

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、监事会对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确认，由董事长签发。

基金经理人曾中人履行银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2013年6月20日核对了本报告中的财务数据、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金经理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。

本半年度报告摘要请见半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

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

从宏观政策、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场价格灵活配置大类资产；股票投资以“定量投资”为主，依托内部自主研发的新行业选股模型、嘉实Alpha多因素模型以及嘉实组合优化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

姓名 胡勇钦 赵军

信息披露负责人 联系电话 (010)65215588 (010)66105799

电子邮件 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 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A座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 23,961,593.20

本期利润 -41,959,500.49

加权平均基金份额本期利润 -0.0469

本期加权平均基金净值利润率 -5.53%

本期基金份额净值增长率 -3.39%

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 0.7777

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所述基金份额回报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 份额净值增长率为% 份额净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) 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%。

本基金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管理特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方法如下：

Benchmark = 0.1000

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

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

其中1,2,3,4,5

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型证券投资基金的历史走势

图：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金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

图：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的各项投资比例分布图

图：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的各投资品种分布图

图：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的各投资品种分布图</