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:2014年8月25日

# 嘉实增长开放式证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014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2014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2014年1月1日起至2014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 | 590,554,411.96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 | 王永民 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | (010)66594896 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.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(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 136,309,602.93 |
| 本期利润 | -14,712,126.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0240 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 2,488,921,739.11 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 4.2146 |
| 期末基金资产净值 | 3,079,476,151.07 |
| 期末基金份额净值 | 5.215 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 607.13% |

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 | 5.18% | 0.76% | 3.60% | 1.08% | 1.58% | -0.32% |
| 过去三个月 | 7.66% | 0.85% | 3.33% | 1.14% | 4.33% | -0.29% |
| 过去六个月 | -0.30% | 1.00% | 4.48% | 1.32% | -4.78% | -0.32% |
| 过去一年 | 4.40% | 1.07% | 22.96% | 1.37% | -18.56% | -0.30% |
| 过去三年 | 9.31% | 1.01% | -12.68% | 1.52% | 21.99% | -0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 607.13% | 1.20% | 216.15% | 2.00% | 390.98% | -0.80% |

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2014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2014年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、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)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券等证券投资基金。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 | | |
| 邵健 | 本基金、嘉实优质企业股票基金经理,公司总经理助理 | 2004年4月6日 | - | 16年 | 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,基金管理人严格执行正监会《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,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计3次,均为旗下ETF因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

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

2014年以来,中国宏观经济面临了较大的压力。一季度经济数据除了货币和信贷比较稳定,其余指标如投资、消费、进出口、通胀、企业盈利等数据全面显著走低,并低于政府工作报告的预期目标值,这其中既有调结构的影响,更多反映出我们传统的增长方式面临的需求、效益与杠杆的进一步约束,而与之相关的债务、信用等风险的压力在进一步提升,在此种背景下,A股市场表现出明显的存量资金博弈的特征,小盘成长股总体表现较好,大盘股表现疲弱,但进入三月份之后,由于对宏观的进一步担心,前期表现较好的成长股也出现大幅下跌。二季度,管理层开始进行政策的微调,强调稳增长,从财政和货币端都出台了不少"微刺激"措施,使得宏观经济数据出现企稳迹象,在流动性较好而宏观虽有所自稳但仍不够明朗的情况下,以转型、新经济为代表的成长股出现了较大幅度的反弹,地产、银行等行业逐步启稳。

上半年中,本基金基本保持了仓位的稳定,操作上,保持在低估值消费品行业的投资同时,增加了未来成长空间较大的行业优质企业的投资,包括信息安全、互联网视频、新材料等,减持了增速放缓或成长的确定性有所下降的一些行业与个股的持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为5.215元;本报告期基金份额净值增长率为-0.30%,业绩比较基准收益率为4.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间,我们判断中国的经济有望逐步启稳,流动性继续保持相对宽松,央行的再贷款、定向降准、加大公开市场资金投放等有望持续。在此种背景下,证券市场总体仍有望保持较高的活跃度,与宏观相关的一些行业有望出现比上半年更好的表现。沪港通将是下半年投资中的一个重要事件,我们判断其一方面将有助于A股市场总体的启稳回升,另一方面,在风格方面,也将起到重要的影响。在此种背景下,我们判断价值股与优质的成长股下半年都将有所表现,但成长的确定性较差、估值较高或长期投资逻辑存在瑕疵的成长股将面临较大的风险。

鉴于此,我们一方面将继续保持在未来的tenbegger类行业与个股的较大投资,另一方面,将适度配置受益于沪港通的一些价值类与主题类的投资,力求继续为投资人带来良好的回报。

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、运营、风险管理、监察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)本基金的基金管理人于2014年1月15日发布《嘉实增长开放式证券投资基金2013年年度收益分配公告》,收益分配基准日为2013年12月31日,每10份基金份额发放现金红利0.100元,具体参见本报告"6.4.11 利润分配情况"。

(2)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-14,712,126.97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:嘉实增长开放式证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 232,999,456.76 | 159,827,063.79 |
| 结算备付金 | | 627,669.68 | 4,616,203.01 |
| 存出保证金 | | 697,230.66 | 880,092.19 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,853,407,984.96 | 3,245,081,265.28 |
| 其中:股票投资 | | 2,134,351,901.76 | 2,395,631,005.28 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 719,056,083.20 | 849,450,260.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 38,628,611.51 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 11,543,895.95 | 16,265,479.60 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 506,437.21 | 1,756,322.41 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,099,782,675.22 | 3,467,055,037.79 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013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 | | 8,156,237.98 | - |
| 应付赎回款 | | 6,310,116.15 | 8,395,033.15 |
| 应付管理人报酬 | | 3,702,176.38 | 4,408,504.47 |
| 应付托管费 | | 617,029.39 | 734,750.72 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 580,973.16 | 1,631,340.74 |
| 应交税费 | | 604,722.40 | 604,722.40 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 335,268.69 | 417,062.52 |
| 负债合计 | | 20,306,524.15 | 16,191,414.00 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 590,554,411.96 | 658,440,923.12 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,488,921,739.11 | 2,792,422,700.67 |
| 所有者权益合计 | | 3,079,476,151.07 | 3,450,863,623.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,099,782,675.22 | 3,467,055,037.79 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值5.215元,基金份额总额590,554,411.96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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 15,545,775.33 | 411,343,295.17 |
| 1.利息收入 | | 16,083,658.84 | 17,192,866.61 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 581,084.37 | 679,837.52 |
| 债券利息收入 | | 15,502,574.47 | 16,461,329.02 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 51,700.07 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 | | 150,021,957.09 | -25,892,485.91 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 137,126,370.67 | -42,404,355.07 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -1,264,824.55 | -81,800.40 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 14,160,410.97 | 16,593,669.56 |
| 3.公允价值变动收益 | 6.4.7.16 | -151,021,729.90 | 419,811,597.15 |
| 4.汇兑收益 | | - | - |
| 5.其他收入 | 6.4.7.17 | 461,889.30 | 231,317.32 |
| 减:二、费用 | | 30,257,902.30 | 41,525,427.11 |
| 1. 管理人报酬 | | 23,009,490.76 | 31,165,754.62 |
| 2. 托管费 | | 3,834,915.17 | 5,194,292.57 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 3,127,993.22 | 5,054,694.97 |
| 5. 利息支出 | | 178,133.60 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 178,133.60 | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 107,369.55 | 110,684.95 |
| 三、利润总额 | | -14,712,126.97 | 369,817,868.06 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 | | -14,712,126.97 | 369,817,868.06 |

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014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) | 658,440,923.12 | 2,792,422,700.67 | 3,450,863,623.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -14,712,126.97 | -14,712,126.97 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -67,886,511.16 | -282,265,868.20 | -350,152,379.36 |
| 其中:1.基金申购款 | 35,559,061.70 | 144,065,771.30 | 179,624,833.00 |
| 2.基金赎回款 | -103,445,572.86 | -426,331,639.50 | -529,777,212.36 |
| 四、本期向基金分额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -6,522,966.39 | -6,522,966.39 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 590,554,411.96 | 2,488,921,739.11 | 3,079,476,151.07 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 898,557,662.75 | 3,236,402,445.12 | 4,134,960,107.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 369,817,868.06 | 369,817,868.06 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -118,266,153.12 | -472,429,680.88 | -590,695,834.00 |
| 其中:1.基金申购款 | 56,366,096.60 | 218,706,840.71 | 275,072,937.31 |
| 2.基金赎回款 | -174,632,249.72 | -691,136,521.59 | -865,768,771.31 |
| 四、本期向基金分额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -8,922,846.79 | -8,922,846.79 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 780,291,509.63 | 3,124,867,785.51 | 3,905,159,295.14 |

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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

下述关联方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(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 23,009,490.76 | 31,165,754.62 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 2,542,926.84 | 3,110,583.67 |

注:本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年费率/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,834,915.17 | 5,194,292.57 |

注:本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年费率/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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

| 上年度可比期间 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 | 200,450,932.88 | - | - | - | - | - |

注:本期(2014年1月1日至2014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

本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本产品。

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(2014年06月30日)及上年度末(2013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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 232,999,456.76 | 560,041.08 | 78,669,452.72 | 653,008.98 |

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(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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(2014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(2014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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300369 | 绿盟科技 | 2014年6月26日 | 重大事项停牌 | 61.27 | 未知 | 未知 | 1,206,845 | 68,370,439.47 | 73,943,393.15 | - |
| 002466 | 天齐锂业 | 2014年4月29日 | 重大事项停牌 | 43.16 | 未知 | 未知 | 872,201 | 44,063,089.12 | 37,644,195.16 | - |
| 300166 | 东方国信 | 2014年4月9日 | 重大事项停牌 | 18.71 | 2014年7月9日 | 20.58 | 1,133,878 | 20,940,436.77 | 21,214,857.38 | - |
| 600637 | 百视通 | 2014年5月29日 | 重大事项停牌 | 32.03 | 未知 | 未知 | 11,760 | 301,673.97 | 376,672.80 | - |

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(2014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(2014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 | 2,134,351,901.76 | 68.85 |
| | 其中:股票 | 2,134,351,901.76 | 68.85 |
| 2 | 固定收益投资 | 719,056,083.20 | 23.20 |
| | 其中:债券 | 719,056,083.20 | 23.20 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 233,627,126.44 | 7.54 |
| 7 | 其他各项资产 | 12,747,563.82 | 0.41 |
| | 合计 | 3,099,782,675.22 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 1,132,115,594.19 | 36.76 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 74,261,808.48 | 2.41 |
| F | 批发和零售业 | 49,154,993.70 | 1.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 758,325,800.99 | 24.63 |
| J | 金融业 | 580,687.42 | 0.02 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,868,808.75 | 0.16 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,342,910.82 | 0.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 52,522,573.05 | 1.71 |
| S | 综合 | 61,178,724.36 | 1.99 |
| | 合计 | 2,134,351,901.76 | 69.31 |

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 | 002450 | 康得新 | 9,583,780 | 218,030,995.00 | 7.08 |
| 2 | 002439 | 启明星辰 | 9,714,339 | 207,789,711.21 | 6.75 |
| 3 | 600570 | 恒生电子 | 5,099,193 | 149,916,274.20 | 4.87 |
| 4 | 300104 | 乐视网 | 2,310,698 | 101,439,642.20 | 3.29 |
| 5 | 002241 | 歌尔声学 | 2,804,379 | 74,764,744.14 | 2.43 |
| 6 | 002081 | 金螳螂 | 5,244,478 | 74,261,808.48 | 2.41 |
| 7 | 002085 | 万丰奥威 | 3,478,922 | 73,961,881.72 | 2.40 |
| 8 | 300369 | 绿盟科技 | 1,206,845 | 73,943,393.15 | 2.40 |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 2,488,052 | 73,273,131.40 | 2.38 |
| 10 | 002410 | 广联达 | 2,455,612 | 64,926,381.28 | 2.11 |

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 | 002439 | 启明星辰 | 113,036,102.35 | 3.28 |
| 2 | 600525 | 长园集团 | 82,946,698.64 | 2.40 |
| 3 | 300369 | 绿盟科技 | 68,370,439.47 | 1.98 |
| 4 | 300265 | 通光线缆 | 67,139,816.34 | 1.95 |
| 5 | 002349 | 精华制药 | 62,402,682.16 | 1.81 |
| 6 | 002063 | 远光软件 | 50,758,320.49 | 1.47 |
| 7 | 300020 | 银江股份 | 49,068,797.81 | 1.42 |
| 8 | 002466 | 天齐锂业 | 44,063,089.12 | 1.28 |
| 9 | 000712 | 锦龙股份 | 42,838,532.85 | 1.24 |
| 10 | 600563 | 法拉电子 | 42,529,062.17 | 1.23 |
| 11 | 002219 | 恒康医疗 | 42,329,452.62 | 1.23 |
| 12 | 600557 | 康缘药业 | 38,056,842.19 | 1.10 |
| 13 | 002023 | 海特高新 | 35,558,445.01 | 1.03 |
| 14 | 000963 | 华东医药 | 31,977,386.76 | 0.93 |
| 15 | 600570 | 恒生电子 | 25,906,863.39 | 0.75 |
| 16 | 300166 | 东方国信 | 20,940,436.77 | 0.61 |
| 17 | 600588 | 用友软件 | 15,654,217.03 | 0.45 |
| 18 | 002091 | 江苏国泰 | 15,628,424.13 | 0.45 |
| 19 | 300037 | 新宙邦 | 15,618,077.94 | 0.45 |
| 20 | 600884 | 杉杉股份 | 15,584,465.66 | 0.45 |

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 | 600518 | 康美药业 | 160,504,757.98 | 4.65 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 84,479,808.96 | 2.45 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 77,678,545.07 | 2.25 |
| 4 | 300133 | 华策影视 | 61,769,119.95 | 1.79 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 58,408,880.51 | 1.69 |
| 6 | 300020 | 银江股份 | 53,027,391.20 | 1.54 |
| 7 | 002439 | 启明星辰 | 47,669,797.47 | 1.38 |
| 8 | 002085 | 万丰奥威 | 40,940,634.71 | 1.19 |
| 9 | 300168 | 万达信息 | 39,178,385.48 | 1.14 |
| 10 | 600718 | 东软集团 | 38,422,521.98 | 1.11 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 36,287,422.01 | 1.05 |
| 12 | 000712 | 锦龙股份 | 34,564,248.24 | 1.00 |
| 13 | 002219 