

信息披露 Disclosure

久嘉证券投资基金

2015 半年度报告摘要

注：上述净值按市场利率计算，扣除券商商承担保的费用(包括但不限于买卖经手费、证券结算风险基金和上市费交易(买卖)证券等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：基金管理费按前一日的基础资产净值值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基础资产净值
基金管理人于每月末计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月两个工作日内从基金资产中一次支付给基金管理人。

6.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：基金管理费按前一日的基础资产净值值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基础资产净值
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两个工作日内从基金资产中一次支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：基金托管费按前一日的基础资产净值值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基础资产净值
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两个工作日内从基金资产中一次支付给基金管理人。

6.4.8.2.3 基金托管费

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.4 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.5 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.6 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.7 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.8 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.9 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.10 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.11 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.12 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.13 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.14 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.15 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.16 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.17 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

注：本期末，久嘉基金管理人运用固有资金投资本基金的比例为44.988,500.00%，其中：本基金本期及上年度期间内不存在在承销期间内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.2.18 关联方管理

项目	本期	上年度可比期间
当期发生的基金支付管理费	3,262,691.58	2,146,722.94
其中：支付给关联方的管理费	19,595,808.06	19,595,808.06

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	86,216,498.83	4.34
2	000018	华联控股	84,309,477.17	4.15
3	300079	汇金股份	75,262,949.04	3.65
4	000001	平安银行	56,989,633.97	2.80
5	601089	中信证券	50,307,000.00	2.41
6	000001	平安银行	50,277,668.18	2.39
7	600048	保利地产	44,440,733.00	2.16
8	000002	万科A	43,900,622.29	2.09
9	000001	平安银行	42,701,230.01	2.03
10	600008	首创股份	42,477,023.00	2.11
11	000060	加加食品	36,856,346.18	1.81
12	000048	保利地产	35,311,000.00	1.77
13	000007	华联控股	35,116,000.00	1.73
14	300025	华联控股	34,603,062.18	1.70
15	601018	华联控股	32,542,000.00	1.60
16	002049	华联控股	31,081,167.74	1.53
17	600003	华联控股	30,038,266.96	1.48
18	002136	华联控股	29,777,243.16	1.46
19	601166	华联控股	29,288,769.06	1.44
20	002022	华联控股	27,011,000.00	1.33

注：买入股票成本(成交金额)减去佣金和印花税(成交金额)后，不考虑相关交易费用。

7.11 期末按债券品种和品种公允价值排序的前五名债券投资明细

序号	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	1,000,000	152,717,000.00	3.85
2	14国债01	1,000,000	152,717,000.00	3.85
3	14国债02	1,000,000	152,717,000.00	3.85
4	14国债03	1,000,000	152,717,000.00	3.85
5	14国债04	1,000,000	152,717,000.00	3.85

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000001	平安银行	1,000,000	152,717,000.00	3.85
2	000018	华联控股	1,000,000	152,717,000.00	3.85
3	300079	汇金股份	1,000,000	152,717,000.00	3.85
4	000001	平安银行	1,000,000	152,717,000.00	3.85
5	601089	中信证券	1,000,000	152,717,000.00	3.85

7.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

7.11.9	本期国债期货投资政策
7.11.10	国债期货投资策略及风险控制措施
7.11.11	本期国债期货投资评价
7.11.12	投资报告期内未投资国债期货
7.12	投资组合公允价值附注
7.12.1	投资报告期内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,或在报告编制日前一年内受

7.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

1	应收利息	263,036.23	
2	应收应收清算款		
3	应收股利		
4	应收利息	9,989,100.04	
5	应收申购款		
6	其他应收款		
7	坏账费用		
8	其他		
9	合计	10,352,161.93	

7.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

2	000018	华联控股	500,000	62,350	2012	重大事项
---	--------	------	---------	--------	------	------

7.12.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金业绩持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者	个人投资者	机构投资者	个人投资者
		持有份额	占已发行总额	持有份额	占已发行总额

7.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	泰康人寿保险股份有限公司-万保-个险万能	86,804,967.00	4.29%	
2	中信证券-华夏银行-中信证券晋京定向资产管理计划	71,003,792.00	3.60%	
3	中信证券-华夏银行-中信证券晋京定向资产管理计划	68,689,572.00	3.40%	
4	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	46,767,070.00	2.29%	
5	长城基金管理有限公司	44,089,560.00	2.25%	
6	阳光人寿保险股份有限公司-万能保险	36,317,442.00	1.80%	

7.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金管理人持有本基金开放式基金	0
本基金基金经理持有本基金开放式基金	0

§9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门)的重大人事变动

1.基金管理人重大人事变动

无变动。基金管理人无重大人事变动。

2.基金托管人(受托)基金托管部门)的重大人事变动

无变动。基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

7.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况						
9.7.1 基金租用证券公司交易单元用于股票投资及佣金支付情况						
金额单位:人民币元						
券商名称	交易单元数量	股票交易		债券及债券回购的佣金		备注
		成交金额	占该券商 总成交金额的比例	佣金	占该券商佣金 总量的比例	
招商证券	2	800,008,463.43	22.34%	736,149.00	22.34%	-
长城证券	7	756,561,918.63	21.20%	683,128.00	20.30%	-

7.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

东方证券	1	116,862,966.23	2.91%	116,862,966.23	2.91%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
瀚川股份	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

7.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

中原证券	1	--	--	--	--
红塔证券	1	--	--	--	--
世纪证券	1	--	--	--	--
信达证券	1	--	--	--	--
中信建投	1	--	--	--	--
银河证券	2	--	--	--	--
华泰证券	1	--	--	--	--

注:1、报告期内租用证券公司席位的变化情况:
本报告期内租用的证券公司交易单元无变化,截止本报告期末共计36个交易单元。