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:2013年8月26日

嘉实成长收益证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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	嘉实成长收益证券投资基金
基金简称	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月5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	5,158,050,828.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金,在获取稳定的现金收益的基础上,积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现"稳定收益"的目标;同时通过实施"行业优选、积极轮换"的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金,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贝塔值不超过0.75。在此前提下,本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例,努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的65%,股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。

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	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	505,219,775.25
本期利润	718,467,606.38
加权平均基金份额本期利润	0.1012
本期加权平均净值利润率	14.94%
本期基金份额净值增长率	15.01%
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	636,157,174.03
期末可供分配基金份额利润	0.1233
期末基金资产净值	3,690,761,137.23
期末基金份额净值	0.7155
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	405.06%

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	-3.02%	1.21%	-13.99%	1.54%	10.97%	-0.33%
过去三个月	4.62%	1.14%	-11.52%	1.20%	16.14%	-0.06%
过去六个月	15.01%	1.06%	-12.83%	1.24%	27.84%	-0.18%
过去一年	15.53%	0.96%	-11.12%	1.15%	26.65%	-0.19%
过去三年	21.31%	0.94%	-17.62%	1.19%	38.93%	-0.25%
自基金合同生效起至今	405.06%	1.17%	29.43%	1.66%	375.63%	-0.49%

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

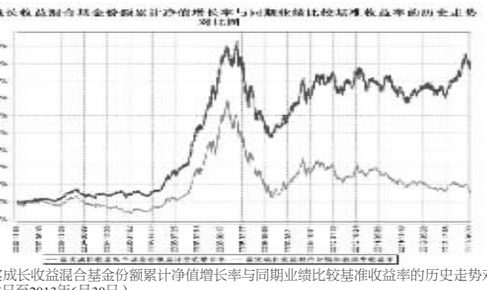

图:嘉实成长收益混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图@(2002年11月5日至2013年6月30日)

注1: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的各项投资比例符合基金合同第十八条(二)投资范围和(六)投资组合比例限制的约定: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本基金与由本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。

注2:2013年6月7日,本基金管理人发布《关于嘉实成长收益混合基金经理变更的公告》,刘天君先生不再担任本基金基金经理;聘请邵秋涛先生担任本基金基金经理职务。

注3:2013年6月19日,本基金管理人发布《关于嘉实成长收益混合基金经理变更的公告》,任竞辉先生不再担任本基金基金经理。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵秋涛	本基金基金经理,嘉实领先成长股票基金经理	2013年6月7日	-	15年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券,从事行业研究工作,先后担任研究员、高级研究员;2006年12月加盟嘉实基金管理有限公司,历任公司高级研究员、投资经理,金融硕士,具有基金从业资格,澳大利亚籍。
刘天君	本基金基金经理,嘉实优质企业股票基金经理,公司股票投资部总监	2010年11月5日	2013年6月7日	11年	曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副总监、嘉实泰和封闭、嘉实成长收益混合基金经理。北京大学光华管理学院经济学硕士,具有基金从业资格、中国国籍。
任竞辉	本基金基金经理,嘉实泰和封闭基金经理	2012年12月17日	2013年6月19日	7年	曾任申万巴黎基金管理有限公司行业研究员、中国国际金融有限公司行业研究员。2008年2月加盟嘉实基金管理有限公司任高级分析师。MBA,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①任职日期、离任日期是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、《嘉实成长收益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

A股在2013年上半年几乎是在重复2012年上半年的走势,呈现出先扬后抑的震荡行情。

13年上半年的前半段,A股市场承接12年12月份的大幅反弹惯性,在对宏观经济可能见底复苏、管理层可能刺激经济救市的预期下,上证指数一度冲高2400点。然而春节过后,当市场意识到经济复苏的力度很弱以及政府改革的决心很大时,A股进入了震荡下跌通道。

到6月份一切美好预期都被残酷的现实所彻底粉碎。A股加入MSCI只是一个研究,涉及的政策问题太多,远水难解近渴;冰冷的宏观经济数据和中观行业数据,都说明宏观经济依然疲软;管理层对于改革方向的坚定表态,也打破了救市预期;市场熟悉的大小盘风格轮换,迟迟没有发生。在市场流动性急剧萎缩的冲击下,6月大盘周期股的跌幅反而大于创业板。

6月份沪深300指数大跌15%以上,沪深300指数在2013年上半年以12.8%的跌幅收场。

由于较早的意识到中国宏观经济风险的严重性与持续性,本基金继续坚持以稳定成长类别的消费、医药、信息技术、文化传媒等板块作为核心配置,回避产能过剩、利润持续下滑的强周期行业,并且对组合的集中度、流动性进行了适当的风险调整,较好的回避了大盘下跌风险。

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0.7155元;本报告期基金份额净值增长率为15.01%,业绩比较基准收益率为-12.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年下半年的A股市场,可能会和过去一样,继续在对美好未来的预期和对冷酷现实的失望之间辗转反侧。市场会继续纠结于政府是否应该救市、大小盘风格是否轮换等永恒的话题。

我们认为,这些争论的重要性可能在下降,这更多反映了上个时代的经济模式下的投资模式。过去30年的增长模式有其合理之处,成果也很显著;但是内在风险也很大。在中国经济以这种简单粗暴、野蛮生长模式连续增长30年、跻身于世界第二大经济体之后,争论的焦点已经不是经济增长的快和慢,而是一和零的问题。当GDP数字游戏已经和多数人的幸福无关的时候、当肮脏的空气和水威胁到所有富人穷人的时候、当狂热的金融地产市场与冰冷的实体经济出现巨大反差的时候、当中国的国际竞争优势已经开始弱化的时候,我们会发现,这个担心并非杞人忧天。

在屡次看到有学生因为体质问题而在长跑时发生意外的新闻后,是否可以转换一下思路,如果中国经济继续凭借并不强壮的心脏、继续以畸形的姿态去跑马拉松,会有什么样的风险。

所幸的是,新一届政府对此有清醒的认识,迄今为止的政策思路非常清晰、执行态度非常坚定。如能不为短期的阵痛所动,长期坚持并完全落实,那么在中国宏观经济过去积累的风险有序释放之后,迎来新的一轮景气是水到渠成之事。

我们看到了中国经济的风险,也就可能看到了中国经济的机会。病树前头万木春,当传统行业在产能过剩、需求疲软、环保成本的泥潭里苦苦挣扎的时候,我们也看到一大批管理出色、机制灵活、动力强劲的企业,在信息技术、移动互联网、文化娱乐、消费服务、医疗保健、智能制造、智慧城市、军工、环保等需求旺盛的新兴领域大展拳脚,为我们开启了另一扇窗户。

本基金将继续坚持"短见者稳进"的投资理念,继续在控制风险的前提下,从中国经济转型、结构调整、社会变迁、人口变化、科技进步等线索入手,积极主动的寻找中长期的结构性投资机会。

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)报告期内本基金未实施利润分配;

②)根据本基金基金合同(二十三(三)收益分配原则)5,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成",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")在对嘉实成长收益证券投资基金(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:嘉实成长收益证券投资基金

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	41,487,609.97	150,791,078.49
结算备付金		3,193,086.98	1,205,434.74
存出保证金		1,615,646.18	1,146,588.27
交易性金融资产	6.4.7.2	3,471,444,933.11	4,851,339,250.39
其中:股票投资		2,485,377,933.11	3,648,795,103.99
基金投资		-	-
债券投资		986,067,000.00	1,202,544,146.40
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	-	-
应收证券清算款		156,977,814.55	42,680,271.52
应收利息	6.4.7.5	20,140,313.25	18,462,681.81
应收股利		-	-
应收申购款		11,974,617.30	3,271,030.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,706,834,021.34	5,068,896,335.37
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		-	-
应付赎回款		6,083,636.36	1,764,444.02
应付管理人报酬		4,797,357.22	6,208,684.06
应付托管费		799,559.55	1,034,780.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,172,661.05	3,071,416.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	219,669.93	813,180.94
负债合计		16,072,884.11	12,892,506.59
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,054,603,963.20	4,813,077,034.93
未分配利润	6.4.7.10	636,157,174.03	242,926,793.85
所有者权益合计		3,690,761,137.23	5,056,003,828.78
负债和所有者权益总计		3,706,834,021.34	5,068,896,335.37

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.7155元,基金份额总额5,158,050,828.66份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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		778,346,096.64	455,514,412.03
1.利息收入		18,506,106.44	25,157,682.04
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,703,306.95	1,055,498.75
债券利息收入		16,715,446.15	22,386,295.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		87,353.34	1,715,888.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益		544,013,990.19	-87,124,754.08
其中:股票投资收益	6.4.7.12	524,952,494.86	-107,188,922.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-500,533.75	300,508.32
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	19,562,029.08	19,763,660.08
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	213,247,831.13	516,766,201.20
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	2,578,168.88	715,282.87
减:二、费用		59,878,490.26	47,279,305.57
1.管理人报酬		35,595,155.69	33,829,913.44
2.托管费		5,932,525.94	5,638,318.89
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	18,113,983.49	7,155,675.33
5.利息支出		-	425,751.62
其中:卖出回购金融资产支出		-	425,751.62
6.其他费用	6.4.7.19	236,825.14	229,646.29
三、利润总额		718,467,606.38	408,235,106.46
减:所得税费用		-	-
四、净利润		718,467,606.38	408,235,106.46

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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)	4,813,077,034.93	242,926,793.85	5,056,003,828.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	718,467,606.38	718,467,606.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,758,473,071.73	-325,237,226.20	-2,083,710,297.93
其中:1.基金申购款	910,511,420.17	148,816,197.10	1,059,327,617.27
2.基金赎回款	-2,668,984,491.90	-474,053,423.30	-3,143,037,915.20
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)	3,054,603,963.20	636,157,174.03	3,690,761,137.23
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)	4,307,401,873.57	273,674,890.33	4,581,076,763.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	408,235,106.46	408,235,106.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	168,340.15	23,684,705.28	23,853,045.43
其中:1.基金申购款	587,935,141.28	72,920,982.19	660,856,123.47
2.基金赎回款	-587,766,801.13	-49,236,276.91	-637,003,078.04
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)	4,307,570,213.72	705,594,702.07	5,013,164,915.79

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	35,595,155.69	33,829,913.44
其中:支付销售机构的客户维护费	715,233.18	599,577.20

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	5,932,525.94	5,638,318.89

注:支付基金托管人中国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

单位:人民币元

本期 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	312,655,566.16	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	20,003,071.04	-	-	-	600,400,000.00	272,843.28

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
中国银行	41,487,609.97	1,613,305.68	315,532,575.80	941,886.18

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(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

本期末(2013年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	2,485,377,933.11	67.05
	其中:股票	2,485,377,933.11	67.05
2	固定收益投资	986,067,000.00	26.60
	其中:债券	986,067,000.00	26.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	44,680,696.95	1.21
6	其他各项资产	190,708,391.28	5.14
	合计	3,706,834,021.34	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	46,172,300.37	1.25
C	制造业	2,283,452,199.84	61.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,803,537.34	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	52,715,162.88	1.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	62,562,426.60	1.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,462,952.00	0.39
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	9,603,000.00	0.26
S	综合	13,606,354.08	0.37
	合计	2,485,377,933.11	67.34

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	601633	长城汽车	10,488,624	371,507,062.08	10.07
2	000538	云南白药	3,303,133	277,496,203.33	7.52
3	000651	格力电器	11,033,336	276,495,400.16	7.49
4	002236	大华股份	4,000,000	152,920,000.00	4.14
5	600587	新华医疗	3,550,219	147,121,075.36	3.99
6	002241	歌尔声学	4,000,000	145,160,000.00	3.93
7	600519	贵州茅台	600,000	115,422,000.00	3.13
8	600315	上海家化	2,471,373	111,187,071.27	3.01
9	600887	伊利股份	3,507,337	109,709,501.36	2.97
10	600535	天士力	2,000,000	78,300,000.00	2.12

注1:报告期末,本基金持有的长城汽车因市场波动造成被动超标,已于2013年7月2日降至10%以下,符合法律法规的规定及基金合同的约定。

注2: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	600104	上汽集团	442,940,460.67	8.76
2	000581	威孚高科	299,030,042.54	5.91
3	600519	贵州茅台	285,293,819.15	5.64
4	600031	三一重工	187,324,421.34	3.70
5	000538	云南白药	182,875,580.72	3.62
6	000625	长安汽车	172,732,479.18	3.42
7	600535	天士力	157,521,046.61	3.12
8	002294	信立泰	150,853,208.48	2.98
9	600809	山西汾酒	148,105,490.60	2.93
10	002241	歌尔声学	132,312,821.89	2.62
11	002456	欧菲光	130,962,033.64	2.59
12	600587	新华医疗	118,628,829.12	2.35
13	000970	中科三环	114,972,912.82	2.27
14	600315	上海家化	105,487,487.70	2.09
15	600887	伊利股份	104,223,847.31	2.06
16	600048	保利地产	101,049,781.89	2.00
17	002081	金螳螂	99,537,258.09	1.97
18	002415	海康威视	95,127,905.97	1.88
19	000157	中联重科	92,414,060.51	1.83
20	000568	泸州老窖	88,333,416.40	1.75

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	002241	歌尔声学	610,955,124.43	12.08
2	600104	上汽集团	433,836,114.36	8.58
3	600031	三一重工	416,160,278.40	8.23
4	600519	贵州茅台	346,527,258.94	6.85
5	000157	中联重科	302,858,890.71	5.99
6	000581	威孚高科	273,420,797.08	5.41
7	002236	大华股份	263,161,680.37	5.20
8	000568	泸州老窖	252,716,939.88	5.00
9	002415	海康威视	227,471,664.34	4.50
10	000423	东阿阿胶	227,333,060.61	4.50
11	002456	欧菲光	205,524,695.67	4.06
12