	非公开发行流通受限	33.01	22.71	1,000,000	16,505,000.00	22,710,000.00	-
600406	国电南瑞	2010年10月25日	2011年10月21日	非公开发行流通受限	52.00	33.16	228,886	5,951,036.00	7,589,859.76	-
300239	东宝生物	2011年6月29日	2011年7月6日	未上市	9.00	9.00	500	4,500.00	4,500.00	-

注1:本基金于2010年10月20日参与认购歌尔声学股份有限公司(简称"歌尔声学")非公开发行股票,以每股33.01元的价格购入500,000股。歌尔声学于2011年6月3日实施2010年度利润分配,向全体股东以资本公积金每10股转增10股,本基金新增500,000股。

注2:本基金于2010年10月25日参与认购国电南瑞科技股份有限公司(简称"国电南瑞")非公开发行股票,以每股52.00元的价格购入114,443股。国电南瑞于2011年3月25日实施2010年度利润分配,向全体股东以资本公积金每10股转增10股,本基金新增114,443股。

6.4.5.1.2 受限证券类别:债券

本期末(2011年6月30日),本基金未持有流通受限的债券。

6.4.5.1.3 受限证券类别:其他

本期末(2011年6月30日),本基金未持有其他受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010年12月6日	筹划国资改革事宜停牌	35.60	未知	未知	1,336,269	30,769,979.78	47,571,176.40	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,115,271,889.54	68.81
	其中:股票	3,115,271,889.54	68.81
2	固定收益投资	999,033,186.54	22.07
	其中:债券	999,033,186.54	22.07
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	160,000,000.00	3.53
	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	237,405,701.14	5.24
6	其他各项资产	15,869,820.52	0.35
7	合计	4,527,580,597.74	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	13,552,526.00	0.30
B	采掘业	119,737,512.80	2.69
C	制造业	2,163,666,552.50	48.64
C0	食品、饮料	623,664,350.53	14.02
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,284,745.92	0.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	53,354,745.02	1.20
C5	电子	95,651,281.86	2.15
C6	金属、非金属	156,650,874.59	3.52
C7	机械、设备、仪表	610,818,379.19	13.73
C8	医药、生物制品	616,242,175.39	13.85
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,316,539.64	0.93
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	342,538,431.26	7.70
H	批发和零售贸易	67,856,375.94	1.53
I	金融、保险业	219,011,500.71	4.92
J	房地产业	144,736,291.61	3.25
K	社会服务业	2,856,159.08	0.06
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,115,271,889.54	70.03

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	8,448,813	198,547,105.50	4.46
2	600406	国电南瑞	4,527,583	163,632,560.86	3.68
3	000650	仁和药业	10,623,307	151,169,658.61	3.40
4	600887	伊利股份	8,755,790	145,783,903.50	3.28
5	600750	江中药业	5,600,486	137,099,897.28	3.08
6	600570	恒生电子	8,650,969	128,380,379.96	2.89
7	600537	海通集团	3,464,154	126,857,319.48	2.85
8	600809	山西汾酒	1,763,875	123,559,443.75	2.78
9	000157	中联重科	7,999,879	123,038,139.02	2.77
10	000895	双汇发展	1,746,833	115,413,256.31	2.59

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	169,207,720.92	3.02
2	000877	天山股份	149,118,293.15	2.66
3	600660	福耀玻璃	128,644,653.57	2.29
4	601318	中国平安	125,954,566.54	2.25
5	000157	中联重科	122,071,485.37	2.18
6	600809	山西汾酒	119,605,913.82	2.13
7	600031	三一重工	109,595,578.92	1.96
8	600362	江西铜业	99,008,006.92	1.77
9	600720	祁连山	98,847,729.43	1.76
10	000895	双汇发展	90,036,494.54	1.61
11	000651	格力电器	74,415,606.11	1.33
12	000792	盐湖股份	63,831,712.39	1.14
13	601088	中国神华	59,549,039.63	1.06
14	000002	万 科A	51,256,447.74	0.91
15	000528	柳 工	50,628,752.53	0.90
16	601288	农业银行	47,551,052.68	0.85
17	600123	兰花科创	44,296,587.46	0.79
18	002106	莱宝高科	44,136,028.20	0.79
19	600432	吉恩镍业	43,985,268.14	0.78
20	002073	软控股份	42,422,189.52	0.76

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	239,207,265.57	4.27
2	000060	中金岭南	227,383,256.31	4.06
3	600537	海通集团	144,723,695.71	2.58
4	000877	天山股份	129,854,266.00	2.32
5	002073	软控股份	108,946,921.78	1.94
6	600036	招商银行	103,709,786.61	1.85
7	600660	福耀玻璃	95,785,567.60	1.71
8	002230	科大讯飞	87,482,552.47	1.56
9	002106	莱宝高科	77,277,221.08	1.38
10	600267	海正药业	67,538,205.50	1.20
11	600031	三一重工	64,748,735.14	1.16
12	000848	承德露露	63,908,021.04	1.14
13	601318	中国平安	57,082,570.36	1.02
14	000998	隆平高科	55,336,866.94	0.99
15	000792