

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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/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、年中期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、监察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会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,固定收益组/负责人同时兼任基金估值、估值委员,基金估值参加估值委员会会议,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) 根据本报告3.1.1“本期利润”为-31,914,249.94元,3.1.2“期末可供分配基金份额利润”为-0.1715元,3.1.2“期末基金份额净值”为0.823元,以及本基金基金合同第十五部分三、收益分配原则“4,基金当期收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;5,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值”,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
报告期内,嘉实量化阿尔法股票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
报告期内,嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值核算价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项重要运作环节严格按照基金合同的规定进行。报告期内,嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对嘉实基金管理人对编制和披露的嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金2014年半年度报告中财务信息、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。

6.1 资产负债表
会计主体:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

		单位:人民币元	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产	附注号		
货币资金	6.4.1	3,147,355.21	5,326,635.09
衍生金融资产		1,157,767.07	2,719,125.92
可供出售金融资产		113,109.78	185,960.47
交易性金融资产	6.4.2.2	499,249,943.11	545,513,030.00
其中:股票投资		421,864,621.11	528,018,271.13
基金投资		—	—
债券投资		37,465,322.00	37,494,758.90
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
买入返售金融资产	6.4.2.3	—	—
应收证券清算款	6.4.2.4	40,000,000.00	15,000,000.00
应收利息		9,351.12	10,089.16
应收股利	6.4.2.5	1,142,823.39	524,443.69
应收申购款		37,567.58	221,465.27
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.2.6	—	—
资产总计		504,877,917.26	589,500,686.66
负债和所有者权益	附注号	2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.2.7	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		1,038,950.00	497,471.45
应付管理人报酬		699,267.93	748,617.74
应付托管费		101,544.67	124,769.62
应付交易费用		—	—
应付利息	6.4.2.7	388,967.31	532,386.33
应付税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		—	—
负债合计	6.4.2.8	188,671.89	380,265.85
所有者权益合计		2,326,941.20	2,383,410.89
所有者权益:			
实收基金	6.4.2.9	610,701,288.20	672,102,647.19
未分配利润	6.4.2.10	-108,150,312.14	-44,885,371.42
所有者权益合计		502,550,976.06	587,217,275.77
负债和所有者权益总计		504,877,917.26	589,500,686.66

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.823元,基金份额总额610,701,288.20份。

6.2 利润表
会计主体:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

		单位:人民币元	
		本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
项目	附注号		
一、收入		-25,191,455.30	-32,203,745.57
1.利息收入		97,452.29	819,836.40
其中:存款利息收入	6.4.2.11	70,213.68	121,593.19
债券利息收入		626,410.23	504,786.11
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		300,828.38	193,457.10
其他利息收入		—	—
2.投资收益		18,272,533.47	32,866,471.73
其中:股利收益	6.4.2.12	11,653,757.31	25,389,565.25
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.2.13	6,880.85	5,095.40
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.2.14	3,611,877.31	7,471,481.06
股利收益	6.4.2.15	3,611,877.31	7,471,481.06
3.公允价值变动收益	6.4.2.16	-41,470,744.88	-65,921,453.69
4.汇兑损益		—	—
5.其他收入	6.4.2.17	9,303.74	31,400.01
二、费用		6,722,794.64	9,755,754.02
1.管理费		6,099,326.63	5,453,452.43
2.托管费		668,221.15	941,942.06
3.销售服务费		—	—
4.交易费用	6.4.2.18	1,844,932.52	2,956,037.99
5.利息支出		—	—
6.其他费用		20,853.34	266,122.44
三、利润总额		-31,914,249.94	-41,559,509.49
减:所得税费用		—	—
四、净利润		-31,914,249.94	-41,559,509.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

		单位:人民币元	
		本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
项目		实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益(基金净值)		672,102,647.19	-44,885,371.42
二、本期基金份额变动产生的基金份额变动(本期增加)		—	-31,914,249.94
三、本期基金份额变动产生的基金份额变动		-61,401,358.99	8,649,309.22
其中:1.基金申购款		13,217,953.26	-1,829,500.74
2.基金赎回款		-74,619,312.25	10,478,809.96
四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五、期末所有者权益(基金净值)		610,701,288.20	-108,150,312.14
六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
二十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
三十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
四十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
五十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
六十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
七十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
八十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十一、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十二、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十三、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十四、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十五、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十六、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十七、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十八、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
九十九、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—
一百、本期基金份额持有人投入/转出产生的基金份额变动		—	—

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:
张军平 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 本报告摘要
6.4.1 本报告摘要所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.2 差错更正的说明
6.4.3 关联方关系
6.4.3.1 本报告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
6.4.3.2 本报告存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化
6.4.3.3 本报告与基金发生关联交易的各关联方

6.4.4 本报告摘要中上年度可追溯的关联方交易
下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.4.1 通过关联方交易进行证券类投资
本期(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易进行证券类交易。

6.4.4.2 关联方报酬
6.4.4.2.1 基金薪酬
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人员报酬按前一日基金资产净值1.5%的费率计提,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 基金管理费
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人员报酬按前一日基金资产净值1.5%的费率计提,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。
6.4.4.2.3 基金托管费
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人员报酬按前一日基金资产净值1.5%的费率计提,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。
6.4.4.2.4 基金托管费
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人员报酬按前一日基金资产净值1.5%的费率计提,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。
6.4.4.2.5 基金托管费
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人员报酬按前一日基金资产净值1.5%的费率计提,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。
6.4.4.2.6 基金托管费
项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
买入股票成本(成交金额)	642,502,317.41	716,952,271.02
卖出股票收入(成交金额)	—	—

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(成交净额乘以成交数量)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

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	—	—
3	金融债券	30,002,000.00	5.97
4	企业债券	30,002,000.00	5.97
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	7,403,322.00	1.47
8	其他	—	—
合计		37,405,322.00	7.44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	130227	13国债27	200,000	20,000,000.00	3.98
2	130236	13国债36	100,000	10,002,000.00	1.99
3	110022	银行间债	40,000	4,575,200.00	0.91
4	110005	央行票据	15,960	1,702,710.80	0.34
5	110023	央行票据	8,000	732,400.00	0.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

7.9 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

报告期末,本基金未持有权证。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 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。
7.12.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	113,109.78
2	应收证券清算款	9,351.12
3	应收利息	—
4	应收股利	—
5	应收申购款	1,142,823.3