

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:2014年8月25日

嘉实周期优选股票型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日 单位:人民币元

当期发生的基金应支付的托管费 377,254.18 上年度可比期间 229,653.83

支付基金托管人中国工商银行的托管费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。

4.6 管理人应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及基金托管人一同进行,基金估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、季末和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期,本基金托管人在对嘉实周期优选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持有人利益的行为,完全尽职尽责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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 本报告期,本基金托管人对嘉实周期优选股票型证券投资基金的投资、净值计算、利润分配等情况进行了认真审核,未发现基金管理人有违反法律法规及基金合同的行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,在各项重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期,嘉实周期优选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内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人对嘉实周期优选股票型证券投资基金的托管过程中,未发现基金管理人有违反法律法规及基金合同的行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,在各项重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期,嘉实周期优选股票型证券投资基金未进行利润分配。

6.1 资产负债表 会计主体:嘉实周期优选股票型证券投资基金 报告截止日期:2014年6月30日

资产 附注号 2014年6月30日 2013年12月31日

货币资金 6.4.7.1 12,363,995.48 48,176,030.79

应收利息 6.4.7.2 226,809,915.68 282,756,571.20

可供出售金融资产 6.4.7.3 226,300,833.08 282,174,203.70

持有至到期投资 6.4.7.4 580,032.60 582,367.50

金融资产合计 6.4.7.5 5,546.60 12,644.44

负债和所有者权益 附注号 2014年6月30日 2013年12月31日

短期借款 6.4.7.6 79.97 未知

应付利息 6.4.7.7 320,216.84 241,153.73

应付股利 6.4.7.8 1,610,443.87 3,305,247.61

应付债券 6.4.7.9 1,610,443.87 3,305,247.61

所有者权益合计 6.4.7.10 204,265,855.83 319,307,713.33

资产总计 240,391,108.48 332,281,478.52

负债和所有者权益总计 240,391,108.48 332,281,478.52

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.169元,基金份额总额204,265,855.83份。

6.2 利润分配 会计主体:嘉实周期优选股票型证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目 附注号 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

一、收入 6,709,038.96 3,509,245.76

1.利息收入 147,569.11 225,454.84

其中:存款利息收入 145,645.79 225,454.84

债券利息收入 1,723.32

资产支持证券利息收入 1,232.32

买入返售金融资产收入 1,095,996.99 39,230,610.09

其他收入 10,995,996.99 39,230,610.09

其中:公允价值变动收益 9,384,953.12 35,925,362.48

2.投资收益 6.4.7.13 1,095,996.99 39,230,610.09

其中:股票投资收益 6.4.7.13 1,095,996.99 39,230,610.09

基金投资收益 6.4.7.13 1,095,996.99 39,230,610.09

债券投资收益 6.4.7.13 1,095,996.99 39,230,610.09

资产支持证券投资收入 6.4.7.13 1,095,996.99 39,230,610.09

金融衍生工具收益 6.4.7.14 1,095,996.99 39,230,610.09

公允价值变动收益 6.4.7.15 1,610,443.87 3,305,247.61

其他收入 6.4.7.16 1,610,443.87 3,305,247.61

二、费用 4,425,932.66 6,693,845.61

1.管理费用 2,263,325.26 3,173,814.81

2.托管费 377,254.18 529,635.83

3.销售服务费 6.4.7.18 1,595,352.23 2,389,332.53

4.交易费用 6.4.7.19 1,595,352.23 2,389,332.53

5.利息支出 6.4.7.20 1,595,352.23 2,389,332.53

其中:应付债券利息支出 6.4.7.20 1,595,352.23 2,389,332.53

6.其他费用 6.4.7.21 1,595,352.23 2,389,332.53

其中:公允价值变动收益 6.4.7.21 1,595,352.23 2,389,332.53

三、利润总额 2,283,106.30 -3,184,599.75

减:所得税费用 2,283,106.30 -3,184,599.75

四、净利润 0.00 0.00

五、所有者权益(或基金净值)变动表 会计主体:嘉实周期优选股票型证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目 2014年1月1日 2014年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 272,512,218.25 46,815,594.48

二、本期投资运作产生的基金净值变动(含估值增值) 2,283,106.30 2,283,106.30

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动 68,249,357.02 -14,836,603.62

其中:基金申购款 115,099,677.91 18,092,743.55

2.基金赎回款 -183,349,034.93 -32,729,747.57

四、本期基金份额持有人申购、赎回、转换、转入、转出及红利再投资产生的基金净值变动 204,265,855.83 34,462,007.16

五、期末所有者权益(基金净值) 328,902,896.62 -4,302,932.54

六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

二十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

三十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

四十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

五十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

六十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十一、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十二、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十三、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十四、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十五、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十六、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十七、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十八、未分配利润 328,902,896.62 -4,302,932.54

七十九、未分配利润 328,902,896.62 -4,3