嘉实优化红利股票型证券投资基金

【2014】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:2014年8月25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2014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2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实优化红利股票型证券投资基金
基金简称	嘉实优化红利股票
基金主代码	070032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26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	31,920,925.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票,通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征,追求稳定的股息收入和长期的资本增值。同时,以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-2,090,191.63
本期利润	-2,839,662.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0775
本期加权平均净值利润率	-8.29%
本期基金份额净值增长率	-6.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-1,992,659.80
期末可供分配基金份额利润	-0.0624
期末基金资产净值	29,928,265.84
期末基金份额净值	0.938
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-6.20%

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	2.85%	0.90%	1.19%	0.86%	1.66%	0.04%
过去三个月	4.34%	0.94%	-0.45%	0.90%	4.79%	0.04%
过去六个月	-6.67%	1.04%	-1.62%	1.02%	-5.05%	0.02%
过去一年	0.11%	1.12%	2.37%	1.16%	-2.26%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-6.20%	1.13%	-5.95%	1.25%	-0.25%	-0.12%

注:本基金业绩比较基准为:中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,指数加权方式同沪深300指数,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。

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)=95%×中证红利指数收益率(t)+5%×上证国债指数收益率(t)

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

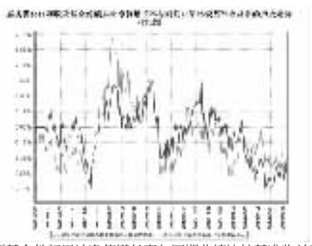

图:嘉实优化红利股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年6月26日至2014年6月30日)

注1:按基金合同和招募说明书的约定,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"第十二部分 二、投资范围和 四、投资限制"的有关约定。

注2:2014年2月7日,本基金管理人发布《关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告》,聘请翟琳琳女士担任本基金基金经理职务,与现任基金经理赵勇先生共同管理本基金。

§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2014年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、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)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券等证券投资基金。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		
翟琳琳	本基金基金经理,嘉实回报混合基金经理	2014年2月7日	-	8年	2005年7月加入嘉实基金,先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。
赵勇	本基金基金经理,嘉实回报混合基金经理	2013年7月20日	-	12年	曾任大成基金管理公司基金经理助理,泰康资产管理公司权益投资经理。2008年3月加入嘉实基金管理公司。北京大学光华管理学院工商管理硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期、离职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;(3)2014年7月23日,本基金管理人发布《关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告》,赵勇先生不再担任本基金基金经理,本基金由现任基金经理翟琳琳女士独立管理。

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、《嘉实优化红利股票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,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计3次,均为旗下ETF因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易,但不存在利益输送行为。

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

14年上半年整体经济窄幅波动,一季度由于房地产销售和发电量等中观因素显示经济仍有下滑压力,市场对于主板的盈利增长的担心有所加大,同时对于经济转型的预期加强,因此一季度尤其是1月份,创业板指数大幅度上涨,而主板指数大幅下跌,市场的结构性分化严重;二季度随着政府定向宽松的政策实施,整体经济下行的风险降低,市场的风格有所转化,3月、4月创业板快速调整,但上半年仍然是创业板指数明显强于主板;整个上半年沪深300指数、中证800指数、创业板指数分别取得-7.08%、-4.6%、和7.69%的收益率;分行业看,汽车、通信、计算机、休闲服务和电气设备取得了较好的相对收益和绝对收益,而采掘、非银金融、建筑装饰、商业贸易和农林牧渔则产生了较大的负收益。

回顾本组合的操作,组合期间的平均仓位维持在70%-90%之间波动;在行业配置上,超配的集成电路、汽车电子和计算机和医药行业取得了较好的收益,而超配的食品饮料、机械设备、有色行业则产生了一定的亏损。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.938元;本报告期基金份额净值增长率为-6.67%,业绩比较基准收益率为-1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济基本面看,政府对经济的表述从之前的"保持定力"过渡到"主动作为",稳经济的意图明显,但不同于09年"四万亿"的全局性刺激政策,本次采用宏观托底+局部刺激的模式,具体而言,一是通过再贷款、定向降准、成立产业基金等方式对于既符合稳增长又符合调结构的品种给予重点支持;二是,由于CPI和PPI维持低位,房地产的景气也在下行,基建项目的审批和建设速度在加快,对房地产行业的自主性需求和改善型需求出台相应的信贷支持政策,甚至局部地区放松限购等政策,以缓解房地产投资增速放缓给经济带来的负面压力。

展望下半年,我们判断宏观经济增速环比小幅提升,但大的周期仍处于衰退期,政策延续微刺激趋势,由于外汇占款的大幅度下降和新股发行的资金分流对冲了微刺激释放的流动性,整体流动性环境相对中性,因此预计整个市场指数保持缓慢上行,结构性机会仍是我们重点捕捉的机会;在投资操作上,我们仍然坚持中低仓位+精选个股的策略;具体而言,主要包括:一是国家重点支持的集成电路、军工行业;二是,中长期增长明确的汽车电子、医药行业和休闲服务行业;三是,竞争格局良好,估值较低的家电和汽车行业。

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、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)根据本报告3.1.1"本期利润"为-2,839,662.85元、3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为-0.0624元、3.1.2"期末基金份额净值"为0.938元,以及本基金基金合同(十六(三)收益分配原则)"1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%,如本基金当季度末每份基金份额可供分配利润超过0.05元时,本基金管理人应在下季度第一个月进行收益分配;3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值",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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实优化红利股票型证券投资基金(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:嘉实优化红利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

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	3,913,391.82	4,099,014.31
结算备付金		345,790.09	122,041.73
存出保证金		14,254.32	31,987.28
交易性金融资产	6.4.7.2	25,892,789.62	34,705,980.31
其中:股票投资		24,893,289.62	32,666,966.51
基金投资		-	-
债券投资		999,500.00	2,039,013.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000,000.00	-
应收证券清算款		-	2,443,287.88
应收利息	6.4.7.5	27,381.15	43,106.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	13,171,578.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		32,193,607.00	54,616,996.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,000,000.00	898,256.58
应付赎回款		27,474.37	4,919.11
应付管理人报酬		36,009.90	46,394.11
应付托管费		6,001.64	7,732.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	22,228.95	67,490.82
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	173,626.30	350,009.24
负债合计		2,265,341.16	1,374,802.24
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	31,920,925.64	52,990,590.62
未分配利润	6.4.7.10	-1,992,659.80	251,603.86
所有者权益合计		29,928,265.84	53,242,194.48
负债和所有者权益总计		32,193,607.00	54,616,996.72

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.938元,基金份额总额31,920,925.64份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实优化红利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

资 产	附注号	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
一、收入		-2,201,922.79	508,087.64
1.利息收入		94,902.31	78,740.98
其中:存款利息收入	6.4.7.11	13,309.98	12,475.17
债券利息收入		29,279.67	54,636.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		52,312.66	11,628.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-1,576,012.77	6,885,857.06
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,754,880.21	6,445,795.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	684.00	-11,863.01
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	178,183.44	451,924.83
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-749,471.22	-6,600,909.04
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	28,658.89	144,398.64
减:二、费用		637,740.06	1,223,425.69
1.管理人报酬		255,019.90	522,116.65
2.托管费		42,503.29	87,019.47
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	154,391.02	422,423.70
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	185,825.85	191,865.87
三、利润总额		-2,839,662.85	-715,338.05
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-2,839,662.85	-715,338.05

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实优化红利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

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	52,990,590.62	251,603.86	53,242,194.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,839,662.85	-2,839,662.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-21,069,664.98	595,399.19	-20,474,265.79
其中:1.基金申购款	3,737,546.46	-156,178.31	3,581,368.15
2.基金赎回款	-24,807,211.44	751,577.50	-24,055,633.94
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)	31,920,925.64	-1,992,659.80	29,928,265.84
项目	上年度可比期间 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)	138,541,930.64	2,343,233.82	140,885,164.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-715,338.05	-715,338.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-84,817,972.81	-4,992,604.87	-89,810,577.68
其中:1.基金申购款	26,219,538.90	-496,344.24	25,723,194.66
2.基金赎回款	-111,037,511.71	-4,496,260.63	-115,533,772.34
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)	53,723,957.83	-3,364,709.10	50,359,248.73

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 通过关联方交易单元进行的交易

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	255,019.90	522,116.65
其中:支付销售机构的客户维护费	69,229.86	169,321.30

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	42,503.29	87,019.47

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(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),基金本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(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),基金管理人未运用固有资金投资本产品。

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(2014年06月30日)及上年度末(2013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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,913,391.82	9,284.31	227,404.89	8,630.68

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(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),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2014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(2014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(2014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(2014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(2014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	24,893,289.62	77.32
	其中:股票	24,893,289.62	77.32
2	固定收益投资	999,500.00	3.10
	其中:债券	999,500.00	3.10
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	2,000,000.00	6.21
	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	4,259,181.91	13.23
7	其他各项资产	41,635.47	0.13
	合计	32,193,607.00	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	-	-
C	制造业	18,641,950.97	62.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,792,000.00	5.99
F	批发和零售业	3,215,882.65	10.75
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	1,996.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,241,460.00	4.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	24,893,289.62	83.18

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	000963	华东医药	30,000	1,620,000.00	5.41
2	000333	美的集团	82,802	1,599,734.64	5.35
3	000028	国药一致	39,947	1,595,882.65	5.33
4	600594	益佰制药	37,996	1,562,775.48	5.22
5	002049	同方国芯	62,000	1,472,500.00	4.92
6	601992	金隅股份	250,000	1,405,000.00	4.69
7	600081	东风科技	100,000	1,389,000.00	4.64
8	000039	中集集团	103,000	1,386,380.00	4.63
9	600970	中材国际	199,905	1,363,352.10	4.56
10	600138	中青旅	57,000	1,241,460.00	4.15

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	601992	金隅股份	2,670,178.00	5.02
2	600081	东风科技	2,340,808.61	4.40
3	000028	国药一致	2,070,737.07	3.89
4	603008	喜临门	1,968,526.00	3.70
5	000970	中科三环	1,674,381.38	3.14
6	002051	中工国际	1,563,947.00	2.94
7	600970	中材国际	1,485,956.22	2.79
8	601288	农业银行	1,482,000.00	2.78
9	000963	华东医药	1,438,854.37	2.70
10	002376	新北洋	1,417,386.46	2.66
11	600594	益佰制药	1,397,542.81	2.62
12	300183	东软载波	1,385,580.00	2.60
13	601808	中海油服	1,305,146.00	2.45
14	600660	福耀玻璃	1,127,043.00	2.12
15	002349	精华制药	1,117,925.00	2.10
16	300212	易华录	1,066,773.00	2.00
17	002104	恒宝股份	1,065,805.36	2.00
18	600138	中青旅	1,058,779.19	1.99
19	002020	京新药业	1,057,528.47	1.99
20	300101	振芯科技	1,034,584.28	1.94

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	002410	广联达	2,828,959.02	5.31
2	601166	兴业银行	2,727,827.75	5.12
3	600887	伊利股份	2,280,112.00	4.28
4	000651	格力电器	2,279,085.96	4.28
5	601766	中国南车	2,080,000.00	3.91
6	600171	上海贝岭	1,845,662.97	3.47
7	600085	同仁堂	1,656,226.36	3.11
8	300183	东软载波	1,538,745.65	2.89
9	601288	农业银行	1,524,000.00	2.86
10	600315	上海家化	1,514,459.58	2.84
11	000970	中科三环	1,404,600.00	2.64
12	601992	金隅股份	1,380,952.16	2.59
13	300212	易华录	1,368,953.45	2.57
14	002041	登海种业	1,339,450.04	2.52
15	600104	上汽集团	1,308,005.00	2.46
16	600081	东风科技	1,216,640.50	2.29
17	600660	福耀玻璃	1,194,930.00	2.24
18	002376	新北洋	1,163,544.26	2.19
19	600309	万华化学	1,140,553.00	2.14
20	603008	喜临门	1,118,276.00	2.10
21	601808	中海油服	1,115,592.41	2.10

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	54,953,213.07
卖出股票收入(成交)总额	60,215,636.33

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	999,500.00	3.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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