嘉实策略增长混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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	嘉实策略增长混合型证券投资基金
基金简称	嘉实策略混合
基金主代码	070011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月12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	6,002,116,117.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过有效的策略组合，为基金持有人创造较高的中长期资产增值
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面进行综合分析，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，优先考虑股票类资产配置，剩余资产配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资采用自上而下和自下而上相结合的方法，主策略为积极成长策略，辅之以廉价证券策略和周期反转策略等；债券投资采取"自上而下"策略，以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等。
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
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	369,778,625.72
本期利润	360,695,043.12
加权平均基金份额本期利润	0.0561
本期加权平均净值利润率	4.88%
本期基金份额净值增长率	4.38%
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	655,629,825.50
期末可供分配基金份额利润	0.1092
期末基金资产净值	6,657,745,942.80
期末基金份额净值	1.109
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	57.21%

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本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	-5.86%	1.31%	-11.78%	1.40%	5.92%	-0.09%
过去三个月	-4.56%	1.14%	-8.69%	1.09%	4.13%	0.05%
过去六个月	4.38%	1.23%	-9.14%	1.12%	13.52%	0.11%
过去一年	5.45%	1.13%	-6.92%	1.02%	12.37%	0.11%
过去三年	17.88%	1.20%	-7.49%	1.03%	25.37%	0.17%
自基金合同生效起至今	57.21%	1.55%	31.00%	1.50%	26.21%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%。

采用该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作为混合型基金，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收益特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

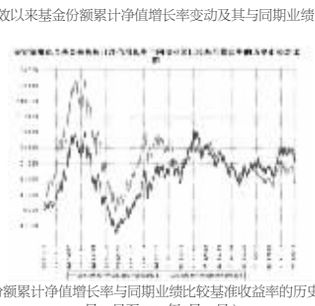
Benchmark(0)=1000

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

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

其中t=1,2,3,…。

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：嘉实策略混合基金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@（2006年12月12日至2013年6月30日）

注1：按相关法规规定，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的各项投资比例符合基金合同第十一部分（二、投资范围和六、二）投资组合限制）的有关约定。

注2：2013年6月7日，本基金管理人发布《关于嘉实策略混合基金经理变更的公告》，邵健先生不再担任本基金基金经理，本基金由现任基金经理张弢独立管理。

§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2013年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、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）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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张弢	本基金、嘉实研究精选股票、嘉实泰和封闭基金经理	2012年1月4日	-	10年	曾任兴安证券行业分析师。2005年9月加盟嘉实基金，曾任行业分析师、社保组合基金经理、嘉实增长混合基金经理。经济学硕士，CFA，具有基金从业资格，中国国籍。
邵健	本基金基金经理、嘉实增长混合、嘉实优质企业股票基金经理，公司总经理助理	2006年12月12日	2013年6月7日	15年	曾任国泰君安证券研究所研究员、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月加入嘉实基金管理有限公司投资部工作。经济学硕士，具有基金从业资格、中国国籍。

注：①基金经理邵健的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理张弢的任职日期是指公司作出决定后公告之日，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、《嘉实策略增长混合型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证监会《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

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

在上半年的大部分时期较好流动性的背景下，经济复苏的迹象并不清晰，工业投资、消费数据乏善可陈，进出口数据稍有亮点。两会的政府基调整体还是比较市场化的，让投资人看到了长期经济稳定和健康发展的可能，但是短期经济的调整不可避免。国际方面，两大因素左右全球市场的态势：美国复苏节奏、日本量化放松，美国的复苏将影响国际资金的流动，而日本超预期的量化放松使得日元大幅贬值，这些都将系统性的、深刻的影响中国经济的大环境和未来发展的态势。进入2季度后，流动性明显弱于1季度，并且造成了短期银行间资金高度紧张的状态。政策基调日益清晰，市场化的调结构成为政府的取向，短期经济的下滑迹象难以扭转。

上半年的股市大致分成两个阶段：第一阶段：1到5月，较好的流动性给投资人一定的心理信心，因此，初期市场小幅上涨，延续了去年底的价值股修复行情，行情体现了投资人的憧憬预期，随着之后疲弱的经济数据，市场逐步下跌，整体5个月大盘持平。第二阶段：6月银行间资金的紧张快速恶化了投资人的预期，市场出现快速大幅下跌。

除了上述大市的表现外，市场最大的特点就是分化，上证综指跌幅10%左右，而创业板指数上涨50%左右。两极分化的原因主要有：第一、传统投资领域机会乏善可陈，市场资金纷纷撤出这些领域；第二、以TMT为代表的新经济业绩表现突出；第三、在上述两个原因的背景下，机构投资者的资金腾挪加大了这一分化的表现。

基于对经济数据和流动性的担心，本基金维持中等偏上的仓位水平，结构上以大消费为主体配置，并积极寻找优质个股和符合改革的主题。但由于对市场的分化把握不够充分，只少量的参与了互联网、新能源板块，因此，没有享受到成长股的大幅上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为1.109元；本报告期基金份额净值增长率为4.38%，业绩比较基准收益率为-9.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，流动性紧张的局面可能会有反复，经济复苏的迹象可能还难以明显感知，政策的着力点判断依然在转型方面，传统投资链条的机会不大。市场两极分化的现象可能继续存在，但资金紧张的环境是对这一分化现象判断的风险。

基于对经济复苏力度的判断，我们预计大盘整体机会不大，本基金将以股票中等偏低仓位作为资产配置的选择方向。板块上，以消费、医药作为主力配置品种。同时，将重点关注代表经济发展方向的新经济板块，在适当的时候择机介入。

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、法律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2013年1月21日发布《嘉实策略增长混合型证券投资基金2012年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2012年12月31日，每10份基金份额发放现金红利0.260元，具体参见本报告6.4.11 利润分配情况"。

②根据本基金基金合同《第十五部分三、收益分配原则》1、在符合有关基金分红条件的情况下，本基金每年收益分配次数最多为4次，全年分配比例不得低于年度可分配收益的30%。"，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，本基金托管人在对嘉实策略增长混合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份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地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，嘉实策略增长混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实策略增长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实策略增长混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为174,030,270.66元。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实策略增长混合型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：嘉实策略增长混合型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	467,366,249.20	416,724,207.63
结算备付金		24,090,249.34	40,559,580.88
存出保证金		2,137,412.73	2,750,015.98
交易性金融资产	6.4.7.2	5,790,051,592.72	6,943,711,777.87
其中：股票投资		5,403,061,666.12	6,563,511,150.67
基金投资		-	-
债券投资		386,989,926.60	380,200,627.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	388,000,314.00	40,000,000.00
应收证券清算款		97,275,128.73	1,791,002.93
应收利息	6.4.7.5	7,580,666.07	8,453,805.93
应收股利		1,222,175.00	-
应收申购款		216,171.93	512,777.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,777,939,959.72	7,454,503,168.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		100,561,275.21	103,441,292.18
应付赎回款		4,823,766.89	4,323,962.44
应付管理人报酬		8,570,378.11	8,842,989.00
应付托管费		1,428,396.38	1,473,831.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,868,697.14	3,468,097.33
应交税费		219,942.90	219,942.90
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,721,560.29	2,095,151.19
负债合计		120,194,016.92	123,865,266.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,002,116,117.30	6,746,285,649.22
未分配利润	6.4.7.10	655,629,825.50	584,352,252.47
所有者权益合计		6,657,745,942.80	7,330,637,901.69
负债和所有者权益总计		6,777,939,959.72	7,454,503,168.23

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.109元，基金份额总额6,002,116,117.30份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实策略增长混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		437,064,579.82	751,073,010.61
1.利息收入		11,122,306.24	7,654,024.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,834,924.00	1,000,568.59
债券利息收入		6,011,452.29	6,341,403.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,275,929.95	312,052.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益		434,928,477.49	-78,173,413.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	385,870,452.91	-119,853,591.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	52,860.00	1,905,911.95
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	49,005,164.58	39,774,265.09
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-9,083,582.60	821,314,932.38
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	97,378.69	277,467.73
减：二、费用		76,369,536.70	77,967,558.60
1.管理人报酬		55,027,928.39	54,770,219.83
2.托管费		9,171,321.45	9,128,370.00
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	11,923,218.73	13,665,767.99
5.利息支出		-	152,988.34
其中：卖出回购金融资产支出		-	152,988.34
6.其他费用	6.4.7.19	247,068.13	250,212.44
三、利润总额		360,695,043.12	673,105,452.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润		360,695,043.12	673,105,452.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实策略增长混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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)	6,746,285,649.22	584,352,252.47	7,330,637,901.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	360,695,043.12	360,695,043.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-744,169,531.92	-115,387,199.43	-859,556,731.35
其中：1.基金申购款	162,030,236.29	21,804,328.33	183,834,564.62
2.基金赎回款	-906,199,768.21	-137,191,527.76	-1,043,391,295.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-174,030,270.66	-174,030,270.66
五、期末所有者权益(基金净值)	6,002,116,117.30	655,629,825.50	6,657,745,942.80
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	7,364,410,001.51	-134,286,449.87	7,230,123,551.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	673,105,452.01	673,105,452.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-367,573,822.13	-4,350,514.67	-371,924,336.80
其中：1.基金申购款	76,735,033.53	1,786,866.50	78,521,900.03
2.基金赎回款	-444,308,855.66	-6,137,381.17	-450,446,236.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,996,836,179.38	534,468,487.47	7,531,304,666.85

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行)	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（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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,027,928.39	54,770,219.83
其中：支付销售机构的客户维护费	8,639,076.91	8,376,246.50

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%／当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,171,321.45	9,128,370.00

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按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。

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

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（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），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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（2013年6月30日）及上年度末（2012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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国工商银行	467,366,249.20	1,676,978.82	49,797,916.44	914,762.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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（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），本基金未在承销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/增发证券而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/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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项停牌	29.60	2013年8月19日	26.51	1,710,536	39,844,882.94	50,631,865.60	-
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项停牌	28.55	2013年7月24日	31.41	500,000	8,885,317.18	14,275,000.00	-
300133	华策影视	2013年5月28日	重大事项停牌	24.43	2013年7月30日	26.87	515,240	9,278,582.64	12,587,313.20	-

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 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	5,403,061,666.12	79.72
	其中：股票	5,403,061,666.12	79.72
2	固定收益投资	386,989,926.60	5.71
	其中：债券	386,989,926.60	5.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	388,000,314.00	5.72
	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	491,456,498.54	7.25
6	其他各项资产	108,431,554.46	1.60
	合计	6,777,939,959.72	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	30,961,746.10	0.47
C	制造业	3,651,219,047.25	54.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,944,674.99	1.10
E	建筑业	3,570,000.00	0.05
F	批发和零售业	328,990,530.26	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	230,235,739.24	3.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	268,193,155.27	4.03
J	金融业	305,495,000.00	4.59
K	房地产业	101,559,820.44	1.53
L	租赁和商务服务业	2,663,182.41	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,130,186.40	0.23
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	26,862,313.20	0.40
S	综合	365,236,270.56	5.49
	合计	5,403,061,666.12	81.15

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	600315	上海家化	12,026,720	541,082,132.80	8.13
2	600887	伊利股份	13,723,414	429,268,389.92	6.45
3	600256	广汇能源	28,181,811	365,236,270.56	5.49
4	000651	格力电器	14,142,536	354,411,952.16	5.32
5	000895	双汇发展	7,932,304	304,917,765.76	4.58
6	000527	美的电器	22,230,998	276,108,995.16	4.15
7	600518	康美药业	13,024,763	250,466,192.49	3.76
8	000513	丽珠集团	6,464,019	241,107,908.70	3.62
9	000063	中兴通讯	18,655,589	237,858,759.75	3.57
10	300037	新宙邦	5,929,146	120,361,663.80	1.81

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	000063	中兴通讯	240,966,713.01	3.29
2	601166	兴业银行	195,500,171.05	2.67
3	300017	网宿科技	181,811,432.21	2.48
4	300037	新宙邦	148,828,958.20	2.03
5	000028	国药一致	130,240,617.13	1.78
6	601111	中国国航	120,530,994.87	1.64
7	600036	招商银行	119,210,970.81	1.63
8	000527	美的电器	117,054,549.28	1.60
9	600115	东方航空	87,776,263.58	1.20
10	600518	康美药业	84,506,360.11	1.15
11	600029	南方航空	77,479,443.38	1.06
12	600016	民生银行	68,386,974.15	0.93
13	600887	伊利股份	66,652,206.24	0.91
14	600517	置信电气	66,145,263.22	0.90
15	600256	广汇能源	51,483,013.18	0.70
16	600011	华能国际	51,147,810.64	0.70
17	000513	丽珠集团	48,247,464.38	0.66
18	600027	华电国际	47,854,819.84	0.65
19	000999	华润三九	47,225,232.64	0.64
20	601299	中国北车	44,644,702.65	0.61

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	601166	兴业银行	344,937,583.81	4.71
2	600315	上海家化	311,410,820.74	4.25
3	600036	招商银行	273,927,729.36	3.74
4	000002	万 科A	271,883,608.46	3.71
5	002304	洋河股份	164,827,283.44	2.25
6	000069	华侨城A	133,055,410.32	1.82
7	600016	民生银行	129,142,478.39	1.76
8	600570	恒生电子	120,163,161.20	1.64
9	601299	中国北车	115,969,866.01	1.58
10	000651	格力电器	115,544,209.95	1.58
11	600887	伊利股份	111,451,013.43	1.52
12	600519	贵州茅台	110,389,437.79	1.51
13	601318	中国平安	102,651,488.83	1.40
14	002410	广联达	92,612,953.90	1.26
15	601169	北京银行	90,357,009.97	1.23
16	601766	中国南车	81,878,780.82	1.12
17	300017	网宿科技	74,935,831.47	1.02
18	000157	中联重科	73,257,653.97	1.00
19	600048	保利地产	69,498,572.04	0.95
20	000999	华润三九	69,102,315.87	0.94

7.4.3 买