

嘉实主题精选混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

6.4.4.6 本基金在报告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

未在本报告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 因认购新发及增发证券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及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7月13日	重大事项停牌	20.73	2013年7月18日	20.50	10,355,556	197,393,701.62	214,670,675.88	-

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。

7.1 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	2,818,740,081.68	37.82
	其中:股票	2,818,740,081.68	37.82
2	固定收益投资	498,683,000.00	6.69
	其中:债券	498,683,000.00	6.69
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,766,379,023.19	37.11
	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	1,123,689,322.88	15.08
6	其他各项资产	246,330,555.57	3.30
	合计	7,453,821,983.32	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	214,670,675.88	2.89
B	采矿业	19,278,421.63	0.26
C	制造业	1,968,845,683.31	26.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	185,199,899.26	2.50
F	批发和零售业	20,800,703.75	0.28
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	168,652,616.90	2.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	158,200,000.00	2.13
L	租赁和商务服务业	60,035,438.35	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,056,640.60	0.31
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,818,740,081.68	37.99

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	600518	康美药业	30,883,473	593,889,185.79	8.00
2	600887	伊利股份	17,726,597	554,487,954.16	7.47
3	000998	隆平高科	10,355,556	214,670,675.88	2.89
4	000538	云南白药	1,500,000	126,015,000.00	1.70
5	002236	大华股份	3,000,000	114,690,000.00	1.55
6	300212	易华录	3,799,961	113,998,830.00	1.54
7	600048	保利地产	10,000,000	99,100,000.00	1.34
8	600372	中航电子	3,999,915	83,798,219.25	1.13
9	300055	万邦达	2,100,000	82,110,000.00	1.11
10	300115	长盈精密	1,961,066	63,028,661.24	0.85

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登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	600030	中信证券	619,127,554.74	6.64
2	600518	康美药业	566,639,047.52	6.07
3	600858	海螺水泥	446,325,518.51	4.78
4	600048	保利地产	401,362,516.40	4.30
5	600031	三一重工	387,421,399.08	4.15
6	000157	中联重科	327,919,897.67	3.51
7	600111	包钢稀土	321,748,998.42	3.45
8	600837	海通证券	285,073,164.40	3.06
9	000024	招商地产	265,298,307.13	2.84
10	601699	潞安环能	258,023,001.84	2.77
11	000002	万科A	225,367,558.02	2.42
12	000401	冀东水泥	217,357,035.60	2.33
13	600259	广晟有色	217,205,469.34	2.33
14	000060	中金岭南	195,847,473.72	2.10
15	600549	厦门钨业	187,779,619.81	2.01
16	600348	阳泉煤业	177,892,632.35	1.91
17	000629	攀钢钒钛	157,929,541.71	1.69
18	000937	冀中能源	150,762,201.48	1.62
19	002236	大华股份	134,460,333.76	1.44
20	300212	易华录	132,605,162.43	1.42

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	600030	中信证券	619,935,658.74	6.64
2	601006	大秦铁路	511,519,196.58	5.48
3	002024	苏宁云商	417,093,777.92	4.47
4	000002	万科A	400,441,825.75	4.29
5	000157	中联重科	383,455,969.49	4.11
6	600111	包钢稀土	359,181,126.88	3.85
7	600858	海螺水泥	352,993,860.05	3.78
8	600031	三一重工	344,368,923.54	3.69
9	601318	中国平安	280,771,134.12	3.01
10	600125	铁龙物流	280,450,537.74	3.01
11	600837	海通证券	277,063,092.78	2.97
12	600048	保利地产	254,925,075.55	2.73
13	000024	招商地产	249,932,777.30	2.68
14	000401	冀东水泥	246,590,504.88	2.64
15	601699	潞安环能	219,515,521.94	2.35
16	000629	攀钢钒钛	212,674,026.90	2.28
17	600887	伊利股份	212,426,238.74	2.28
18	000630	铜业有色	212,272,091.01	2.27
19	600259	广晟有色	209,339,053.61	2.24
20	600720	祁连山	206,198,169.93	2.21
21	600549	厦门钨业	200,546,568.31	2.15
22	600362	江西铜业	199,544,872.53	2.14
23	000970	中钢三环	198,974,289.92	2.13
24	600519	贵州茅台	192,995,954.87	2.07
25	002155	辰光药业	191,378,037.12	2.05

7.4.3 买入股票的成本及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	卖出股票收入(成交)总额
10,897,341,455.23	13,715,082,583.74

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	59,606,000.00	0.80
2	央行票据	219,508,000.00	2.96
3	金融债	219,569,000.00	2.96
	其中:政策性金融债	219,569,000.00	2.96
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换	-	-
8	其他	-	-
	合计	498,683,000.00	6.72

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	120228	12国开28	1,500,000	149,925,000.00	2.02
2	1001074	10央行票据74	1,200,000	119,688,000.00	1.61
3	1001065	10央行票据65	1,000,000	99,820,000.00	1.35
4	120019	12财国债19	500,000	49,820,000.00	0.67
5	120245	12国开45	400,000	39,788,000.00	0.54

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

报告期内,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

报告期内,本基金未持有权证。

7.9 报告期内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	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,818,740,081.68	37.82
2	固定收益投资	498,683,000.00	6.69
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,766,379,023.19	37.11
5	银行存款和结算备付金合计	1,123,689,322.88	15.08
6	其他各项资产	246,330,555.57	3.30
	合计	7,453,821,983.32	100.00

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	2,818,740,081.68	37.82
	其中:股票	2,818,740,081.68	37.82
2	固定收益投资	498,683,000.00	6.69
	其中:债券	498,683,000.00	6.69
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,766,379,023.19	37.11
	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	1,123,689,322.88	15.08
6	其他各项资产	246,330,555.57	3.30
	合计	7,453,821,983.32	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	214,670,675.88	2.89
B	采矿业	19,278,421.63	0.26
C	制造业	1,968,845,683.31	26.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	185,199,899.26	2.50
F	批发和零售业	20,800,703.75	0.28
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	168,652,616.90	2.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	158,200,000.00	2.13
L	租赁和商务服务业	60,035,438.35	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,056,640.60	0.31
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,818,740,081.68	37.99

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	600518	康美药业	30,883,473	593,889,185.79	8.00
2	600887	伊利股份	17,726,597	554,487,954.16	7.47
3	000998	隆平高科	10,355,556	214,670,675.88	2.89
4	000538	云南白药	1,500,000	126,015,000.00	1.70
5	002236	大华股份	3,000,000	114,690,000.00	1.55
6	300212	易华录	3,799,961	113,998,830.00	1.54
7	600048	保利地产	10,000,000	99,100,000.00	1.34
8	600372	中航电子	3,999,915	83,798,219.25	1.13
9	300055	万邦达	2,100,000	82,110,000.00	1.11
10	300115	长盈精密	1,961,066	63,028,661.24	0.85

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登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	600030	中信证券	619,127,554.74	6.64
2	600518	康美药业	566,639,047.52	6.07
3	600858	海螺水泥	446,325,518.51	4.78
4	600048	保利地产	401,362,516.40	4.30
5	600031	三一重工	387,421,399.08	4.15
6	000157	中联重科	327,919,897.67	3.51
7	600111	包钢稀土	321,748,998.42	3.45
8	600837	海通证券	285,073,164.40	3.06
9	000024	招商地产	265,298,307.13	2.84
10	601699	潞安环能	258,023,001.84	2.77
11	000002	万科A	225,367,558.02	2.42
12	000401	冀东水泥	2	