

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 境外资产托管人.....                             | 6         |
| 2.5 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11        |
| 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.....             | 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.....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....              | 35        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                      | 35        |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....       | 36        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....                     | 43        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....                  | 45        |
| 7.7 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.....      | 45        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 45        |
| 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金融衍生品投资明细.....   | 45        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....     | 45        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 46        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>46</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 47        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 47        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>               | <b>47</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                 | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 48        |
| 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.....  | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 48        |
| 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.....     | 48        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 49        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 50        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                 | <b>50</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 50        |
| 11.2 存放地点.....                         | 51        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                         |                          |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 基金名称            | 嘉实美国成长股票型证券投资基金         |                          |
| 基金简称            | 嘉实美国成长股票 ( QDII )       |                          |
| 基金主代码           | 000043                  |                          |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                  |                          |
| 基金合同生效日         | 2013 年 6 月 14 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      | 55, 033, 315. 83 份      |                          |
| 基金合同存续期         | 不定期                     |                          |
| 下属分级基金的基金简称:    | 嘉实美国成长股票型证券投资<br>基金-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资<br>基金-美元现汇 |
| 下属分级基金的交易代码:    | 000043                  | 000044                   |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 49, 720, 321. 27 份      | 5, 312, 994. 56 份        |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。   |
| 投资策略   | 本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。其中，核心模型包括成长性模型、多因子 Alpha 模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。 |
| 业绩比较基准 | 95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率  |
| 风险收益特征 | 本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。   |

### 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       |
| 注册地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元 | 北京西城区复兴门内大街 1 号      |

|       |                           |                 |
|-------|---------------------------|-----------------|
| 办公地址  | 北京市建国门北大街 8 号<br>华润大厦 8 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码  | 100005                    | 100818          |
| 法定代表人 | 安奎                        | 田国立             |

## 2.4 境外资产托管人

本基金基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人。本基金的境外资产托管业务由基金托管人中国银行有限公司承担。

## 2.5 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 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                         |

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                     |
|--------|------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 嘉实基金管理有限公司 | 北京市建国门北大街 8 号华润大厦<br>8 层 |

## § 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

| 基金级别          | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币         | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇        |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 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) | 报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 527,204.34                  | 209,253.98                  |
| 本期利润          | 757,468.51                  | 528,048.13                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0151                      | 0.0945                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.35%                       | 1.38%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.51%                       | 0.62%                       |
| 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      | 2,378,782.17                | -32,397,959.01              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0478                      | -6.0979                     |
| 期末基金资产净值      | 56,812,570.15               | 37,256,024.98               |
| 期末基金份额净值      | 1.143                       | 1.140                       |
| 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   | 14.30%                      | 14.00%                      |

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) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额以人民币为申购获得人民币份额，赎回获得人民币赎回款；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额以美元申购获得美元份额，赎回获得美元赎回款；(3) 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；(4) 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；(5) 嘉实美国成长股票 ( QDII ) 美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

## 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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

| 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      | 1.51%    | 0.39%       | 1.72%      | 0.37%         | -0.21% | 0.02% |
| 过去三个月      | 2.51%    | 0.80%       | 4.47%      | 0.66%         | -1.96% | 0.14% |
| 过去六个月      | 1.51%    | 0.79%       | 5.20%      | 0.66%         | -3.69% | 0.13% |
| 过去一年       | 14.07%   | 0.72%       | 23.53%     | 0.63%         | -9.46% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.30%   | 0.70%       | 21.30%     | 0.65%         | -7.00% | 0.05% |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 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      | 1.79%    | 0.39%       | 1.72%      | 0.37%         | 0.07%  | 0.02% |
| 过去三个月      | 2.52%    | 0.80%       | 4.47%      | 0.66%         | -1.95% | 0.14% |
| 过去六个月      | 0.62%    | 0.79%       | 5.20%      | 0.66%         | -4.58% | 0.13% |
| 过去一年       | 14.11%   | 0.71%       | 23.53%     | 0.63%         | -9.42% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.00%   | 0.70%       | 21.30%     | 0.65%         | -7.30% | 0.05% |

注：本基金业绩比较基准为：95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率  
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：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}(t)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币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

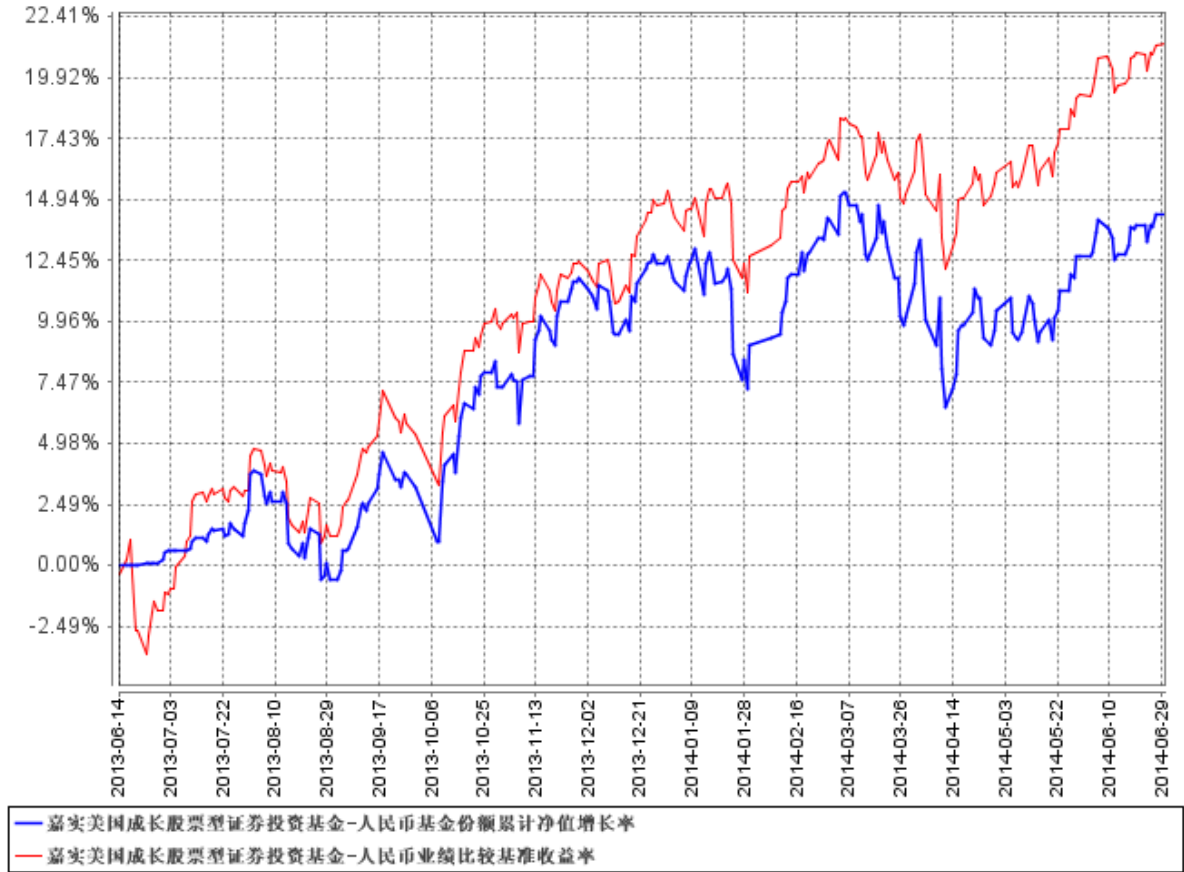


图 1：嘉实美国成长股票 ( QDII ) 人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2014 年 6 月 30 日)



### 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇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

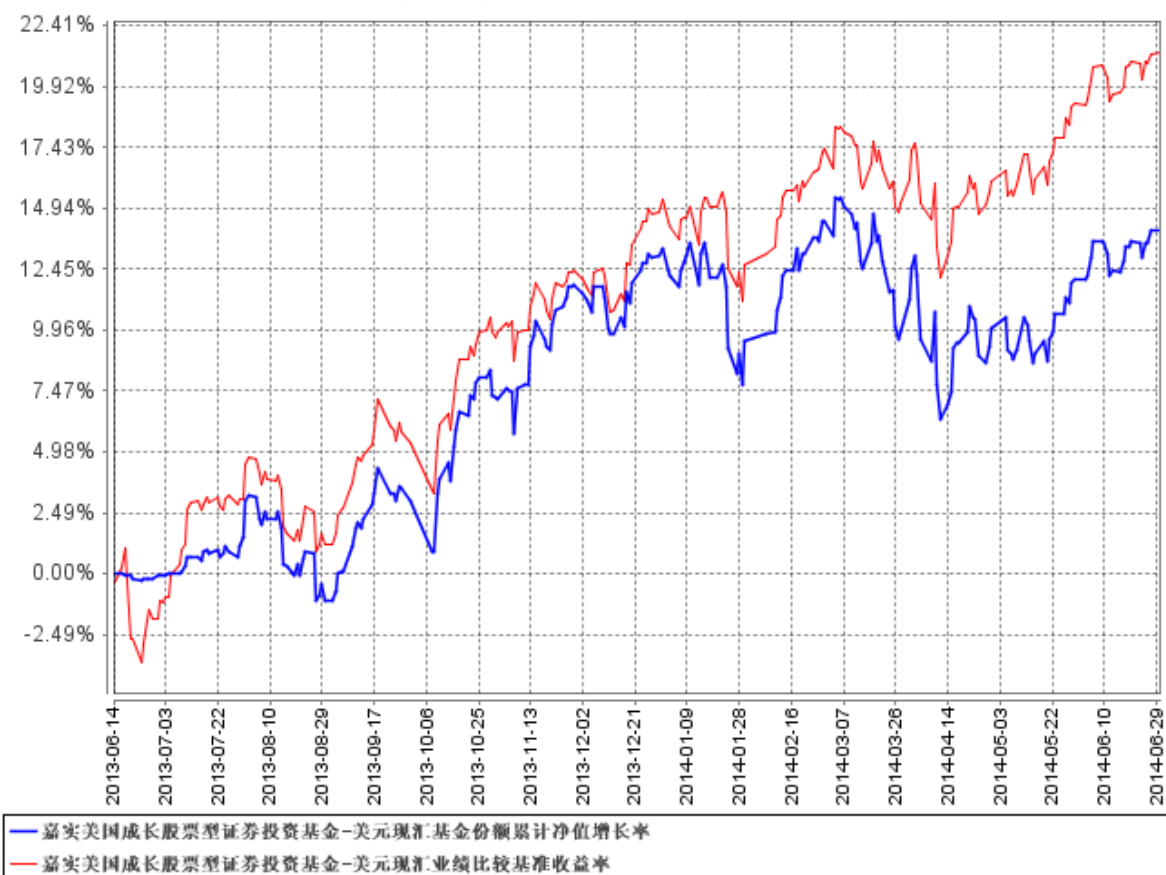


图 2：嘉实美国成长股票 (QDII) 美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2014 年 6 月 30 日)

注：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“第十四部分 (三) 投资范围和 (九) 投资限制”的有关约定。

## § 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 |        |  |
| 张自力 | 本基金基金经理、定量投资部负责人 | 2013 年 6 月 14 日   | -    | 18 年   | 理论物理学博士, 毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学, 具有 18 年公募基金从业经验。曾任美国世纪投资管理公司 (American Century Investments) 资深副总经理, 研究部总监暨基金经理, 负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司, 投资决策委员会成员、定量投资部负责人。 |

注: (1) 任职日期是指本基金基金合同生效之日; (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合规守信情况的说明

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、《嘉实美国成长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

受年初美国经济数据疲软及乌克兰地缘政治危机等个别事件的影响，以及一季度末开始的一轮市场风格切换，美国股票市场在 2014 年上半年整体呈现震荡行情，市场回撤较大，同时相比于 2013 年有较明显的风格转换。

本基金今年以来主要损失发生在 3 月 5 日至 5 月初。期间市场震荡较大，并有相对强烈的成长/价值风格转换和大小盘风格转换，行业切换较快，本基金所持有的生物医药、高科技等高成长类股票受到较大冲击，净值出现下行调整，相对业绩基准的超额收益也受到侵蚀。

一季度期间，在 2014 年 1 月下旬，市场整体下行超过 5%，本基金在期间维持了相对基准指数的超额收益，未受市场回撤影响。在 2014 年 2 月中上旬，基于经济数据的强势好转，市场持续向上反弹，本基金实现了超越基准的更高涨幅。一季度，本基金主要损失发生在 3 月下旬，期间市场下跌并且伴随着相对强烈的风格转换，本基金所持有的生物医药、高科技等高成长类股票受

到较大冲击，本基金净值出现下行调整，相对业绩基准的超额收益也受到侵蚀。

二季度期间，本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金在保证 90%股票仓位和 5%现金仓位的合规约束下，成功实现了流动性操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 1.143 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.51%；截至报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 1.140 美元，本报告期基金份额净值增长率为 0.62%；同期业绩比较基准收益率为 5.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期今年和明年美国经济将继续走强，基于此判断我们认为 2014 年美国股票市场整体上也将继续 2013 年的上行趋势。

货币政策上，我们认为全球央行正朝着紧缩政策的方向走，美国的 QE 退出进程正在按计划实施，美联储 1 月和 3 月会议上保持每次 100 亿的速度继续缩减，在发达国家里只有欧洲和日本仍维持宽松政策，部分新兴国家央行已经大幅加息来打压通胀。

实体经济上，政府和企业支出开始呈现扩张态势，失业率有望持续下降，消费者信心有提升迹象，我们预期经济依然处于持续复苏的向好过程。6 月发布的最新经济数据明显超出市场预期，GDP 增长较高，就业人口比率上升。未来美国经济的推动力将来自于政府支出的增加和私人非住宅部门的 CAPEX 增加，这两块儿占 GDP 比重 30%左右。

市场方面，我们认为美国股票市场长期将继续上涨。市场领先指标仍是向上，没有疲弱的迹象，同时 OECD 整体经济增速改善要好于金砖。但由于企业盈利长期成长趋势不变，我们认为在下半年美国经济复苏稳定后，股票市场将有望继续 2013 年的上涨。尽管短期面临中期选举、市场情绪过于乐观等问题，中长期看牛市还未结束，而且可能突破过去 10 多年的震荡平台向上，未来一段时间美国股市预期好于新兴市场。

#### 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验。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；与估值相关的机构为纽约、纳斯达克交易所等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，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”）在对嘉实美国成长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）、投资组合报告等内容真实、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：嘉实美国成长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<br>2014 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 7,750,399.80                   | 5,919,761.91                     |
| 结算备付金           |            | -                              | 238,095.24                       |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 88,861,284.68                  | 84,062,323.63                    |
| 其中：股票投资         |            | 85,179,201.33                  | 83,635,182.92                    |
| 基金投资            |            | 3,682,083.35                   | 427,140.71                       |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 411.95                         | 668.21                           |
| 应收股利            |            | 80,470.19                      | 78,545.87                        |
| 应收申购款           |            | 1,902,575.12                   | 2,261,383.83                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 98,595,141.74                  | 92,560,778.69                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2013 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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         |            | 3,494,001.55                   | 2,504,841.49                     |
| 应付赎回款           |            | 681,595.75                     | 866,793.07                       |
| 应付管理人报酬         |            | 142,290.73                     | 132,762.47                       |
| 应付托管费           |            | 27,667.63                      | 25,814.93                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 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    | 180,990.95                     | 222,266.51                       |
| 负债合计            |            | 4,526,546.61                   | 3,752,478.47                     |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                |                                  |

|            |          |               |               |
|------------|----------|---------------|---------------|
| 实收基金       | 6.4.7.9  | 82,400,107.37 | 78,996,966.81 |
| 未分配利润      | 6.4.7.10 | 11,668,487.76 | 9,811,333.41  |
| 所有者权益合计    |          | 94,068,595.13 | 88,808,300.22 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 98,595,141.74 | 92,560,778.69 |

注:报告截止日 2014 年 6 月 30 日,嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 1.143 元,基金份额总额 49,720,321.27 份;嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 1.140 美元,基金份额总额 5,312,994.56 份。嘉实美国成长股票 (QDII) 基金份额总额合计为 55,033,315.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体:嘉实美国成长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            | 附注号      | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 14 日(基金<br>合同生效日)至 2013 年<br>6 月 30 日 |
|---------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>   |          | 2,589,479.93                             | 1,244,080.63  |
| 1.利息收入        |          | 14,925.93                                | 1,107,410.25  |
| 其中:存款利息收入     | 6.4.7.11 | 14,925.93                                | 35,556.39   |
| 债券利息收入        |          | -  | -   |
| 资产支持证券利息收入    |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入    |          | -  | 1,071,853.86  |
| 其他利息收入        |          | -  | -   |
| 2.投资收益        |          | 1,978,013.10                             | 0.00  |
| 其中:股票投资收益     | 6.4.7.12 | 1,639,309.24                             | 0.00  |
| 基金投资收益        | 6.4.7.13 | -187,986.37                              | 0.00  |
| 债券投资收益        | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益    |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益       |          | -  | -   |
| 衍生工具收益        | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 股利收益          | 6.4.7.16 | 526,690.23                               | 0.00  |
| 3.公允价值变动收益    | 6.4.7.17 | 549,058.32                               | 0.00  |
| 4.汇兑收益        | 6.4.7.21 | -1,814.04                                | 136,663.11  |
| 5.其他收入        | 6.4.7.18 | 49,296.62                                | 7.27  |
| <b>减:二、费用</b> |          | 1,303,963.29                             | 450,022.47  |
| 1. 管理人报酬      |          | 838,228.27                               | 376,582.16  |
| 2. 托管费        |          | 162,988.80                               | 73,224.31   |
| 3. 销售服务费      |          | -  | -   |
| 4. 交易费用       | 6.4.7.19 | 110,010.02                               | 0.00  |
| 5. 利息支出       |          | -  | -   |
| 其中:卖出回购金融资产支出 |          | -  | -   |

|         |          |              |            |
|---------|----------|--------------|------------|
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 192,736.20   | 216.00     |
| 三、利润总额  |          | 1,285,516.64 | 794,058.16 |
| 减：所得税费用 |          | -            | -          |
| 四、净利润   |          | 1,285,516.64 | 794,058.16 |

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 6 月 14 日，上年度可比期间为 2013 年 6 月 14 日至 2013 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实美国成长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

| 项目                           | 本期<br>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）              | 78,996,966.81  | 9,811,333.41  | 88,808,300.22  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数<br>（本期利润） | -  | 1,285,516.64  | 1,285,516.64   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数         | 3,403,140.56   | 571,637.71    | 3,974,778.27   |
| 其中：1. 基金申购款                  | 40,579,891.92  | 4,975,562.98  | 45,555,454.90  |
| 2. 基金赎回款                     | -37,176,751.36                                       | -4,403,925.27 | -41,580,676.63 |
| 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）              | 82,400,107.37  | 11,668,487.76 | 94,068,595.13  |
| 项目                           | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 14 日(基金合同生效日)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）              | 477,020,063.08                                       | -             | 477,020,063.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数<br>（本期利润） | -  | 794,058.16    | 794,058.16     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数         | -  | -             | -              |
| 其中：1. 基金申购款                  | -  | -             | -              |
| 2. 基金赎回款                     | -  | -             | -              |
| 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）              | 477,020,063.08                                       | 794,058.16    | 477,814,121.24 |



注：本基金合同生效日为 2013 年 6 月 14 日，上年度可比期间是指 2013 年 6 月 14 日至 2013 年 6 月 30 日。

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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>赵学军</u> | <u>李松林</u> | <u>王红</u> |
| 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 基金基本情况

嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]14 号《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,918,336.37 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 352 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 477,029,933.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 111,596.72 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于下列金融产品或工具：银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边

监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关要求)。本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 90%；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%。本基金主要投资于美国发行、上市的大盘成长型股票，所投资比例不低于权益类资产的 80%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率} + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2014年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 7,750,399.80      |
| 定期存款         | -                 |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                 |
| 其他存款         | -                 |
| 合计：          | 7,750,399.80      |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2014年6月30日 |               |               |
|-------------------|-------------------|---------------|---------------|
|                   | 成本                | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票                | 74,921,060.18     | 85,179,201.33 | 10,258,141.15 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -             | -             |
| 债券                | 交易所市场             | -             | -             |
|                   | 银行间市场             | -             | -             |
|                   | 合计                | -             | -             |
| 资产支持证券            | -                 | -             | -             |
| 基金                | 3,670,366.04      | 3,682,083.35  | 11,717.31     |
| 其他                | -                 | -             | -             |
| 合计                | 78,591,426.22     | 88,861,284.68 | 10,269,858.46 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2014年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2014年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2014年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 404.04            |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | 7.91              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 411.95            |

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2014年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本期末（2014年6月30日），本基金无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 2,470.65          |
| 预提费用        | 178,520.30        |
| 合计          | 180,990.95        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 |                            |                |
|---------------------|----------------------------|----------------|
| 项目                  | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                |
|                     | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末                | 49,277,647.12              | 49,277,647.12  |
| 本期申购                | 21,423,416.96              | 21,423,416.96  |
| 本期赎回                | -20,980,742.81             | -20,980,742.81 |
| 本期末                 | 49,720,321.27              | 49,720,321.27  |

金额单位：人民币元

| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |                            |
|----------------------|----------------------------|
| 项目                   | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |

|      | 基金份额 (份)      | 账面金额           |
|------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 4,824,220.62  | 29,719,319.69  |
| 本期申购 | 3,121,431.58  | 19,156,474.96  |
| 本期赎回 | -2,632,657.64 | -16,196,008.55 |
| 本期末  | 5,312,994.56  | 32,679,786.10  |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 |              |               |               |
|---------------------|--------------|---------------|---------------|
| 项目                  | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                | 1,806,292.30 | 4,396,232.60  | 6,202,524.90  |
| 本期利润                | 527,204.34   | 230,264.17    | 757,468.51    |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | 45,285.53    | 86,969.94     | 132,255.47    |
| 其中：基金申购款            | 975,832.90   | 1,536,448.84  | 2,512,281.74  |
| 基金赎回款               | -930,547.37  | -1,449,478.90 | -2,380,026.27 |
| 本期已分配利润             | -            | -             | -             |
| 本期末                 | 2,378,782.17 | 4,713,466.71  | 7,092,248.88  |

单位：人民币元

| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |                |               |               |
|----------------------|----------------|---------------|---------------|
| 项目                   | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                 | 964,595.52     | 2,644,212.99  | 3,608,808.51  |
| 本期利润                 | 209,253.98     | 318,794.15    | 528,048.13    |
| 本期基金份额交易产生的变动数       | -33,571,808.51 | 34,011,190.75 | 439,382.24    |
| 其中：基金申购款             | -39,645,609.65 | 42,108,890.89 | 2,463,281.24  |
| 基金赎回款                | 6,073,801.14   | -8,097,700.14 | -2,023,899.00 |
| 本期已分配利润              | -              | -             | -             |
| 本期末                  | -32,397,959.01 | 36,974,197.89 | 4,576,238.88  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,414.32                  |
| 定期存款利息收入  | -                          |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 160.69                     |
| 其他        | 350.92                     |
| 合计        | 14,925.93                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|            | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 68,398,111.57                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 66,758,802.33                   |
| 买卖股票差价收入   | 1,639,309.24                    |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 10,700,290.43                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 10,888,276.80                         |
| 基金投资收益        | -187,986.37                           |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 526,690.23                            |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 526,690.23                            |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 549,058.32                            |
| ——股票投资     | 537,288.40                            |
| ——债券投资     | -                                     |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——基金投资     | 11,769.92                             |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |
| ——权证投资     | -                                     |
| 3. 其他      | -                                     |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 549,058.32 |
|----|------------|

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 49,296.62            |
| 合计      | 49,296.62            |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 110,010.02           |
| 银行间市场交易费用 | -                    |
| 合计        | 110,010.02           |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 审计费用    | 29,752.78            |
| 信息披露费   | 148,767.52           |
| 银行划款手续费 | 13,315.90            |
| 其他      | 900.00               |
| 合计      | 192,736.20           |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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     |
| 德意志证券亚洲有限公司         | 与基金管理人股东处于同一控股集团 |

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称           | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2013年6月14日(基金合同生效日)至2013<br>年6月30日 |                      |
|-----------------|----------------------------|----------------------|---|----------------------|
|                 | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 德意志证券亚<br>洲有限公司 | 91,518,662.28              | 67.21%               | -   | -                    |

注：上年度可比期间(2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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6月14日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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6月14日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称           | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2013年6月14日(基金合同生效日)至2013<br>年6月30日 |                      |
|-----------------|----------------------------|----------------------|---|----------------------|
|                 | 成交金额                       | 占当期基金<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额  | 占当期基金<br>成交总额的比<br>例 |
| 德意志证券亚<br>洲有限公司 | 11,281,642.21              | 45.43%               | -   | -                    |

注：上年度可比期间(2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年6月30日)，本基金未通过



关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

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6月14日（基金合同生效日）至2013年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称           | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                |          |                  |
|-----------------|----------------------------|----------------|----------|------------------|
|                 | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 德意志证券亚<br>洲有限公司 | 75,355.75                  | 69.50%         | -        | -                |

注1：上年度可比期间（2013年6月14日（基金合同生效日）至2013年6月30日），本基金无应支付关联方的佣金。

注2：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2014年1月1日至2014年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2013年6月14日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付<br>的管理费  | 838,228.27                     | 376,582.16                                    |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 301,510.33                     | 152,482.05                                    |

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2014年1月1日至2014年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2013年6月14日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |
|------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付 | 162,988.80                     | 73,224.31                                     |

|      |  |  |
|------|--|--|
| 的托管费 |  |  |
|------|--|--|

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.35% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2013 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金投资本产品。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2013 年<br>6 月 30 日 |           |
|------------|---------------------------------------|-----------|---|-----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国银行股份有限公司 | 7,750,399.80                          | 14,575.01 | 47,018,366.29   | 35,556.39 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.6 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），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末 (2014 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 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。

### 6.4.12.2 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金, 主要投资于美国大盘成长型股票, 为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的基金品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段, 力争获取长期资本增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系, 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会, 负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况, 充分发挥独立董事监督职能, 保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险, 本基金的基金管理人设立风险控制委员会, 由公司总经理、督察长以及部门总监组成, 负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险, 并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度, 积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核, 定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作, 并保证监察稽核部的独立性和权威性, 配备了充足合格的监察稽核人员, 明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为

所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与境外当地授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可参与证券借贷交易或正回购交易以应对流动性需求，并采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出/售出证券市值的 102%，且所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过本基金总资产的 50%。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 | 6 个月以内       | 不计息           | 合计            |
|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| 资产                     |              |               |               |
| 银行存款                   | 7,750,399.80 | -             | 7,750,399.80  |
| 结算备付金                  | -            | -             | -             |
| 存出保证金                  | -            | -             | -             |
| 交易性金融资产                | -            | 88,861,284.68 | 88,861,284.68 |
| 衍生金融资产                 | -            | -             | -             |
| 买入返售金融资产               | -            | -             | -             |
| 应收证券清算款                | -            | -             | -             |

|                     |              |               |               |
|---------------------|--------------|---------------|---------------|
| 应收利息                | -            | 411.95        | 411.95        |
| 应收股利                | -            | 80,470.19     | 80,470.19     |
| 应收申购款               | 7,100.45     | 1,895,474.67  | 1,902,575.12  |
| 递延所得税资产             | -            | -             | -             |
| 其他资产                | -            | -             | -             |
| 资产总计                | 7,757,500.25 | 90,837,641.49 | 98,595,141.74 |
| 负债                  | -            | -             | -             |
| 短期借款                | -            | -             | -             |
| 交易性金融负债             | -            | -             | -             |
| 衍生金融负债              | -            | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款           | -            | -             | -             |
| 应付证券清算款             | -            | 3,494,001.55  | 3,494,001.55  |
| 应付赎回款               | -            | 681,595.75    | 681,595.75    |
| 应付管理人报酬             | -            | 142,290.73    | 142,290.73    |
| 应付托管费               | -            | 27,667.63     | 27,667.63     |
| 应付销售服务费             | -            | -             | -             |
| 应付交易费用              | -            | -             | -             |
| 应交税费                | -            | -             | -             |
| 应付利息                | -            | -             | -             |
| 应付利润                | -            | -             | -             |
| 递延所得税负债             | -            | -             | -             |
| 其他负债                | -            | 180,990.95    | 180,990.95    |
| 负债总计                | -            | 4,526,546.61  | 4,526,546.61  |
| 利率敏感度缺口             | 7,757,500.25 | 86,311,094.88 | 94,068,595.13 |
| 上年度末<br>2013年12月31日 | 6个月以内        | 不计息           | 合计            |
| 资产                  |              |               |               |
| 银行存款                | 5,919,761.91 | -             | 5,919,761.91  |
| 结算备付金               | 238,095.24   | -             | 238,095.24    |
| 存出保证金               | -            | -             | -             |
| 交易性金融资产             | -            | 84,062,323.63 | 84,062,323.63 |
| 衍生金融资产              | -            | -             | -             |
| 买入返售金融资产            | -            | -             | -             |
| 应收证券清算款             | -            | -             | -             |
| 应收利息                | -            | 668.21        | 668.21        |
| 应收股利                | -            | 78,545.87     | 78,545.87     |
| 应收申购款               | 104,798.05   | 2,156,585.78  | 2,261,383.83  |
| 递延所得税资产             | -            | -             | -             |
| 其他资产                | -            | -             | -             |
| 资产总计                | 6,262,655.20 | 86,298,123.49 | 92,560,778.69 |
| 负债                  | -            | -             | -             |
| 短期借款                | -            | -             | -             |

|           |              |               |               |
|-----------|--------------|---------------|---------------|
| 交易性金融负债   | -            | -             | -             |
| 衍生金融负债    | -            | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款 | -            | -             | -             |
| 应付证券清算款   | -            | 2,504,841.49  | 2,504,841.49  |
| 应付赎回款     | -            | 866,793.07    | 866,793.07    |
| 应付管理人报酬   | -            | 132,762.47    | 132,762.47    |
| 应付托管费     | -            | 25,814.93     | 25,814.93     |
| 应付销售服务费   | -            | -             | -             |
| 应付交易费用    | -            | -             | -             |
| 应交税费      | -            | -             | -             |
| 应付利息      | -            | -             | -             |
| 应付利润      | -            | -             | -             |
| 递延所得税负债   | -            | -             | -             |
| 其他负债      | -            | 222,266.51    | 222,266.51    |
| 负债总计      | -            | 3,752,478.47  | 3,752,478.47  |
| 利率敏感度缺口   | 6,262,655.20 | 82,545,645.02 | 88,808,300.22 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |             |               | 合计            |
|----------|------------------------|-------------|---------------|---------------|
|          | 美元<br>折合人民币            | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 |               |
| 以外币计价的资产 |                        |             |               |               |
| 银行存款     | 6,037,502.32           | -           | -             | 6,037,502.32  |
| 交易性金融资产  | 88,861,284.68          | -           | -             | 88,861,284.68 |
| 应收证券清算款  | -                      | -           | -             | -             |
| 应收利息     | 61.84                  | -           | -             | 61.84         |
| 应收股利     | 80,470.19              | -           | -             | 80,470.19     |
| 应收申购款    | 1,823,952.58           | -           | -             | 1,823,952.58  |

|               |                     |             |               |               |
|---------------|---------------------|-------------|---------------|---------------|
| 其他资产          | -                   | -           | -             | -             |
| 资产合计          | 96,803,271.61       | -           | -             | 96,803,271.61 |
| 以外币计价的负债      |                     |             |               |               |
| 应付证券清算款       | 3,494,001.55        | -           | -             | 3,494,001.55  |
| 应付赎回款         | 58,914.17           | -           | -             | 58,914.17     |
| 其他负债          | 221.93              | -           | -             | 221.93        |
| 负债合计          | 3,553,137.65        | -           | -             | 3,553,137.65  |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 93,250,133.96       | -           | -             | 93,250,133.96 |
| 项目            | 上年度末<br>2013年12月31日 |             |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                     |             |               |               |
| 银行存款          | 3,984,430.60        | -           | -             | 3,984,430.60  |
| 交易性金融资产       | 84,062,323.63       | -           | -             | 84,062,323.63 |
| 应收证券清算款       | -                   | -           | -             | -             |
| 应收利息          | 14.75               | -           | -             | 14.75         |
| 应收股利          | 78,545.87           | -           | -             | 78,545.87     |
| 应收申购款         | 39,071.19           | -           | -             | 39,071.19     |
| 其他资产          | -                   | -           | -             | -             |
| 资产合计          | 88,164,386.04       | -           | -             | 88,164,386.04 |
| 以外币计价的负债      |                     |             |               |               |
| 以外币计价的负债      | -                   | -           | -             | -             |
| 应付证券清算款       | 2,504,841.49        | -           | -             | 2,504,841.49  |
| 应付赎回款         | 108,725.35          | -           | -             | 108,725.35    |
| 其他负债          | 409.77              | -           | -             | 409.77        |
| 负债合计          | 2,613,976.61        | -           | -             | 2,613,976.61  |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 85,550,409.43       | -           | -             | 85,550,409.43 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                  |                               |                    |
|----|------------------|-------------------------------|--------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                               |                    |
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (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) |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 4,277,520.47                  | 4,277,520.47       |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -4,277,520.47                 | -4,277,520.47      |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于美国大盘成长型股票, 所面临的其



他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于股票及其他权益类证券的比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 85,179,201.33          | 90.55                    | 83,635,182.92            | 94.17                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | 3,682,083.35           | 3.91                     | 427,140.71               | 0.48                  |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 其他            | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 合计            | 88,861,284.68          | 94.46                    | 84,062,323.63            | 94.66                 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（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） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 5,474,708.12                | -                      |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -5,474,708.12               | -                      |

注：于 2013 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 88,861,284.68 元，无属于第二或第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 84,062,323.63 元，无属于第二或第三层级的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 85,179,201.33 | 86.39   |
|   | 其中：普通股            | 85,179,201.33 | 86.39   |
|   | 存托凭证              | -             | -       |
|   | 优先股               | -             | -       |
|   | 房地产信托凭证           | -             | -       |
| 2 | 基金投资              | 3,682,083.35  | 3.73    |
| 3 | 固定收益投资            | -             | -       |
|   | 其中：债券             | -             | -       |
|   | 资产支持证券            | -             | -       |
| 4 | 金融衍生品投资           | -             | -       |
|   | 其中：远期             | -             | -       |
|   | 期货                | -             | -       |
|   | 期权                | -             | -       |
|   | 权证                | -             | -       |
| 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 | 货币市场工具            | -             | -       |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 7,750,399.80  | 7.86    |
| 8 | 其他各项资产            | 1,983,457.26  | 2.01    |
|   | 合计                | 98,595,141.74 | 100.00  |

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 美国     | 85,179,201.33 | 90.55         |
| 合计     | 85,179,201.33 | 90.55         |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 非必需消费品 | 16,336,732.59 | 17.37         |
| 必需消费品  | 7,710,793.37  | 8.20          |
| 能源     | 4,631,113.99  | 4.92          |
| 金融     | 4,809,611.81  | 5.11          |
| 医疗保健   | 9,473,239.06  | 10.07         |
| 工业     | 12,339,126.79 | 13.12         |
| 信息技术   | 23,968,088.61 | 25.48         |
| 原材料    | 3,853,386.78  | 4.10          |

|      |               |       |
|------|---------------|-------|
| 公用事业 | 293,958.51    | 0.31  |
| 电信   | 1,763,149.82  | 1.87  |
| 合计   | 85,179,201.33 | 90.55 |

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准 (GICS) 进行行业分类。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                  | 公司名称(中文) | 证券代码     | 所在证券市场    | 所属国家(地区) | 数量(股)  | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------------------|----------|----------|-----------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | APPLE INC                 | -        | AAPL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 5,604  | 3,204,253.46 | 3.41         |
| 2  | MICROSOFT CORP            | -        | MSFT UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 11,167 | 2,865,136.84 | 3.05         |
| 3  | ORACLE CORP               | -        | ORCL UN  | 纽约证券交易所   | 美国       | 8,795  | 2,193,235.39 | 2.33         |
| 4  | SCHLUMBERGER LTD          | -        | SLB UN   | 纽约证券交易所   | 美国       | 2,846  | 2,065,406.97 | 2.20         |
| 5  | HOME DEPOT INC            | -        | HD UN    | 纽约证券交易所   | 美国       | 4,077  | 2,030,878.81 | 2.16         |
| 6  | UNION PACIFIC CORP        | -        | UNP UN   | 纽约证券交易所   | 美国       | 3,063  | 1,879,891.13 | 2.00         |
| 7  | WHITEWAVE FOODS CO - CL A | -        | BIIB UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 882    | 1,711,114.72 | 1.82         |
| 8  | PRICELINE GROUP INC/      | -        | PCLN UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 209    | 1,546,980.05 | 1.64         |
| 9  | BOEING CO/THE             | -        | BA UN    | 纽约证券交易所   | 美国       | 1,906  | 1,492,056.34 | 1.59         |
| 10 | JOHNSON & JOHNSON         | -        | JNJ UN   | 纽约证券交易所   | 美国       | 2,199  | 1,415,509.35 | 1.50         |
| 11 | GOOGLE INC-CL A           | -        | GOOGL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 388    | 1,395,774.74 | 1.48         |

|    |                         |   |         |                   |    |       |              |      |
|----|-------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|--------------|------|
|    |                         |   |         | 交易所               |    |       |              |      |
| 12 | MCKESSON CORP           | - | MCK UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,204 | 1,379,438.32 | 1.47 |
| 13 | LYONDELLBASELL<br>INDU- | - | LYB UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,286 | 1,373,476.62 | 1.46 |
| 14 | LOWES COS INC           | - | LOW UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,651 | 1,373,314.13 | 1.46 |
| 15 | MASTERCARD<br>INC-CLASS | - | MA UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,977 | 1,345,741.59 | 1.43 |
| 16 | HANESBRANDS<br>INC      | - | HBI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,191 | 1,327,048.46 | 1.41 |
| 17 | LOCKHEED<br>MARTIN CORP | - | LMT UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,323 | 1,308,367.02 | 1.39 |
| 18 | VIACOM<br>INC-CLASS B   | - | VIAB UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,406 | 1,283,919.42 | 1.36 |
| 19 | MEAD JOHNSON<br>NUTRITI | - | MJN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,234 | 1,280,654.74 | 1.36 |
| 20 | AFFILIATED<br>MANAGERS  | - | AMG UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 993   | 1,254,938.62 | 1.33 |
| 21 | FISERV INC              | - | FISV UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,247 | 1,205,081.50 | 1.28 |
| 22 | MACYS INC               | - | M UN    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,306 | 1,180,193.92 | 1.25 |
| 23 | ANADARKO<br>PETROLEUM C | - | APC UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,745 | 1,175,339.54 | 1.25 |
| 24 | CATERPILLAR<br>INC      | - | CAT UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,750 | 1,170,093.36 | 1.24 |
| 25 | WHITEWAVE<br>FOODS CO   | - | WWAV UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,662 | 1,127,678.66 | 1.20 |
| 26 | GOOGLE INC-CL C         | - | GOOG UW | 纳斯达               | 美国 | 317   | 1,122,047.74 | 1.19 |

|    |                         |   |          |                   |    |       |              |      |
|----|-------------------------|---|----------|-------------------|----|-------|--------------|------|
|    |                         |   |          | 克证券<br>交易所        |    |       |              |      |
| 27 | DELPHI<br>AUTOMOTIVE PL | - | DLPH UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,552 | 1,079,351.74 | 1.15 |
| 28 | LEVEL 3<br>COMMUNICATIO | - | LVLT UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,991 | 1,078,246.27 | 1.15 |
| 29 | COMCAST<br>CORP-CLASS A | - | CMCSA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,098 | 1,023,214.58 | 1.09 |
| 30 | LENNOX<br>INTERNATIONAL | - | LII UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,803 | 993,644.65   | 1.06 |
| 31 | OWENS-ILLINOIS<br>INC   | - | OI UN    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,528 | 965,066.19   | 1.03 |
| 32 | RR DONNELLEY &<br>SONS  | - | RRD UW   | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 8,735 | 911,510.25   | 0.97 |
| 33 | HARRIS CORP             | - | HRS UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,893 | 882,279.22   | 0.94 |
| 34 | SAFEWAY INC             | - | SWY UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,130 | 872,615.94   | 0.93 |
| 35 | CBRE GROUP INC<br>- A   | - | CBG UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,152 | 818,507.48   | 0.87 |
| 36 | AMGEN INC               | - | AMGN UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 978   | 712,284.18   | 0.76 |
| 37 | FLEETCOR<br>TECHNOLOGIE | - | FLT UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 874   | 708,760.72   | 0.75 |
| 38 | CELGENE CORP            | - | CELG UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,320 | 697,491.25   | 0.74 |
| 39 | SANMINA CORP            | - | SANM UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,951 | 693,936.04   | 0.74 |
| 40 | VERIZON<br>COMMUNICATIO | - | VZ UN    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,275 | 684,903.55   | 0.73 |

|    |                         |   |         |                   |    |       |            |      |
|----|-------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 41 | JACK IN THE BOX<br>INC  | - | JACK UW | 纳斯达克<br>证券交<br>易所 | 美国 | 1,854 | 682,612.31 | 0.73 |
| 42 | TIME WARNER INC         | - | TWX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,575 | 680,768.87 | 0.72 |
| 43 | WILEY (JOHN) &<br>SONS- | - | JW/A UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,803 | 672,155.07 | 0.71 |
| 44 | EXXON MOBIL<br>CORP     | - | XOM UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,075 | 665,923.70 | 0.71 |
| 45 | ASPEN<br>TECHNOLOGY INC | - | AZPN UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,311 | 659,767.21 | 0.70 |
| 46 | SANDERSON<br>FARMS INC  | - | SAFM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,097 | 656,063.22 | 0.70 |
| 47 | PEPSICO INC             | - | PEP UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,184 | 650,834.32 | 0.69 |
| 48 | FOSSIL GROUP<br>INC     | - | FOSL UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,010 | 649,521.56 | 0.69 |
| 49 | MONDELEZ<br>INTERNATION | - | MDLZ UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,779 | 643,079.52 | 0.68 |
| 50 | INTEL CORP              | - | INTC UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,379 | 642,420.62 | 0.68 |
| 51 | DINEEQUITY INC          | - | DIN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,312 | 641,680.93 | 0.68 |
| 52 | HEALTHSOUTH<br>CORP     | - | HLS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,903 | 640,694.82 | 0.68 |
| 53 | NORTHROP<br>GRUMMAN COR | - | NOC UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 870   | 640,371.73 | 0.68 |
| 54 | ANIXTER<br>INTERNATIONA | - | AXE UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,030 | 634,182.02 | 0.67 |
| 55 | MERCK & CO.<br>INC.     | - | MRK UN  | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 1,772 | 630,724.76 | 0.67 |

|    |                            |   |         |                   |    |       |            |      |
|----|----------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
|    |                            |   |         | 所                 |    |       |            |      |
| 56 | PHILIP MORRIS<br>INTERN    | - | PM UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,202 | 623,528.57 | 0.66 |
| 57 | TJX COMPANIES<br>INC       | - | TJX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,881 | 615,127.10 | 0.65 |
| 58 | TYSON FOODS<br>INC-CL A    | - | TSN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,641 | 610,007.91 | 0.65 |
| 59 | AMERICAN<br>EXPRESS CO     | - | AXP UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,042 | 608,232.21 | 0.65 |
| 60 | RAYTHEON<br>COMPANY        | - | RTN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,071 | 607,895.10 | 0.65 |
| 61 | GRAPHIC<br>PACKAGING HO    | - | GPK UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,368 | 602,393.58 | 0.64 |
| 62 | INTL BUSINESS<br>MACHIN    | - | IBM UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 538   | 600,041.11 | 0.64 |
| 63 | HARMAN<br>INTERNATIONAL    | - | HAR UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 901   | 595,556.77 | 0.63 |
| 64 | ROCKWELL<br>AUTOMATION     | - | ROK UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 773   | 595,275.28 | 0.63 |
| 65 | L-3<br>COMMUNICATIONS<br>H | - | LLL UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 798   | 592,874.58 | 0.63 |
| 66 | CORELOGIC INC              | - | CLGX UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,090 | 577,208.93 | 0.61 |
| 67 | CARDTRONICS<br>INC         | - | CATM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,749 | 576,430.73 | 0.61 |
| 68 | SOUTHWEST<br>AIRLINES C    | - | LUV UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,475 | 574,293.12 | 0.61 |
| 69 | FIDELITY<br>NATIONAL IN    | - | FIS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,673 | 563,473.55 | 0.60 |
| 70 | CA INC                     | - | CA UW   | 纳斯达               | 美国 | 3,172 | 560,909.43 | 0.60 |



|    |                            |   |         |                   |    |       |            |      |
|----|----------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
|    |                            |   |         | 克证券<br>交易所        |    |       |            |      |
| 71 | BALLY<br>TECHNOLOGIES I    | - | BYI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,384 | 559,637.03 | 0.59 |
| 72 | MYLAN INC                  | - | MYL UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,720 | 545,649.99 | 0.58 |
| 73 | EVERCORE<br>PARTNERS IN    | - | EVR UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,487 | 527,360.67 | 0.56 |
| 74 | CLOROX COMPANY             | - | CLX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 923   | 519,063.74 | 0.55 |
| 75 | PACKAGING CORP<br>OF AM    | - | PKG UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,180 | 519,039.13 | 0.55 |
| 76 | NXP<br>SEMICONDUCTORS<br>N | - | NXPI UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,230 | 500,846.53 | 0.53 |
| 77 | VALERO ENERGY<br>CORP      | - | VLO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,606 | 495,057.98 | 0.53 |
| 78 | WELLS FARGO &<br>CO        | - | WFC UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,479 | 478,295.54 | 0.51 |
| 79 | DELUXE CORP                | - | DLX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,289 | 464,595.59 | 0.49 |
| 80 | ABBVIE INC                 | - | ABBV UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,326 | 460,472.11 | 0.49 |
| 81 | DOVER CORP                 | - | DOV UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 779   | 435,926.19 | 0.46 |
| 82 | TRIMBLE<br>NAVIGATION L    | - | TRMB UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,901 | 432,184.67 | 0.46 |
| 83 | YAHOO! INC                 | - | YHOO UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,869 | 403,980.36 | 0.43 |
| 84 | 3M CO                      | - | MMM UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 458   | 403,647.80 | 0.43 |

|    |                         |   |         |                   |    |       |            |      |
|----|-------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 85 | VISA INC-CLASS<br>A SHA | - | V UN    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 308   | 399,308.60 | 0.42 |
| 86 | EASTMAN<br>CHEMICAL CO  | - | EMN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 732   | 393,411.26 | 0.42 |
| 87 | CBOE HOLDINGS<br>INC    | - | CBOE UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,291 | 390,888.06 | 0.42 |
| 88 | TEAM HEALTH<br>HOLDINGS | - | TMH UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,248 | 383,474.00 | 0.41 |
| 89 | SYNTEL INC              | - | SYNT UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 689   | 364,408.44 | 0.39 |
| 90 | COCA-COLA<br>CO/THE     | - | KO UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,275 | 332,306.58 | 0.35 |
| 91 | MOTOROLA<br>SOLUTIONS I | - | MSI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 769   | 314,976.17 | 0.33 |
| 92 | BROADRIDGE<br>FINANCIAL | - | BR UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,169 | 299,500.83 | 0.32 |
| 93 | REGENERON<br>PHARMACEUT | - | REGN UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 172   | 298,932.80 | 0.32 |
| 94 | ENERGY CORP             | - | ETR UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 582   | 293,958.51 | 0.31 |
| 95 | JONES LANG<br>LASALLE I | - | JLL UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 378   | 293,952.60 | 0.31 |
| 96 | XEROX CORP              | - | XRX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,761 | 287,870.07 | 0.31 |
| 97 | QUALCOMM INC            | - | QCOM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 569   | 277,274.70 | 0.29 |
| 98 | ZOETIS INC              | - | ZTS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,391 | 276,184.24 | 0.29 |
| 99 | TD AMERITRADE<br>HOLDIN | - | AMTD UN | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 1,406 | 271,203.73 | 0.29 |

|     |                         |   |         |                   |    |       |            |      |
|-----|-------------------------|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
|     |                         |   |         | 所                 |    |       |            |      |
| 100 | MATSON INC              | - | MATX UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,627 | 268,684.65 | 0.29 |
| 101 | KROGER CO               | - | KR UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 860   | 261,554.30 | 0.28 |
| 102 | HESS CORP               | - | HES UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 377   | 229,385.80 | 0.24 |
| 103 | PAPA JOHNS INTL<br>INC  | - | PZZA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 867   | 226,128.51 | 0.24 |
| 104 | THERMO FISHER<br>SCIENT | - | TMO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 268   | 194,576.15 | 0.21 |
| 105 | OREILLY<br>AUTOMOTIVE   | - | ORLY UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 182   | 168,643.33 | 0.18 |
| 106 | LAZARD LTD-CL A         | - | LAZ UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 524   | 166,232.90 | 0.18 |
| 107 | ACTIVISION<br>BLIZZARD  | - | ATVI UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,098 | 150,653.77 | 0.16 |
| 108 | KEURIG GREEN<br>MOUNTAI | - | GMCR UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 174   | 133,405.87 | 0.14 |
| 109 | EXPRESS<br>SCRIPTS HOLD | - | ESRX UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 297   | 126,692.37 | 0.13 |
| 110 | FACEBOOK INC-A          | - | FB UW   | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 257   | 106,403.63 | 0.11 |

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)    | 证券代码    | 本期累计买入金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|-------------|---------|--------------|------------------------|
| 1  | ORACLE CORP | ORCL UN | 2,405,499.42 | 2.71                   |

|    |                               |         |              |      |
|----|-------------------------------|---------|--------------|------|
| 2  | UNION PACIFIC CORP            | UNP UN  | 1,968,934.15 | 2.22 |
| 3  | WHITEWAVE FOODS CO - CL A     | WWAV UN | 1,772,363.55 | 2.00 |
| 4  | CONSTELLATION BRANDS<br>INC-A | STZ UN  | 1,766,136.81 | 1.99 |
| 5  | BOEING CO/THE                 | BA UN   | 1,681,597.14 | 1.89 |
| 6  | SPIRIT AIRLINES INC           | SAVE UW | 1,613,487.51 | 1.82 |
| 7  | JOHNSON & JOHNSON             | JNJ UN  | 1,487,622.98 | 1.68 |
| 8  | GOOGLE INC-CL C               | GOOG UW | 1,446,796.88 | 1.63 |
| 9  | LOWES COS INC                 | LOW UN  | 1,417,244.12 | 1.60 |
| 10 | MICROSOFT CORP                | MSFT UW | 1,382,706.87 | 1.56 |
| 11 | LIGAND PHARMACEUTICALS        | LGND UQ | 1,379,698.61 | 1.55 |
| 12 | FISERV INC                    | FISV UW | 1,329,078.57 | 1.50 |
| 13 | LOCKHEED MARTIN CORP          | LMT UN  | 1,308,811.98 | 1.47 |
| 14 | MEAD JOHNSON NUTRITION CO     | MJN UN  | 1,306,836.06 | 1.47 |
| 15 | AFFILIATED MANAGERS GROUP     | AMG UN  | 1,285,837.48 | 1.45 |
| 16 | CATERPILLAR INC               | CAT UN  | 1,231,302.94 | 1.39 |
| 17 | DXP ENTERPRISES INC           | DXPE UW | 1,212,093.76 | 1.36 |
| 18 | LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC    | LVLT UN | 1,159,293.64 | 1.31 |
| 19 | HCA HOLDINGS INC              | HCA UN  | 1,077,996.76 | 1.21 |
| 20 | HARMAN INTERNATIONAL          | HAR UN  | 1,067,264.28 | 1.20 |

## 7.5.2 累计卖出金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                      | 证券代码    | 本期累计卖出金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|-------------------------------|---------|--------------|------------------------|
| 1  | APPLE INC                     | AAPL UW | 2,216,440.75 | 2.50                   |
| 2  | ALTRIA GROUP INC              | MO UN   | 1,913,200.68 | 2.15                   |
| 3  | FACEBOOK INC-A                | FB UW   | 1,862,383.64 | 2.10                   |
| 4  | CONSTELLATION BRANDS<br>INC-A | STZ UN  | 1,724,273.75 | 1.94                   |
| 5  | STARBUCKS CORP                | SBUX UW | 1,650,379.37 | 1.86                   |
| 6  | GENERAL MILLS INC             | GIS UN  | 1,591,749.88 | 1.79                   |
| 7  | SPIRIT AIRLINES INC           | SAVE UW | 1,539,409.07 | 1.73                   |
| 8  | SONOCO PRODUCTS CO            | SON UN  | 1,361,125.91 | 1.53                   |
| 9  | SWIFT TRANSPORTATION CO       | SWFT UN | 1,324,377.40 | 1.49                   |
| 10 | GAP INC/THE                   | GPS UN  | 1,305,959.92 | 1.47                   |
| 11 | CUMULUS MEDIA INC-CL A        | CMLS UW | 1,293,985.53 | 1.46                   |
| 12 | SLM CORP                      | SLM UW  | 1,237,015.34 | 1.39                   |
| 13 | MICRON TECHNOLOGY INC         | MU UW   | 1,220,519.73 | 1.37                   |
| 14 | ENERGIZER HOLDINGS INC        | ENR UN  | 1,218,394.87 | 1.37                   |
| 15 | HCA HOLDINGS INC              | HCA UN  | 1,190,710.22 | 1.34                   |
| 16 | LIGAND PHARMACEUTICALS        | LGND UQ | 1,176,779.12 | 1.33                   |

|    |                              |         |              |      |
|----|------------------------------|---------|--------------|------|
| 17 | INTEL CORP                   | INTC UW | 1,084,029.14 | 1.22 |
| 18 | CITIGROUP INC                | C UN    | 1,046,128.44 | 1.18 |
| 19 | DXP ENTERPRISES INC          | DXPE UW | 1,031,080.29 | 1.16 |
| 20 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | AIG UN  | 996,580.82   | 1.12 |

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 67,765,532.34 |
| 卖出收入（成交）总额 | 68,398,111.57 |

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 项“买入成本”、“卖出收入”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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.7 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

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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  | iShares Russell 2000 Growth ETF | ETF 基金 | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors              | 1,751,034.70 | 1.86          |
| 2  | ISHARES RUSSELL 1000 GROW       | ETF 基金 | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors              | 1,750,594.47 | 1.86          |
| 3  | BLDRS EUROPE 100 ADR INDE       | ETF 基金 | 交易型开放式 | Invesco PowerShares Capital Mgmt LLC | 180,454.18   | 0.19          |

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只基金。

## 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   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | 80,470.19    |
| 4  | 应收利息    | 411.95       |
| 5  | 应收申购款   | 1,902,575.12 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
|    | 合计      | 1,983,457.26 |

### 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

| 份额级别                            | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |            |               |            |
|---------------------------------|------------------|---------------|--------------|------------|---------------|------------|
|                                 |                  |               | 机构投资者        |            | 个人投资者         |            |
|                                 |                  |               | 持有份额         | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 嘉实美国成<br>长股票型证<br>券投资基金-<br>人民币 | 2,643            | 18,812.08     | 1,317,919.33 | 2.65%      | 48,402,401.94 | 97.35%     |
| 嘉实美国成<br>长股票型证<br>券投资基金-        | 192              | 27,671.85     | -            | 0.00%      | 5,312,994.56  | 100.00%    |

|      |       |           |              |       |               |        |
|------|-------|-----------|--------------|-------|---------------|--------|
| 美元现汇 |       |           |              |       |               |        |
| 合计   | 2,835 | 19,412.10 | 1,317,919.33 | 2.39% | 53,715,396.50 | 97.61% |

注：(1) 嘉实美国成长-人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长-人民币份额占嘉实美国成长-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长-人民币份额占嘉实美国成长-人民币总份额比例；

(2) 嘉实美国成长-美元：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长-美元份额占嘉实美国成长-美元总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长-美元份额占嘉实美国成长-美元总份额比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                 | 持有份额总数（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 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 211,510.31 | 0.43%    |
|                  | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 433.26     | 0.01%    |
|                  | 合计                   | 211,943.57 | 0.39%    |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |
|---------------------------|---------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2013年6月14日）基金份额总额 | 430,245,997.74      | 7,592,329.66         |
| 本报告期期初基金份额总额              | 49,277,647.12       | 4,824,220.62         |
| 本报告期基金总申购份额               | 21,423,416.96       | 3,121,431.58         |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 20,980,742.81       | 2,632,657.64         |

|              |               |              |
|--------------|---------------|--------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | -             | -            |
| 本报告期期末基金份额总额 | 49,720,321.27 | 5,312,994.56 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

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

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 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 |    |
| 德意志证券亚洲有限公司<br>Deutsche Securities Asia Limited       | -      | 91,518,662.28 | 67.21%       | 75,355.75 | 69.50%     | -  |
| 瑞士银行有限公司 UBS Securities Asia Limited                  | -      | 44,645,947.30 | 32.79%       | 33,077.22 | 30.50%     | -  |
| 瑞士信贷（香港）有限公司<br>Credit Suisse (Hong Kong) Limited     | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 花旗环球金融亚洲有限公司<br>Citigroup Global Markets Asia Limited | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 麦格理资本证券股份有限公司<br>Macquarie Securities Group           | -      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：基金管理人根据研究服务、交易服务、销售服务、投资策略服务、市场及后台服务等评价指标选择交易券商，并与被选择的交易券商签订协议，通知基金托管人。严格遵守监管规定和与经纪商签订的协议，按照市场惯例确定佣金费率。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 基金交易          |              |
|--|---------------|--------------|
|  | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 |
| 德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited | 11,281,642.21 | 45.43%       |

|   |               |        |
|---|---------------|--------|
| 瑞士银行有限公司 UBS Securities<br>Asia Limited | 13,549,131.28 | 54.57% |
|---|---------------|--------|

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                 | 法定披露日期          |
|----|--|------------------------|-----------------|
| 1  | 嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票 ( QDII ) 2014 年 1 月 20 日暂停申购赎回业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 1 月 16 日 |
| 2  | 嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票 ( QDII ) 2014 年 2 月 17 日暂停申购赎回业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 2 月 13 日 |
| 3  | 嘉实基金管理有限公司关于增加北京银行为嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额代销机构并开展定投业务的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 2 月 18 日 |
| 4  | 嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票 ( QDII ) 2014 年 4 月 18 日暂停申购赎回业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 4 月 16 日 |
| 5  | 关于增加苏州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 4 月 17 日 |
| 6  | 关于增加和讯信息科技有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 4 月 28 日 |
| 7  | 关于增加上海银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 5 月 5 日  |
| 8  | 嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票 ( QDII ) 2014 年 5 月 26 日暂停申购赎回业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2014 年 5 月 22 日 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实美国成长股票型证券投资基金公告的各项原稿。

## 11.2 存放地点

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

## 11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2014 年 8 月 25 日