嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

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	嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实回报混合
基金主代码	070018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月18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	1,835,172,947.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力争每年获得较高的绝对回报
投资策略	自上而下、从大类资产到个券选择的配置策略。大类资产配置:依据自主开发的战术资产配置模型,在遵守有关投资限制规定的前提下,合理分配各类资产投资比例。股票投资策略:优先进行行业配置,在行业内精选个股。债券投资策略:以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅。
业绩比较基准	同期人民币一年期定期存款利率(税前)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金及货币市场基金。

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	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	95566
	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(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	105,929,500.60
本期利润	-5,368,008.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0028
本期加权平均净值利润率	-0.31%
本期基金份额净值增长率	-0.70%
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	-268,139,155.45
期末可供分配基金份额利润	-0.1461
期末基金资产净值	1,567,033,792.42
期末基金份额净值	0.854
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	-11.69%

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	-7.48%	1.09%	0.25%	0.01%	-7.73%	1.08%
过去三个月	-2.40%	0.97%	0.75%	0.01%	-3.15%	0.96%
过去六个月	-0.70%	1.09%	1.50%	0.01%	-2.20%	1.08%
过去一年	-4.47%	0.98%	3.05%	0.01%	-7.52%	0.97%
过去三年	-4.79%	0.99%	9.64%	0.01%	-14.43%	0.98%
自基金合同生效起至今	-11.69%	1.02%	11.80%	0.01%	-23.49%	1.01%

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

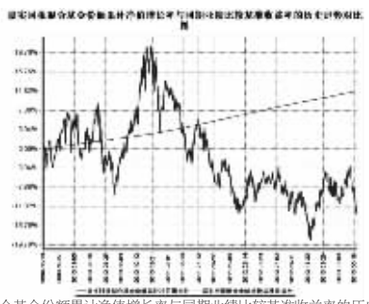

图:嘉实回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年8月18日至2013年6月30日)

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(十四(二)投资范围和(七)2、基金投资组合比例限制)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		
赵勇	本基金基金经理	2009年8月18日	-	11年	曾任大成基金管理公司基金经理助理,泰康资产管理公司权益投资经理。2008年3月加入嘉实基金管理公司。北京大学光华管理学院工商管理硕士,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、《嘉实回报灵活配置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,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

上半年市场整体呈现先涨后跌的走势, 年初市场对经济复苏和新领导班子倡导的改革充满预期,市场整体快速上涨。但随后特别是二季度开始,经济数据明显低于预期,经济在二季度开始再次出现下滑的苗头。在M2增速大幅高于管理层13%的目标增速的情况下,经济并未出现明显的起色,增强了市场对潜在经济增速将显著下行的担忧,对市场表现造成比较大的压力。另外市场对债务规模的关注有所增加,担心全社会投资增速无法维持,金融以及与投资相关的行业受到比较大的压力,拖累市场持续下跌。与投资相关度不大,更多与经济转型相关的部分行业和创业板出现了比较大的上涨。

本基金上半年采用了均衡配置的策略,只略微超配了医药、消费电子等消费类行业,其他行业基本中性配置。

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0.854元;本报告期基金份额净值增长率为-0.70%,业绩比较基准收益率为1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于我国总债务规模的迅速扩大, 以投资为主要动力的经济发展模式面临很大的转型压力,因投资增速下降导致的经济减速可能难以避免。出口方面,国际需求在经济没有明显起色的情况下难有大的增长,加上贸易保护主义的抬头,出口很难有明显的起色。新股即将开闸,加上下半年流动性状况可能会弱于上半年,市场的压力不会减弱,下半年市场整体不会有趋势性机会。

下半年本基金将继续维持较低仓位,持有确定性成长类股票,同时保持配置的均衡。

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

根据本基金基金合同(十九(二)收益分配原则)"3、基金收益分配后,可供分配利润计算截至日的每份基金份额净值扣减每份基金份额所派发的红利后不能低于面值"; 本报告3.1.1"本期利润"为-5,368,008.27元、3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为-0.1461元、3.1.2"期末基金份额净值"为0.854元。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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金(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:嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

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	46,883,173.28	109,456,743.75
结算备付金		2,923,806.36	14,476,959.25
存出保证金		767,457.20	459,417.51
交易性金融资产	6.4.7.2	1,261,146,644.08	1,521,038,195.65
其中:股票投资		917,706,976.28	1,151,683,292.75
基金投资		-	-
债券投资		343,439,667.80	369,354,902.90
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	244,400,886.60	80,000,000.00
应收证券清算款		1,928,458.57	-
应收利息	6.4.7.5	9,212,589.20	6,530,394.42
应收股利		4,792,896.40	-
应收申购款		144,341.73	61,590.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,572,200,253.42	1,732,023,300.73
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		-	2,141,580.16
应付赎回款		986,041.94	1,947,327.88
应付管理人报酬		2,011,127.07	2,095,698.90
应付托管费		335,187.84	349,283.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,596,750.88	1,663,109.46
应交税费		38,841.60	38,841.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,511.67	300,735.13
负债合计		5,166,461.00	8,536,576.24
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,835,172,947.87	2,004,068,098.72
未分配利润	6.4.7.10	-268,139,155.45	-280,581,374.23
所有者权益合计		1,567,033,792.42	1,723,486,724.49
负债和所有者权益总计		1,572,200,253.42	1,732,023,300.73

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.854元,基金份额总额1,835,172,947.87份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

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		16,911,601.68	75,649,132.25
1.利息收入		8,212,548.92	11,809,965.86
其中:存款利息收入	6.4.7.11	452,102.99	783,335.38
债券利息收入		6,174,505.00	7,006,701.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,585,940.93	4,019,928.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益		119,986,059.25	-4,268,122.49
其中:股票投资收益	6.4.7.12	100,692,065.97	-13,079,625.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,660,909.07	812,033.28
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	15,633,084.21	7,999,470.19
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-111,297,508.87	68,086,430.91
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	10,502.38	20,857.97
减:二、费用		22,279,609.95	25,513,481.23
1. 管理人报酬		12,726,410.49	14,377,627.75
2. 托管费		2,121,068.37	2,396,271.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,205,905.33	8,412,924.46
5. 利息支出		-	100,069.46
其中:卖出回购金融资产支出		-	100,069.46
6. 其他费用	6.4.7.19	226,225.76	226,588.36
三、利润总额		-5,368,008.27	50,135,651.02
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-5,368,008.27	50,135,651.02

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

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)	2,004,068,098.72	-280,581,374.23	1,723,486,724.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,368,008.27	-5,368,008.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-168,895,150.85	17,810,227.05	-151,084,923.80
其中:1.基金申购款	13,295,554.46	-1,452,689.49	11,842,864.97
2.基金赎回款	-182,190,705.31	19,262,916.54	-162,927,788.77
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)	1,835,172,947.87	-268,139,155.45	1,567,033,792.42
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)	2,205,927,820.98	-282,594,208.83	1,923,333,612.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,135,651.02	50,135,651.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-89,620,976.66	9,165,807.80	-80,455,168.86
其中:1.基金申购款	23,254,581.94	-2,761,588.29	20,492,993.65
2.基金赎回款	-112,875,558.60	11,927,396.09	-100,948,162.51
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)	2,116,306,844.32	-223,292,750.01	1,893,014,094.31

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 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

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(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	12,726,410.49	14,377,627.75
其中:支付销售机构的客户维护费	2,118,769.03	2,395,186.30

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	2,121,068.37	2,396,271.20

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 2013年1月1日至2013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	90,519,937.40	71,056,367.95	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	-	-	-	-	150,600,000.00	100,069.46

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(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),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(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
中国银行	46,883,173.28	196,657.13	100,966,183.11	636,964.28

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(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

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	备注
600592	龙溪股份	2013年4月23日	2014年4月23日	非公开发行流通受限	6.72	6.79	1,000,000	6,720,000.00	6,790,000.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别:债券

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债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别:其他

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其他证券。

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
000998	隆平高科	2013年5月3日	重大事项停牌	20.73	2013年7月8日	20.50	401,903	8,043,805.29	8,331,449.19	-
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	100,264	2,622,994.78	2,967,814.40	-
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	373,836	4,737,810.39	9,132,813.48	-
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	1,542,988	16,672,043.36	11,649,559.40	-

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(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	917,706,976.28	58.37
	其中:股票	917,706,976.28	58.37
2	固定收益投资	343,439,667.80	21.84
	其中:债券	343,439,667.80	21.84
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	244,400,886.60	15.55
	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	49,806,979.64	3.17
6	其他各项资产	16,845,743.10	1.07
	合计	1,572,200,253.42	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	10,452,326.19	0.67
B	采矿业	31,767,910.58	2.03
C	制造业	438,838,764.45	28.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,423,791.34	2.20
E	建筑业	21,189,561.60	1.35
F	批发和零售业	23,257,932.41	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	25,116,142.56	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,145,737.20	1.67
J	金融业	195,643,973.02	12.48
K	房地产业	66,731,037.23	4.26
L	租赁和商务服务业	13,265,954.48	0.85
M	科学研究和技术服务业	4,429,360.24	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	8,051,042.30	0.51
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	14,414,463.48	0.92
S	综合	3,978,979.20	0.25
	合计	917,706,976.28	58.56

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	601939	建设银行	6,893,100	28,606,365.00	1.83
2	601398	工商银行	6,261,000	25,169,220.00	1.61
3	002618	丹邦科技	1,149,967	24,344,801.39	1.55
4	601288	农业银行	9,620,600	23,666,676.00	1.51
5	600036	招商银行	1,932,654	22,418,786.40	1.43
6	002185	华天科技	2,879,939	22,261,928.47	1.42
7	600030	中信证券	2,080,973	21,080,256.49	1.35
8	600535	天士力	449,300	17,590,095.00	1.12
9	601006	大秦铁路	2,821,500	16,759,710.00	1.07
10	002038	双鹭药业	276,283	16,190,183.80	1.03

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	601398	工商银行	60,549,859.00	3.51
2	601939	建设银行	58,657,655.18	3.40
3	600036	招商银行	55,151,818.38	3.20
4	600016	民生银行	53,322,388.49	3.09
5	601628	中国人寿	50,924,142.03	2.95
6	601318	中国平安	45,043,553.49	2.61
7	600030	中信证券	44,750,036.15	2.60
8	601288	农业银行	39,159,000.00	2.27
9	600000	浦发银行	37,637,055.31	2.18
10	601169	北京银行	36,432,826.10	2.11
11	600261	阳光照明	30,746,292.43	1.78
12	600519	贵州茅台	30,575,731.92	1.77
13	601166	兴业银行	28,196,214.93	1.64
14	002081	金螳螂	27,255,143.71	1.58
15	002618	丹邦科技	26,903,184.55	1.56
16	002185	华天科技	24,525,544.15	1.42
17	600592	龙溪股份	23,936,870.10	1.39
18	000895	双汇发展	23,691,103.39	1.37
19	601006	大秦铁路	22,686,400.86	1.32
20	000970	中科三环	21,134,503.01	1.23

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	600535	天士力	78,603,979.68	4.56
2	600887	伊利股份	75,743,491.12	4.39
3	002241	歌尔声学	74,225,994.28	4.31
4	600000	浦发银行	64,674,792.53	3.75
5	600104	上汽集团	59,987,689.98	3.48
6	002037	久联发展	54,019,749.72	3.13
7	600016	民生银行	53,190,042.58	3.09
8	600199	金种子酒	51,570,443.20	2.99
9	601628	中国人寿	50,040,021.96	2.90
10	601918	国投新集	49,969,025.49	2.90
11	002635	安洁科技	49,274,612.12	2.86
12	002038	双鹭药业	47,260,775.79	2.74
13	600079	人福医药	46,419,616.31	2.69
14	601166	兴业银行	44,986,740.78	2.61
15	000999	华润三九	44,823,188.35	2.60
16	600518	康美药业	35,836,873.14	2.08
17	000937	冀中能源	35,716,489.69	2.07
18	601398	工商银行	35,159,836.15	2.04
19	601169	北京银行	35,006,851.08	2.03
20	600549	厦门钨业	34,840,772.40	2.02

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	2,217,530,754.86
卖出股票收入(成交)总额	2,443,546,246.53

注:7.4.1"买入金额"、7.4.2"卖出金额"及7.4.3"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	191,955,000.00	12.25
	其中:政策性金融债	191,955,000.00	12.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,847,000.00	3.18
6	中期票据	90,447,000.00	5.77