嘉实服务增值行业证券投资基金

【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	嘉实服务增值行业证券投资基金
基金简称	嘉实服务增值行业混合
基金主代码	070006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月1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	1,675,937,902.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准，在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。
投资策略	在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上，制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。同时，根据合适的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票，获取稳定的长期回报。
业绩比较基准	投资基准指数=中信综合指数×80%+中信国债指数×20%
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金

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	393,868,364.27
本期利润	381,560,635.55
加权平均基金份额本期利润	0.2153
本期加权平均净值利润率	5.57%
本期基金份额净值增长率	5.84%
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	4,183,752,814.34
期末可供分配基金份额利润	2.4964
期末基金资产净值	6,395,178,684.93
期末基金份额净值	3.816
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	362.02%

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	-7.58%	1.40%	-12.72%	1.48%	5.14%	-0.08%
过去三个月	1.71%	1.20%	-7.87%	1.14%	9.58%	0.06%
过去六个月	5.84%	1.33%	-6.11%	1.15%	11.95%	0.18%
过去一年	3.41%	1.19%	-5.85%	1.08%	9.26%	0.11%
过去三年	12.68%	1.18%	-6.41%	1.11%	19.09%	0.07%
自基金合同生效起至今	362.02%	1.45%	82.03%	1.48%	279.99%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中信综合指数×80%+中信国债指数×20%。

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

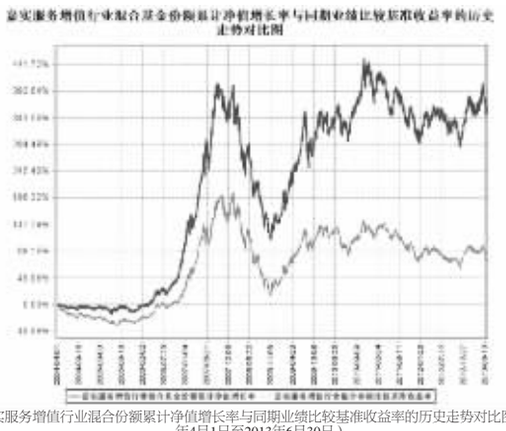
Return(t)=80%×(中信综合指数(t)/中信综合指数(t-1)-1)+20%×(中信国债指数(t)/中信国债指数(t-1)-1)

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

嘉实服务增值行业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



图：嘉实服务增值行业混合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@(2004年4月1日至2013年6月30日)

注：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在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围：股票资产25%-95%；债券资产0%-70%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的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法律法规规定的其他限制。

§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		
陈勤	本基金基金经理，嘉实价值优势股票基金经理	2008年3月20日	-	11年	曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行证券分析师，华夏基金管理有限公司基金经理助理，银华基金管理有限公司投资管理部，2006年10月至2007年11月任银华优势企业基金基金经理。2007年11月加盟嘉实基金管理有限公司。工商管理硕士(MBA)，经济学硕士、特许金融分析师(CFA)，具有基金从业资格，国籍加拿大。

注：①任职日期、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、《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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

报告期内，市场分化严重，沪深300指数、上证综指等市场核心指数持续下跌；而中小板和创业板指数则持续的上涨；从行业来看，代表经济转型方向的信息服务、信息设备、电子、医药服务和公用事业行业不仅取得了巨大的相对收益，也取得了明显的绝对收益；而代表传统经济的采掘、有色金属、黑色金属、交通运输和建筑建材则跌幅巨大。

如我们的判断，市场的结构性特征突出，虽然整体经济复苏的力度低于预期，但结构性转型时期，受益于政府的促转型、调结构政策，部分行业的景气度仍较高，同时上半年的流动性也较为宽松，因此整个市场虽然持续下跌，但结构性机会显著。

回顾上半年的组合情况，本组合取得了良好的超额收益，超额收益主要来自于个股选择和行业配置，同时在大类资产配置上没有失分；从行业配置上看，一直看好的油气开发设备、医药和文化传媒取得了良好的超额收益，增加配置的环保和电子行业也取得了较大的超额收益；同时，5-7月采用的红利策略也贡献了一定的超额收益。

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3.816元；本报告期基金份额净值增长率为5.84%，业绩比较基准收益率为-6.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段的市场，我们认为，经济增长将维持在较低水平，同时政策从上半年的调结构为重心转为结构与稳增长并重，同时上半年充裕的流动性将有所收紧。

具体而言，一是，经济增速仍维持较低水平，企业盈利增速下降；基建投资受制于财政收入增速的放缓以及国家对平台贷款的控制，稳增长的效果降低；房地产投资增速仍相对平稳，但受制于居民可支配收入增速的下降未来空间有限；消费受制于反腐和收入增速的下降，上半年已经低于预期，下半年改善的空间有限；企业的盈利增速将继续下台阶；二是，政策从上半年的促转型转为保增长与促转型并重，随着经济增速的持续放缓，政府在开局年的后半场强调经济和就业不滑出下线的基础上调结构，促转型；三是，流动性从上半年的宽松转为紧平衡状态，外汇占款的拐点已至，美国经济的复苏可能加剧资金的外流；金融去杠杆的政策意图明显，未来非标资产的增速将下降；四是，海外经济仍在温和复苏，QE的退出造成海外的流动性也有所收缩。

因此，我们判断市场将维持振荡，结构性机会仍是我们关注的重点。但由于上半年结构性机会演绎的比较充分了，由于业绩不达预期或流动性收紧导致的估值下行加大了市场下跌的概率，需要等待调整后的结构性机会。

具体到组合管理上，在大类资产配置上，我们计划降低股票仓位至平均水平或以下，等待市场下调带来的结构性加仓机会；在行业配置上，我们看好业绩增长确定性高且估值合理的建筑装饰和大众消费品行业；看好受益于政策支持力度较大的通讯设备及下游应用行业，节能环保行业和天然气开发（尤其是油气设备）；看好受益于经济结构转型，业绩增长较快的优质医药、传媒和消费电子品种；看好竞争格局良好且估值合理的家电和汽车行业中的龙头品种；相对看好地产和银行的阶段性的博弈价值；主题投资机会我们重点把握IPO开闸后的新股的投资机会，尤其是中长期增长趋势明确的品种；在个股选择上，仍强调精选个股策略，对于前期看好的品种，相信在未来几个月会有更好的买点，一旦随市场大幅调整，择机加仓。

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《嘉实服务增值行业证券投资基金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1.000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（二十三（二）基金收益分配原则）7.在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成。"的约定，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"）在对嘉实服务增值行业证券投资基金（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：嘉实服务增值行业证券投资基金

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	379,028,975.87	92,347,538.83
结算备付金		22,401,903.97	47,185,021.58
存出保证金		2,753,134.31	2,711,024.32
交易性金融资产	6.4.7.2	5,876,165,903.25	5,918,981,274.78
其中：股票投资		5,517,254,903.25	5,559,290,274.78
基金投资		-	-
债券投资		358,911,000.00	359,691,000.00
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	-	370,000,000.00
应收证券清算款		131,565,268.10	121,655,341.00
应收利息	6.4.7.5	8,227,942.89	5,451,789.80
应收股利		19,723,631.06	-
应收申购款		799,447.54	981,058.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,440,666,206.99	6,559,313,049.00
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		20,985,914.81	15,724,813.71
应付赎回款		5,648,636.06	4,313,762.69
应付管理人报酬		8,156,322.67	8,055,528.88
应付托管费		1,359,387.11	1,342,588.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,370,394.04	8,361,647.94
应交税费		741,392.44	741,392.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,225,474.93	1,342,089.35
负债合计		45,487,522.06	39,881,823.14
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,675,937,902.08	1,761,776,917.23
未分配利润	6.4.7.10	4,719,240,782.85	4,757,654,308.63
所有者权益合计		6,395,178,684.93	6,519,431,225.86
负债和所有者权益总计		6,440,666,206.99	6,559,313,049.00

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值3.816元，基金份额总额1,675,937,902.08份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

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		473,726,813.90	550,899,906.04
1.利息收入		7,619,227.49	11,030,342.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,035,136.07	1,448,824.20
债券利息收入		5,386,476.72	5,762,254.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,197,614.70	3,819,263.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益		477,957,110.99	-172,310,090.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	415,327,528.85	-217,289,146.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	70,000.00	169,920.00
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	62,559,582.14	44,809,135.41
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-12,307,728.72	711,951,483.84
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	458,204.14	228,170.30
减：二、费用		92,166,178.35	79,846,187.05
1.管理人报酬		51,043,725.52	49,342,027.45
2.托管费		8,507,287.52	8,223,671.23
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	32,368,895.37	22,035,210.86
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	246,269.94	245,277.51
三、利润总额		381,560,635.55	471,053,718.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润		381,560,635.55	471,053,718.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

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)	1,761,776,917.23	4,757,654,308.63	6,519,431,225.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	381,560,635.55	381,560,635.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-85,839,015.15	-244,814,670.90	-330,653,686.05
其中：1.基金申购款	258,814,898.92	742,512,683.64	1,001,327,582.56
2.基金赎回款	-344,653,914.07	-987,327,354.54	-1,331,981,268.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-175,159,490.43	-175,159,490.43
五、期末所有者权益(基金净值)	1,675,937,902.08	4,719,240,782.85	6,395,178,684.93
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)	1,742,849,495.23	4,385,661,893.60	6,128,511,388.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	471,053,718.99	471,053,718.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	77,166,157.18	215,293,062.16	292,459,219.34
其中：1.基金申购款	169,702,867.51	470,064,785.01	639,767,652.52
2.基金赎回款	-92,536,710.33	-254,771,722.85	-347,308,433.18
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)	1,820,015,652.41	5,072,008,674.75	6,892,024,327.16

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	51,043,725.52	49,342,027.45
其中：支付销售机构的客户维护费	2,888,496.62	2,881,900.45

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	8,507,287.52	8,223,671.23

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

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
中国银行	379,028,975.87	763,160.36	137,013,077.22	1,160,593.44

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600592	龙溪股份	2013年4月23日	2014年4月23日	非公开发行流通受限	6.72	6.79	5,000,000	33,600,000.00	33,950,000.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

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其他证券。

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	2,257,559	53,366,591.61	66,823,746.40	-
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	6,319,951	69,076,669.33	154,396,402.93	-

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	5,517,254,903.25	85.66
	其中：股票	5,517,254,903.25	85.66
2	固定收益投资	358,911,000.00	5.57
	其中：债券	358,911,000.00	5.57
	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	401,430,879.84	6.23
6	其他各项资产	163,069,423.90	2.53
	合计	6,440,666,206.99	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	62,782,778.41	0.98
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,539,963,474.01	55.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,438,864.02	0.57
E	建筑业	356,573,416.32	5.58
F	批发和零售业	160,968,459.84	2.52
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	17,109,171.71	0.27
J	金融业	135,711,388.26	2.12
K	房地产业	679,921,925.14	10.63
L	租赁和商务服务业	60,303,019.50	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	249,105,003.18	3.90
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	218,377,402.86	3.41
S	综合	-	-
	合计	5,517,254,903.25	86.27

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	600887	伊利股份	14,806,525	463,148,102.00	7.24
2	000002	万 科A	39,676,538	390,813,899.30	6.11
3	000651	格力电器	15,437,699	386,868,736.94	6.05
4	600535	天士力	8,324,768	325,914,667.20	5.10
5	000527	美的电器	22,557,711	280,166,770.62	4.38
6	000568	泸州老窖	10,608,458	252,269,131.24	3.94
7	002146	荣盛发展	15,823,292	223,266,650.12	3.49
8	300070	碧水源	5,834,845	219,856,959.60	3.44
9	002081	金 螳 螂	7,359,264	209,518,246.08	3.28
10	600518	康美药业	10,736,686	206,466,471.78	3.23

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	000651	格力电器	532,333,371.47	8.17
2	000002	万 科A	385,205,960.17	5.91
3	002146	荣盛发展	332,935,086.84	5.11
4	601288	农业银行	313,992,461.87	4.82
5	000568	泸州老窖	312,853,809.79	4.80
6	601166	兴业银行	305,595,880.75	4.69
7	600000	浦发银行	297,401,666.13	4.56
8	600887	伊利股份	296,566,517.86	4.55
9	600036	招商银行	295,752,299.35	4.54
10	601318	中国平安	280,842,686.45	4.31
11	600585	海螺水泥	260,263,006.24	3.99
12	002081	金 螳 螂	204,635,697.69	3.14
13	300070	碧水源	200,172,979.26	3.07
14	601800	中国交建	170,907,497.55	2.62
15	000527	美的电器	170,331,800.48	2.61
16	000423	东阿阿胶	164,047,349.87	2.52
17	000024	招商地产	159,300,376.51	2.44
18	600030	中信证券	143,521,506.45	2.20
19	002353	杰瑞股份	136,286,567.97	2.09
20	300291	华录百纳	132,162,756.28	2.03

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	601166	兴业银行	733,808,377.40	11.26
2	002353	杰瑞股份	379,549,280.84	5.82
3	600585	海螺水泥	353,165,219.23	5.42
4	000049	德赛电池	350,616,220.83	5.38
5	600000	浦发银行	313,889,767.17	4.81
6	600016	民生银行	294,774,396.04	4.52
7	600036	招商银行	278,344,443.54	4.27
8	601318	中国平安	250,405,477.98	3.84
9	000538	云南白药	223,583,623.47	3.43
10	002304	洋河股份	216,023,946.70	3.31
11