

嘉实深证基本本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2013】半年度报告摘要

6.4.2 关联方报酬

6.4.2.1 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	86,361.09	79,806.52	
其中：支付销售机构的客户维护费	196,635.97	251,486.98	

注1：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分 2% 为负数，则0% 的0.5%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×前一日基金财产中目标ETF份额对应资产净值 2% 为负数，则0% 的0.5% / 当年天数。

注2：根据本基金基金投资人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.2.2 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费用	17,272.19	15,961.37	

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。支付基金托管人中国银行股份有限公司的前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分 2% 为负数，则0% 的0.1%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－基金财产中目标ETF份额所对应资产净值 2% 为负数，则0% 的0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 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 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 报告期内本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。

6.4.10.4.2 报告期末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 期末余额	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
中国银行	9,757,917.99	50,916.71	12,354,692.86
			38,944.74

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 本基金在承销期间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，本基金未在承销期间参与认购关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联方交易的说明
 报告期末 2013年6月30日，本基金持有450,615,419.00份目标ETF 基金份额 2012年12月31日：521,615,419.00元，占其总资产的比例为85.36% 2012年12月31日：82.55%。

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

股票代码	股票名称	停牌原因	期末应计提的资产减值损失金额	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
000999	华润三九	2013年6月3日	29.60	2013年8月1日	26.51	1,600	47,418.56	47,360.00	-

6.4.5.3. 期末债券正回购到期作为抵押的债券
 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

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	11,929,924.51	3.43
	其中：股票	11,929,924.51	3.43
2	基金投资	315,836,347.18	90.77
3	固定收益投资	9,974,000.00	2.87
其中：债券	9,974,000.00	2.87	
4	资产支持证券	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,757,917.99	2.80
7	其他各项资产	463,532.70	0.13
合计		347,961,722.38	100.00

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	-	356,741.00	0.10
C 制造业	-	7,512,301.15	2.16
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	170,119.00	0.05
E 建筑业	-	235,260.00	0.07
F 批发和零售业	-	507,974.00	0.15
G 交通运输、仓储和邮政业	-	163,452.00	0.05
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	56,760.00	0.02
J 金融业	-	1,289,533.80	0.37
K 房地产业	-	1,461,536.00	0.42
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	176,297.00	0.05
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		11,929,924.51	3.43

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

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	000002	万科A	91,000	896,350.00	0.26
2	000651	格力电器	22,570	565,604.20	0.16
3	000001	平安银行	38,440	383,246.80	0.11
4	000550	五粮液	17,800	355,712.00	0.10
5	000527	美的电器	27,200	337,824.00	0.10
6	000776	广发证劵	27,800	308,024.00	0.09
7	000063	中兴通讯	21,600	275,400.00	0.08
8	000538	云南白药	3,200	268,832.00	0.08
9	000895	双汇发展	6,200	238,328.00	0.07
10	000709	河北钢铁	122,000	225,700.00	0.06

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有资产明细，应查阅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

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	000002	万科A	1,343,868.83	0.29
2	000651	格力电器	734,405.62	0.16
3	000001	平安银行	556,994.00	0.12
4	000100	TCL 集团	427,084.00	0.09
5	000776	广发证劵	402,059.77	0.09
6	000858	五粮液	394,429.39	0.08
7	000825	太钢不锈	360,682.09	0.08
8	000157	中联重科	357,761.00	0.08
9	000898	*ST毅昌	336,239.00	0.08
10	000709	河北钢铁	346,925.00	0.07
11	002024	苏宁云商	336,445.00	0.07
12	000063	中兴通讯	296,388.00	0.06
13	000538	云南白药	285,700.95	0.06
14	000895	双汇发展	280,938.17	0.06
15	000338	潍柴动力	267,241.00	0.06
16	000402	金 融 街	252,267.00	0.05
17	000983	西山煤电	238,670.00	0.05
18	000783	长信证券	221,263.00	0.05
19	000069	华侨城A	220,949.00	0.05
20	000423	东阿阿胶	215,046.01	0.05

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	000002	万科A	7,806,459.47	1.67
2	000651	格力电器	3,471,280.33	0.74
3	000001	平安银行	2,756,817.04	0.59
4	000898	*ST毅昌	2,434,391.41	0.52
5	000100	TCL 集团	2,215,703.61	0.47
6	000825	太钢不锈	2,159,124.37	0.46
7	000709	河北钢铁	1,967,791.45	0.42
8	002024	苏宁云商	1,932,367.13	0.41
9	000157	中联重科	1,762,028.37	0.38
10	000776	广发证劵	1,683,201.31	0.36
11	000338	潍柴动力	1,588,027.40	0.34
12	000402	金 融 街	1,544,859.05	0.33
13	000527	美的电器	1,515,353.12	0.32
14	000063	中兴通讯	1,500,045.71	0.32
15	000983	西山煤电	1,475,018.37	0.32
16	000895	双汇发展	1,303,284.30	0.28
17	000783	长信证券	1,232,854.26	0.26
18	000039	中集集团	1,148,679.81	0.25
19	000858	五粮液	1,146,365.67	0.25
20	000932	华菱钢铁	1,034,365.82	0.22

7.4.3 买入股票的成本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		16,799,018.79
卖出股票收入(成交)总额		83,428,006.33
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 成交单价格乘以成交数量 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	-	-
2	央行票据	9,974,000.00	2.87
3	金融债	-	-
其中：政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		9,974,000.00	2.87

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	1001074	10央行票据74	100,000	9,974,000.00	2.87

注：报告期末本基金仅持有上述1只债券。
 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
 报告期末，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
 报告期末，本基金未持有权证。
 7.9 期末投资目标基金明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实深证基本面120ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	315,836,347.18	90.93

7.10 报告期末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。
 7.11 投资组合报告附注
 7.11.1 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未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。
 7.11.2 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。
 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	66,892.20
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	225,568.93
6	其他应收款	171,071.57
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		463,532.70

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

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	机构投资者持有份额	个人投资者持有份额	占总份额比例	占总份额比例
3,293	142,773.44	189,679,619.07	40,34%	280,473,307.60	59.66%

8.2 期末基金管理人从业从业人员持有本基金的情况			
8.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况			

项目	持有份额总数量(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,373.56	0.00%

8.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研部门负责人、本基金基金经理持有本基金情况
 本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份			
基金合同生效日(2011年8月1日)	基金份额总额	基金份额变动	报告期末基金份额总额
			548,862,205.31
			33,995,208.77
			112,704,487.41
			470,152,926.67

注：报告期内基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
 报告期内未召开基金份额持有人大会。
 10.2 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
 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门(的)重大人事变动情况
 报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
 10.4 基金投资策略的重大改变
 报告期内本基金投资策略未发生改变。
 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。
 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
 报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。
 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	100,223,223.52	100.00%	89,720.21	100.00%	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
大通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增1个
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-