嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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：2013年8月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月20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。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
基金简称	嘉实量化阿尔法股票
基金主代码	070017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月20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
报告期末基金份额总额	845,075,805.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配置大类资产；股票投资以"定量投资"为主，依托内部自主研发的嘉实行业选择模型、嘉实Alpha多因素模型以及嘉实组合优化器以及强大的数据库系统，同时辅以"定性投资"策略；债券投资采取"自上而下"的策略。
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	赵会军
	联系电话	（010）65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400－600－8800	95588
传真		（010）65182266	(010)66105798

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(2013年1月1日－2013年6月30日)
本期已实现收益	23,961,953.20
本期利润	－41,959,500.49
加权平均基金份额本期利润	－0.0469
本期加权平均净值利润率	－5.53%
本期基金份额净值增长率	－6.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	－188,166,307.36
期末可供分配基金份额利润	－0.2227
期末基金资产净值	656,909,498.31
期末基金份额净值	0.777
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	－17.24%

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	－11.40%	1.45%	－11.78%	1.40%	0.38%	0.05%
过去三个月	－6.27%	1.19%	－8.69%	1.09%	2.42%	0.10%
过去六个月	－6.39%	1.33%	－9.14%	1.12%	2.75%	0.21%
过去一年	－9.33%	1.24%	－6.92%	1.02%	－2.41%	0.22%
过去三年	－17.86%	1.34%	－7.49%	1.03%	－10.37%	0.31%
自基金合同生效起至今	－17.24%	1.47%	－0.34%	1.14%	－16.90%	0.33%

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作为股票型基金，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：

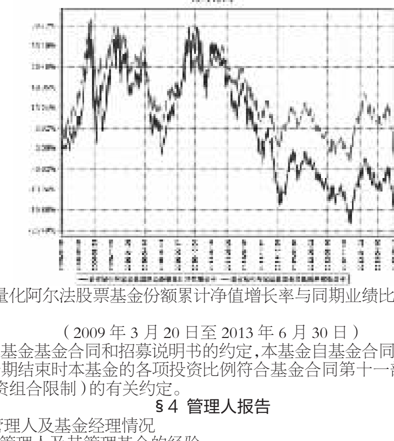
Benchmark(0)=1000

Return(t)=75%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t－1)－1)＋25%×(上证国债指数(t)/上证国债指数(t－1)－1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t－1)

其中t=1,2,3,…。

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：嘉实量化阿尔法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

（2009年3月20日至2013年6月30日）

注：根据本基金基金合同和招募说明书的约定，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、投资范围和五、（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、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2013年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金，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300ETF联接（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、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII－FOF－LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、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		
陶羽	本基金基金经理	2009年3月20日	－	9年	曾任美国高盛公司定量分析师，美国德意志资产管理公司高级定量分析师，基金经理。2008年8月加盟嘉实基金，任高级定量分析师。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

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、《嘉实量化阿尔法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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；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投资组合。

4.3.2 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

上半年股票市场大幅震荡。一月份市场在经济复苏的预期下持续上涨，之后经济不达预期等利空连续打压市场。尤其是在六月份银行间资金市场紧张、IPO重启等多重因素的冲击下，A股大跌。市场板块分化很大，今年前六月沪深300跌幅达12.78%，而创业板指数逆市上涨41.7%。稳定消费类板块以及成长类板块表现优异，传统周期股表现落后。

年初我们对经济复苏比较乐观，配置的部分低估值的周期板块跌幅很大，使整体组合表现不尽人意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为0.777元；本报告期基金份额净值增长率为－6.39%，业绩比较基准收益率为－9.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年整体宏观形势比较谨慎。目前，制造业PMI等数据显示实体经济景气较弱。之后一段时间宏观经济数据好转的可能性较小。政策要同时兼顾稳增长、防通胀、控制债务风险等多重目标，腾挪空间有限。目前工业企业以及金融业都处于去杠杆的阶段，整体盈利能力将逐渐下移，市场估值中枢难以大幅提高。

在这种情况下，我们认为市场系统性机会有限，但结构性行情仍将持续。本基金在资产配置上将采取中等仓位。在股票配置上继续严格依据定量模型，寻找那些估值合理、业绩确定性强、盈利增长稳定的蓝筹股，以及那些受益于经济结构转型、预期盈利增速更有吸引力的投资标的。

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、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，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，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

（1）报告期内本基金未实施利润分配；

（2）根据本报告3.1.1"本期利润"为－41,959,500.49元、3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为－0.2227元、3.1.2"期末基金份额净值"为0.777元，以及本基金基金合同第十五部分三、收益分配原则"4、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值"，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§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，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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量化阿尔法股票型证券投资基金2013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：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,655,933.77	27,273,212.56
结算备付金		1,219,339.32	1,568,811.14
存出保证金		237,120.49	537,044.47
交易性金融资产	6.4.7.2	620,316,084.08	765,102,747.70
其中：股票投资		581,939,784.78	732,599,607.36
基金投资		－	－
债券投资		38,376,299.30	32,503,140.34
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	23,000,000.00	－
应收证券清算款		5,334,117.03	25,035,000.00
应收利息	6.4.7.5	782,322.22	262,314.06
应收股利		598,600.94	－
应收申购款		212,056.26	71,683.77
递延所得税资产		－	－
其他资产	6.4.7.6	－	－
资产总计		661,355,574.11	819,850,813.70
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2013年6月30日**	**上年度末 2012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		1,813,708.48	－
应付赎回款		518,097.26	36,654,372.77
应付管理人报酬		858,400.41	969,187.18
应付托管费		143,066.73	161,531.21
应付销售服务费		－	－
应付交易费用	6.4.7.7	919,089.20	1,125,255.70
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	193,713.72	290,657.59
负债合计		4,446,075.80	39,201,004.45
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	845,075,805.67	940,874,180.44
未分配利润	6.4.7.10	－188,166,307.36	－160,224,371.19
所有者权益合计		656,909,498.31	780,649,809.25
负债和所有者权益总计		661,355,574.11	819,850,813.70

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.777元，基金份额总额845,075,805.67份。

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

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		－32,203,745.57	50,463,064.06
1.利息收入		819,836.40	1,171,555.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	121,593.19	195,344.45
债券利息收入		504,786.11	534,680.36
资产支持证券利息收入		－	－
买入返售金融资产收入		193,457.10	441,530.25
其他利息收入		－	－
2.投资收益		32,866,471.71	－23,530,736.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,389,505.25	－31,487,681.01
基金投资收益		－	－
债券投资收益	6.4.7.13	5,095.40	15,940.00
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	7,471,871.06	7,941,004.92
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	－65,921,453.69	72,700,426.46
4.汇兑收益		－	－
5.其他收入	6.4.7.17	31,400.01	121,818.63
减：二、费用		9,755,754.92	11,393,686.44
1. 管理人报酬		5,651,652.43	6,881,433.75
2. 托管费		941,942.06	1,146,905.59
3. 销售服务费		－	－
4. 交易费用	6.4.7.18	2,956,037.99	3,151,682.40
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	206,122.44	213,664.70
三、利润总额		－41,959,500.49	39,069,377.62
减：所得税费用		－	－
四、净利润		－41,959,500.49	39,069,377.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	940,874,180.44	－160,224,371.19	780,649,809.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	－41,959,500.49	－41,959,500.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	－95,798,374.77	14,017,564.32	－81,780,810.45
其中：1.基金申购款	28,382,961.87	－4,271,069.27	24,111,892.60
2.基金赎回款	－124,181,336.64	18,288,633.59	－105,892,703.05
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）	845,075,805.67	－188,166,307.36	656,909,498.31
项目	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	1,042,163,776.85	－186,390,566.49	855,773,210.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	39,069,377.62	39,069,377.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	－13,453,585.80	398,918.02	－13,054,667.78
其中：1.基金申购款	132,508,734.74	－15,570,752.54	116,937,982.20
2.基金赎回款	－145,962,320.54	15,969,670.56	－129,992,649.98
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）	1,028,710,191.05	－146,922,270.85	881,787,920.20

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

基金管理人负责人　　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 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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
中国工商银行股份有限公司（中国工商银行）	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（2013年1月1日至2013年6月30日）及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,651,652.43	6,881,433.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,043,341.38	1,198,605.20

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	941,942.06	1,146,905.59

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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2013年1月1日至2013年6月30日）及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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。

6.4.4.4 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

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
基金合同生效日（2009年3月20日）持有的基金份额	－	－
期初持有的基金份额	44,407,344.51	88,407,344.51
期间申购／买入总份额	－	－
期间因拆分变动份额	－	－
减：期间赎回／卖出总份额	－	－
期末持有的基金份额	44,407,344.51	88,407,344.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.25%	8.59%

(1)2010年11月12日，基金管理人持有的嘉实超短债债券109,105,450.70份基金份额转换为嘉实量化阿尔法股票，转换费为1,000元。

(2)2012年12月28日，本基金管理人通过嘉实量化阿尔法股票基金代销机构赎回本基金管理人持有的嘉实量化阿尔法股票44,000,000份基金份额，适用赎回费率为0%。

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（2013年6月30日）及上年度末（2012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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	9,655,933.77	103,378.00	16,723,452.95	178,777.09

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2013年1月1日至2013年6月30日）及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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（2013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

本期末（2013年6月30日），本基金未持有因认购新发／增发证券而流通受限的证券。

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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项停牌	29.60	2013年8月19日	26.51	235,030	6,612,569.96	6,956,888.00	－
300133	华策影视	2013年5月28日	重大事项停牌	24.43	2013年7月30日	26.87	220,000	3,923,041.20	5,374,600.00	－
600436	片仔癀	2013年6月21日	配股停牌	136.82	2013年7月1日	118.73	34,940	4,229,787.84	4,780,490.80	－
600547	山东黄金	2013年4月3日	重大事项停牌	32.13	2013年7月1日	28.77	29,578	953,123.18	950,341.14	－
601918	国投新集	2013年5月16日	重大事项停牌	7.55	2013年8月23日	5.05	739,446	6,863,989.91	5,582,817.30	－

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（2013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（2013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	581,939,784.78	87.99
	其中：股票	581,939,784.78	87.99
2	固定收益投资	38,376,299.30	5.80
	其中：债券	38,376,299.30	5.80
	资产支持证券	－	－
3	金融衍生品投资	－	－
4	买入返售金融资产	23,000,000.00	3.48
	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	10,875,273.09	1.64
6	其他各项资产	7,164,216.94	1.08
	合计	661,355,574.11	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	19,094,477.38	2.91
C	制造业	372,442,482.67	56.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,725,075.66	3.00
E	建筑业	21,751,110.39	3.31
F	批发和零售业	21,623,582.67	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	9,680,619.44	1.47
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,666,452.50	1.78
J	金融业	35,923,723.94	5.47
K	房地产业	36,886,628.90	5.62
L	租赁和商务服务业	9,339,707.10	1.42
M	科学研究和技术服务业	4,922,756.64	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	3,872,400.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	12,063,663.49	1.84
S	综合	2,947,104.00	0.45
	合计	581,939,784.78	88.59

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	600887	伊利股份	528,123	16,519,687.44	2.51
2	000527	美的电器	1,039,339	12,908,590.38	1.97
3	600422	昆明制药	446,383	11,829,149.50	1.80
4	000651	格力电器	463,431	11,613,580.86	1.77
5	000895	双汇发展	279,436	10,741,519.84	1.64
6	600085	同仁堂	439,600	9,618,448.00	1.46
7	600309	万华化学	585,660	9,382,273.20	1.43
8	600563	法拉电子	487,320	8,606,071.20	1.31
9	601933	永辉超市	706,271	8,242,182.57	1.25
10	600518	康美药业	424,100	8,155,443.00	1.24

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	15,501,395.35	1.99
2	600000	浦发银行	12,239,284.97	1.57
3	603366	日出东方	11,953,085.42	1.53
4	000651	格力电器	11,678,888.76	1.50
5	600422	昆明制药	11,409,532.20	1.46
6	000895	双汇发展	11,084,474.27	1.42
7	600887	伊利股份	11,018,014.15	1.41
8	600030	中信证券	10,912,477.99	1.40
9	601800	中国交建	10,840,490.94	1.39
10	600036	招商银行	10,812,970.77	1.39
11	600085	同仁堂	10,596,200.89	1.36
12	000562	宏源证券	10,550,286.00	1.35
13	600309	万华化学	10,546,308.49	1.35
14	600138	中青旅	10,403,968.24	1.33
15	600261	阳光照明	9,818,792.12	1.26
16	000028	国药一致	9,470,024.13	1.21
17	002511	中顺洁柔	9,250,624.75	1.18
18	601933	永辉超市	9,182,273.09	1.18
19	600585	海螺水泥	8,963,857.31	1.15
20	600586	金晶科技	8,772,542.34	1.12

7.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

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	000001	平安银行	15,736,358.05	2.02
2	600060	海信电器	14,862,045.97	1.90
3	600755	厦门国贸	13,747,828.34	1.76
4	600067	冠城大通	13,736,142.04	1.76
5	601169	北京银行	13,482,909.50	1.73
6	603366	日出东方	12,376,340.55	1.59
7	600329	中新药业	12,300,230.28	1.58
8	600015	华夏银行	11,938,356.51	1.53
9	600500	中化国际	11,756,839.81	1.51
10	000876	新希望	11,691,906.62	1.50
11	600000	浦发银行	11,358,732.53	1.46
12	601318	中国平安	11,023,869.51	1.41
13	600586	金晶科技	10,610,045.60	1.36
14	002308	威创股份	9,848,106.66	1.26
15	000562	宏源证券	9,797,286.82	1.26
16	600016	民生银行	9,766,866.76	1.25
17	601998	中信银行	9,679,654.58	1.24
18	601088	中国神华	9,621,517.95	1.23
19	000002	万科A	9,584,101.15	1.23
20	600066	宇通客车	9,564,811.71	1.23

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	895,343,620.50
卖出股票收入（成交）总额	1,005,744,967.18

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	－	－
3	金融债券	29,888,000.00	4.55
	其中：政策性金融债	29,888,000.00	4.55
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	8,488,299.30	1.29
8	其他	－	－
	合计	38,376,299.30	5.84

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	120238	12国开38	200,000	19,932,000.00	3.03
2	120318	12进出18	100,000	9,956,000.00	1.52
3	110022	同仁转债	40,000	5,185,200.00	0.79
4	110003	新钢转债	10,280	1,070,662.00	0.16
5	110015	石化转债	10,000	998,200.00	0.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，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

报告期末，本基金未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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、处罚。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	237,120.49
2	应收证券清算款	5,334,117.03
3	应收股利	598,600.94
4	应收利息	782,322.22
5	应收申购款	212,056.26
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
	合计	7,164,216.94

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110022	同仁转债	5,185,200.00	0.79
2	110003	新钢转债	1,070,662.00	0.16
3	110015	石化转债	998,200.00	0.15
4	110020	南山转债	402,637.30	0.06

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
28,767	29,376.57	69,103,060.13	8.18%	775,972,745.54	91.82%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	400,811.20	0.05%

8.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理持有本基金情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月20日）基金份额总额	2,961,222,796.80
本报告期期初基金份额总额	940,874,180.44
本报告期基金总申购份额	28,382,961.87
减：本报告期基金总赎回份额	124,181,336.64
本报告期基金拆分变动份额	－
本报告期期末基金份额总额	845,075,805.67

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；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

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（特殊普通合伙）。

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 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
北京高华证券有限责任公司	2	808,491,328.86	42.53%	727,684.91	42.35%	－
国泰君安证券股份有限公司	2	286,134,514.22	15.05%	258,923.82	15.07%	－
中信建投证券股份有限公司	2	274,625,722.75	14.45%	250,018.05	14.55%	－
中信证券股份有限公司	2	229,437,648.88	12.07%	208,878.43	12.16%	－
中国银河证券股份有限公司	1	165,967,118.69	8.73%	151,097.41	8.79%	－
广发证券股份有限公司	1	57,022,490.41	3.00%	50,459.41	2.94%	－
国都证券有限责任公司	1	42,127,310.77	2.22%	38,353.13	2.23%	－
招商证券股份有限公司	2	22,683,710.46	1.19%	20,072.98	1.17%	－
国金证券股份有限公司	1	14,598,742.64	0.77%	12,918.54	0.75%	－
德邦证券有限责任公司	1	－	－	－	－	－
光大证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
国信证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
海通证券股份有限公司	2	－	－	－	－	－
华福证券有限责任公司	1	－	－	－	－	－
华泰证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
民生证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
申银万国证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
兴业证券股份有限公司	1	－	－	－	－	－
长城证券有限责任公司	1	－	－	－	－	－
中国国际金融有限公司	1	－	－	－	－	－
中国中投证券有限责任公司	1	－	－	－	－	－
中银国际证券有限责任公司	1	－	－	－	－	－

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 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
北京高华证券有限责任公司	－	－	120,000,000.00	44.28%	－	－
中信证券股份有限公司	5,367,000.00	99.69%	151,000,000.00	55.72%	－	－
国金证券股份有限公司	16,883.10	0.31%	－	－	－	－

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
2013年8月26日