

嘉实优化红利股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

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：2015 年 8 月 29 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 2015 年 8 月 26 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。

根据基金管理人 2015 年 8 月 3 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，嘉实优化红利股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实优化红利混合型证券投资基金。

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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 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	82,804,110.61 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	32,823,522.41
本期利润	23,547,537.95
加权平均基金份额本期利润	0.4846
本期加权平均净值利润率	32.07%
本期基金份额净值增长率	73.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	34,492,197.48
期末可供分配基金份额利润	0.4166
期末基金资产净值	122,429,197.92
期末基金份额净值	1.479
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	111.19%

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	-10.96%	2.85%	-4.36%	3.39%	-6.60%	-0.54%
过去三个月	25.30%	2.40%	21.76%	2.60%	3.54%	-0.20%
过去六个月	73.25%	2.00%	45.92%	2.19%	27.33%	-0.19%
过去一年	125.15%	1.59%	121.00%	1.72%	4.15%	-0.13%

过去三年	111.19%	1.32%	107.80%	1.44%	3.39%	-0.12%
自基金合同生效起至今	111.19%	1.31%	107.85%	1.43%	3.34%	-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：

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

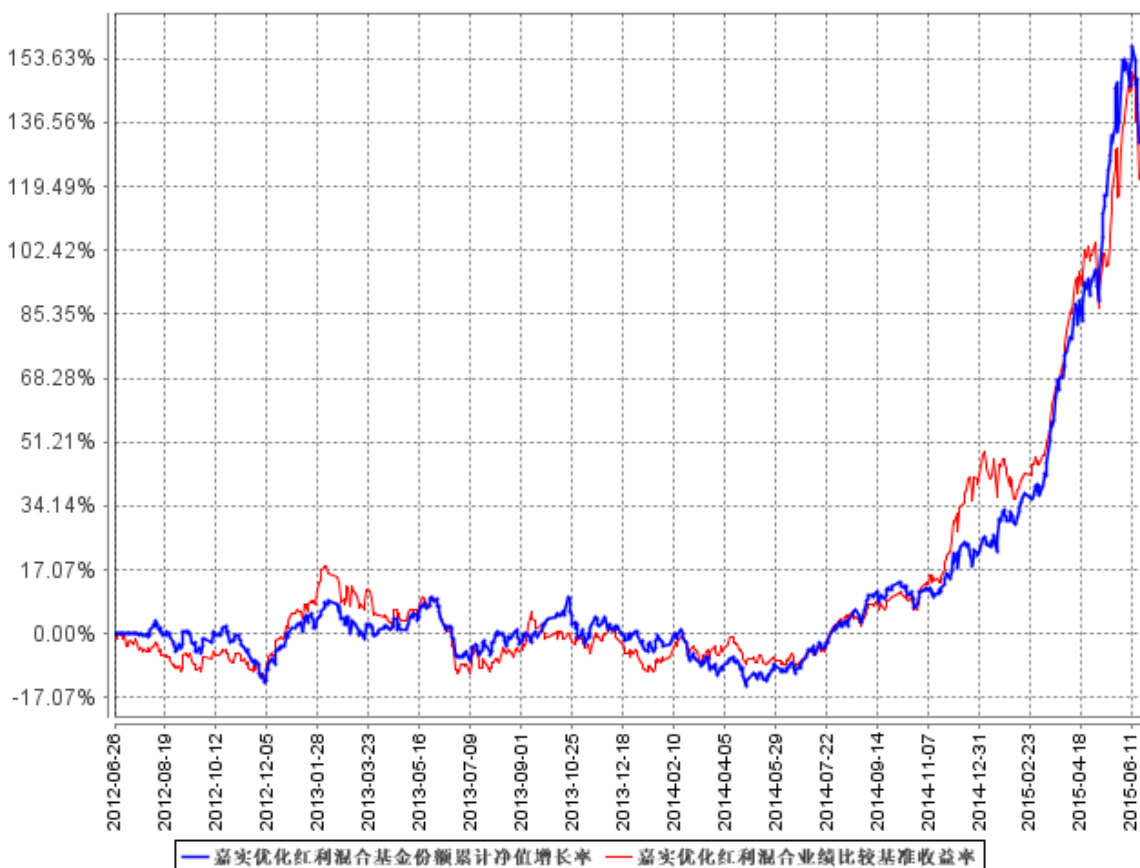
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中证红利指数收益率}(t) + 5\% \times \text{上证国债指数收益率}(t)$$

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

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

嘉实优化红利混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实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 2015 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: 2015 年 3 月 12 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》, 翟琳琳女士不再担任本基金基金经理; 聘请董理先生担任本基金基金经理职务。

§ 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 2015 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、73 只开放式证券投资基金, 具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、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、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币。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		
董理	本基金、嘉实增长混合基金经理	2015 年 3 月 12 日	-	6 年	2008 年加入嘉实基金管理有限公司研究部，曾任股票分析师一职。具有基金从业资格，中国国籍。
翟琳琳	本基金基金经理，嘉实价值优势股票、嘉实新收益混合、嘉实稳健混合基金经理	2014 年 2 月 7 日	2015 年 3 月 12 日	9 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。

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。

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，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，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

本报告期内，市场在经历了一季度小盘股相对平稳的表现后，风格更加极致，题材股和互联网相关股票成为 4-6 月主攻方向，主要推手是自 3 月开始加速的资金流入。但我们也看到，自 5 月开始，市场的资金流出速度也开始迅速提升，同时在市场交易额屡创新高的情况下，增量资金对市场影响边际效果在减弱。综合当前经济基本面相对疲弱的现状，市场资金牛市的特征明显，在资金面二阶导数出现拐点的情况下，我们 6 月开始对市场转为看空。

回顾本组合的操作，在大类资产配置上，报告期内基金在 1-5 月维持了较高的仓位，在六月基于对市场系统性风险的担忧进行了大规模降仓。在板块选择上集中配置了传媒、环保、互联网、航空、农业等板块，总体上前五个月我们基于资金牛市思维，选择的都是未来想象空间大，短期难以证伪，或者基本面改善明显的板块，追求估值弹性是我们前五个月的主要策略。而六月开始看空后，组合大幅调整了配置结构，加大了家电等消费品的配置比例，对于一些估值合理的白马成长我们也更为看好，组合整体结构更加均衡，这在 6 月下旬开始的大跌中为组合减少了不少的损失。

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 1.479 元；本报告期基金份额净值增长率为 73.25%，业绩比较基准收益率为 45.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股市依然是目前最有吸引力的资产，宏观流动性也依然宽裕。在市场持续快速的杀跌后，政策底也已经非常清晰。我们认为在市场累积了大量的获利资金后，去杠杆化带动的获利盘回吐将持续较长过程，未来市场行情将趋于分化，部分前期涨幅巨大的题材股将面临长期的减持压力，而估值合理的优质成长股、估值便宜的消费类价值股将成为资金流入的方向。

同时我们也看到了此次空前的救市力度，我们应该清醒的认识到，国家救的并非投资人，而

是金融系统的稳定以及借助股市要完成的经济结构转型。因此，对于救市政策抱有坚定信心的同时，我们也要认清方向，不应对市场抱有不合理的预期。在行业选择上我们看后需求成长空间确定的旅游、环保、先进制造及符合经济结构转型方向的服务型行业。同时基于未来通胀可能随着货币宽松重新上行，我们看好受益于通胀同时供需结构改善的农业。

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，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 20 日发布《嘉实优化红利股票型证券投资基金 2014 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.749 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2015 年 4 月 18 日发布《嘉实优化红利股票型证券投资基金 2015 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 3 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 3.035 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(3) 本基金的基金管理人于 2015 年 7 月 16 日发布《嘉实优化红利股票型证券投资基金 2015 年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 6 月 30 日，每 10 份基金份额发放现金红利 3.750 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,726,725.05	3,022,145.83
结算备付金		1,678,929.33	911,485.38
存出保证金		66,797.64	16,457.03
交易性金融资产	6.4.7.2	93,478,789.88	16,287,112.90
其中：股票投资		93,478,789.88	16,287,112.90
基金投资		-	-
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	7,925.40	903.60
应收股利		-	-
应收申购款		3,986,683.68	83,267.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		149,945,850.98	20,321,372.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		9,921,337.54	-
应付赎回款		16,290,532.64	67,571.21
应付管理人报酬		196,772.11	28,722.85
应付托管费		32,795.37	4,787.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	737,119.06	50,783.99
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	338,096.34	350,108.62
负债合计		27,516,653.06	501,973.81
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	82,804,110.61	16,254,823.17
未分配利润	6.4.7.10	39,625,087.31	3,564,575.20
所有者权益合计		122,429,197.92	19,819,398.37
负债和所有者权益总计		149,945,850.98	20,321,372.18

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.479 元，基金份额总额 82,804,110.61 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至
-----	-----	-----------------------	----------------------------

		2015 年 6 月 30 日	2014 年 6 月 30 日
一、收入		25,881,752.24	-2,201,922.79
1.利息收入		64,120.20	94,902.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,120.20	13,309.98
债券利息收入		-	29,279.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	52,312.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益		34,876,587.57	-1,576,012.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,514,580.52	-1,754,880.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	684.00
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	362,007.05	178,183.44
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-9,275,984.46	-749,471.22
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	217,028.93	28,658.89
减：二、费用		2,334,214.29	637,740.06
1. 管理人报酬		531,372.70	255,019.90
2. 托管费		88,562.13	42,503.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,523,486.16	154,391.02
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	190,793.30	185,825.85
三、利润总额		23,547,537.95	-2,839,662.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润		23,547,537.95	-2,839,662.85

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	16,254,823.17	3,564,575.20	19,819,398.37

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,547,537.95	23,547,537.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	66,549,287.44	33,530,264.59	100,079,552.03
其中: 1.基金申购款	193,104,193.50	87,549,029.37	280,653,222.87
2.基金赎回款	-126,554,906.06	-54,018,764.78	-180,573,670.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-21,017,290.43	-21,017,290.43
五、期末所有者权益(基金净值)	82,804,110.61	39,625,087.31	122,429,197.92
项目	上年度可比期间 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

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> 王红 </u>	<u> 常旭 </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 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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除

外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

本报告期所采用的其他会计政策、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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	531,372.70	255,019.90
其中：支付销售机构的客户维护费	105,189.34	69,229.86

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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	88,562.13		42,503.29	

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（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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（2015年6月30日）及上年度末（2014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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	50,726,725.05	56,500.61	3,913,391.82	9,284.31

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（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（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。

6.4.5 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300487	蓝晓科技	2015 年 6 月 24 日	2015 年 7 月 2 日	未上市	14.83	14.83	500	7,415.00	7,415.00	-

6.4.5.1.2 受限证券类别：债券

期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的债券。

6.4.5.1.3 受限证券类别：其他

期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项停牌	62.50	2015 年 8 月 5 日	69.20	70,000	5,283,042.56	4,375,000.00	-
300056	三维丝	2015 年 6 月 5 日	重大事项停牌	35.79	-	-	180,000	7,355,519.00	6,442,200.00	-
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	220,000	3,245,000.00	3,379,200.00	-

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（2015 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（2015 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	93,478,789.88	62.34
	其中：股票	93,478,789.88	62.34
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	52,405,654.38	34.95
7	其他各项资产	4,061,406.72	2.71
	合计	149,945,850.98	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	14,554,776.17	11.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,261,300.00	25.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,402,913.71	13.40
G	交通运输、仓储和邮政业	3,379,200.00	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,695,200.00	8.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,003,200.00	4.90
L	租赁和商务服务业	7,672,200.00	6.27
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	3,510,000.00	2.87
S	综合	-	-
	合计	93,478,789.88	76.35

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	000998	隆平高科	400,000	10,840,000.00	8.85
2	000028	国药一致	99,921	7,445,113.71	6.08
3	000333	美的集团	180,000	6,710,400.00	5.48
4	300274	阳光电源	211,400	6,462,498.00	5.28
5	300056	三维丝	180,000	6,442,200.00	5.26
6	002285	世联行	280,000	6,003,200.00	4.90
7	600037	歌华有线	190,000	5,985,000.00	4.89
8	601888	中国国旅	70,000	4,641,000.00	3.79
9	000963	华东医药	70,000	4,375,000.00	3.57
10	002241	歌尔声学	120,000	4,308,000.00	3.52

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	24,983,090.75	126.05
2	600570	恒生电子	24,082,122.30	121.51
3	600037	歌华有线	23,251,246.46	117.32
4	002285	世联行	20,350,004.48	102.68
5	000998	隆平高科	20,266,391.45	102.26
6	300376	易事特	16,464,688.35	83.07
7	002715	登云股份	15,043,280.16	75.90

8	601021	春秋航空	13,358,337.55	67.40
9	600687	刚泰控股	13,285,523.89	67.03
10	601058	赛轮金宇	12,591,334.00	63.53
11	300274	阳光电源	11,689,250.56	58.98
12	002612	朗姿股份	10,806,420.60	54.52
13	002241	歌尔声学	10,750,302.00	54.24
14	002192	*ST 路翔	10,567,230.00	53.32
15	300133	华策影视	10,308,908.50	52.01
16	600029	南方航空	9,621,099.00	48.54
17	000028	国药一致	9,387,623.58	47.37
18	601888	中国国旅	9,275,346.48	46.80
19	300325	德威新材	9,145,746.29	46.15
20	002467	二六三	8,578,608.98	43.28
21	601318	中国平安	8,378,126.08	42.27
22	300271	华宇软件	8,202,060.58	41.38
23	002048	宁波华翔	8,170,975.93	41.23
24	600055	华润万东	7,867,236.00	39.69
25	002696	百洋股份	7,716,104.79	38.93
26	300056	三维丝	7,714,102.00	38.92
27	600885	宏发股份	7,504,253.39	37.86
28	600993	马应龙	7,314,683.75	36.91
29	601601	中国太保	7,063,474.00	35.64
30	300163	先锋新材	6,775,033.00	34.18
31	300124	汇川技术	6,366,138.91	32.12
32	000002	万科A	6,220,314.99	31.38
33	601166	兴业银行	6,024,702.00	30.40
34	002101	广东鸿图	5,992,402.19	30.24
35	601788	光大证券	5,415,249.00	27.32
36	000963	华东医药	5,283,042.56	26.66
37	002494	华斯股份	5,127,003.36	25.87
38	600048	保利地产	5,015,439.00	25.31
39	600435	北方导航	4,952,625.00	24.99
40	600050	中国联通	4,928,800.00	24.87
41	600325	华发股份	4,857,548.20	24.51
42	002400	省广股份	4,765,101.17	24.04
43	000673	当代东方	4,759,005.58	24.01

44	600527	江南高纤	4,749,731.00	23.97
45	000540	中天城投	4,733,918.42	23.89
46	002041	登海种业	4,634,247.29	23.38
47	000158	常山股份	4,623,500.00	23.33
48	600651	飞乐音响	4,611,664.50	23.27
49	000961	中南建设	4,591,717.00	23.17
50	002654	万润科技	4,587,613.00	23.15
51	300418	昆仑万维	4,499,140.00	22.70
52	600115	东方航空	4,392,860.20	22.16
53	300176	鸿特精密	4,270,339.61	21.55
54	002469	三维工程	4,265,478.20	21.52
55	002702	海欣食品	4,170,708.84	21.04
56	600511	国药股份	3,909,721.20	19.73
57	603718	海利生物	3,898,390.00	19.67
58	000651	格力电器	3,775,055.99	19.05
59	000710	天兴仪表	3,676,125.99	18.55
60	600036	招商银行	3,638,650.46	18.36
61	002614	蒙发利	3,471,593.15	17.52
62	600446	金证股份	3,327,882.00	16.79
63	600030	中信证券	3,267,504.00	16.49
64	601111	中国国航	3,245,000.00	16.37
65	002411	九九久	3,176,467.00	16.03
66	002672	东江环保	3,150,989.28	15.90
67	601633	长城汽车	3,139,101.08	15.84
68	000524	岭南控股	3,123,847.63	15.76
69	600000	浦发银行	3,082,100.00	15.55
70	300313	天山生物	2,928,250.96	14.77
71	002358	森源电气	2,881,307.45	14.54
72	600856	长百集团	2,868,994.00	14.48
73	000049	德赛电池	2,849,684.77	14.38
74	603588	高能环境	2,755,287.00	13.90
75	002271	东方雨虹	2,735,922.92	13.80
76	000858	五粮液	2,718,516.00	13.72
77	600177	雅戈尔	2,700,178.00	13.62
78	002081	金螳螂	2,653,100.02	13.39
79	600015	华夏银行	2,617,000.00	13.20

80	600323	瀚蓝环境	2,560,968.00	12.92
81	600477	杭萧钢构	2,559,523.62	12.91
82	002341	新纶科技	2,452,247.00	12.37
83	002098	浔兴股份	2,189,216.00	11.05
84	600153	建发股份	2,140,000.00	10.80
85	002086	东方海洋	1,871,995.00	9.45
86	300304	云意电气	1,739,480.72	8.78
87	300003	乐普医疗	1,580,872.99	7.98
88	000024	招商地产	1,567,372.02	7.91
89	300012	华测检测	1,504,407.00	7.59
90	002572	索菲亚	1,439,918.27	7.27
91	002563	森马服饰	1,339,228.96	6.76
92	300210	森远股份	1,311,062.55	6.62
93	000099	中信海直	1,233,239.00	6.22
94	600887	伊利股份	1,229,398.02	6.20
95	000690	宝新能源	1,175,100.00	5.93
96	000625	长安汽车	1,140,195.88	5.75
97	600138	中青旅	1,089,144.22	5.50
98	002228	合兴包装	1,083,000.00	5.46
99	002609	捷顺科技	1,079,759.00	5.45
100	002253	川大智胜	1,074,742.00	5.42
101	002311	海大集团	1,029,401.96	5.19
102	002124	天邦股份	983,522.83	4.96
103	002727	一心堂	982,719.94	4.96
104	002436	兴森科技	962,036.00	4.85
105	600585	海螺水泥	912,507.00	4.60
106	300115	长盈精密	858,450.56	4.33
107	000932	华菱钢铁	826,340.00	4.17
108	002410	广联达	814,986.94	4.11
109	002477	雏鹰农牧	797,766.99	4.03
110	002202	金风科技	774,150.00	3.91
111	600079	人福医药	771,006.56	3.89
112	002002	鸿达兴业	690,880.00	3.49
113	300306	远方光电	638,735.98	3.22
114	002648	卫星石化	632,672.00	3.19
115	000513	丽珠集团	608,008.00	3.07

116	000797	中国武夷	594,273.00	3.00
117	002007	华兰生物	556,089.00	2.81
118	000786	北新建材	532,062.00	2.68
119	600833	第一医药	513,174.00	2.59
120	603019	中科曙光	494,145.00	2.49
121	002030	达安基因	484,334.00	2.44
122	002020	京新药业	483,218.00	2.44
123	300175	朗源股份	471,458.30	2.38
124	000902	新洋丰	463,974.86	2.34
125	002250	联化科技	450,884.00	2.27
126	600559	老白干酒	450,000.00	2.27
127	600525	长园集团	438,194.00	2.21
128	600081	东风科技	424,372.95	2.14
129	000887	中鼎股份	422,037.51	2.13
130	300049	福瑞股份	419,250.00	2.12
131	300164	通源石油	417,146.50	2.10
132	000876	新希望	414,570.00	2.09
133	300336	新文化	407,740.00	2.06
134	600271	航天信息	399,418.00	2.02

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	600570	恒生电子	21,222,604.48	107.08
2	000333	美的集团	20,483,566.57	103.35
3	600037	歌华有线	17,917,388.72	90.40
4	002285	世联行	17,616,227.57	88.88
5	300376	易事特	16,086,270.79	81.16
6	601021	春秋航空	16,019,823.14	80.83
7	002715	登云股份	15,919,044.74	80.32
8	600687	刚泰控股	13,592,515.23	68.58
9	002612	朗姿股份	12,724,822.34	64.20
10	601058	赛轮金宇	11,446,270.00	57.75
11	002467	二六三	11,208,426.94	56.55
12	600029	南方航空	10,944,426.27	55.22

13	002048	宁波华翔	10,254,627.08	51.74
14	000998	隆平高科	9,147,487.10	46.15
15	601318	中国平安	8,871,836.43	44.76
16	300325	德威新材	8,642,061.00	43.60
17	300271	华宇软件	8,520,186.93	42.99
18	600885	宏发股份	8,448,365.51	42.63
19	300133	华策影视	7,816,423.32	39.44
20	600055	华润万东	7,400,733.44	37.34
21	300124	汇川技术	7,256,007.35	36.61
22	601601	中国太保	7,017,127.10	35.41
23	300418	昆仑万维	7,000,807.00	35.32
24	002192	*ST 路翔	6,372,287.14	32.15
25	000158	常山股份	6,371,314.15	32.15
26	000002	万 科 A	6,304,020.18	31.81
27	000961	中南建设	6,285,736.63	31.72
28	300163	先锋新材	6,269,558.00	31.63
29	600527	江南高纤	6,088,440.00	30.72
30	601166	兴业银行	5,612,128.00	28.32
31	300274	阳光电源	5,597,504.75	28.24
32	600050	中国联通	5,533,067.71	27.92
33	002696	百洋股份	5,508,817.61	27.80
34	600435	北方导航	5,370,750.40	27.10
35	600048	保利地产	5,359,701.41	27.04
36	002241	歌尔声学	5,281,266.20	26.65
37	601788	光大证券	5,223,718.00	26.36
38	600651	飞乐音响	5,181,993.00	26.15
39	603718	海利生物	5,156,052.00	26.02
40	000540	中天城投	5,106,351.72	25.76
41	002101	广东鸿图	4,982,345.05	25.14
42	000673	当代东方	4,970,418.58	25.08
43	600325	华发股份	4,943,469.00	24.94
44	002494	华斯股份	4,860,646.45	24.52
45	002654	万润科技	4,732,120.50	23.88
46	300176	鸿特精密	4,681,339.00	23.62
47	600115	东方航空	4,650,095.49	23.46
48	601888	中国国旅	4,500,416.38	22.71
49	000651	格力电器	4,314,290.45	21.77
50	000710	天兴仪表	4,253,630.82	21.46

51	002469	三维工程	4,181,855.00	21.10
52	002702	海欣食品	3,922,796.40	19.79
53	002672	东江环保	3,615,825.00	18.24
54	600856	长百集团	3,572,606.03	18.03
55	600036	招商银行	3,484,736.00	17.58
56	002081	金螳螂	3,417,220.46	17.24
57	600993	马应龙	3,413,593.99	17.22
58	002614	蒙发利	3,409,211.60	17.20
59	002411	九九久	3,361,598.90	16.96
60	601633	长城汽车	3,299,440.57	16.65
61	603588	高能环境	3,291,555.34	16.61
62	600000	浦发银行	3,047,553.00	15.38
63	002271	东方雨虹	3,021,634.50	15.25
64	600030	中信证券	2,940,101.00	14.83
65	600177	雅戈尔	2,870,951.50	14.49
66	600477	杭萧钢构	2,859,942.74	14.43
67	000049	德赛电池	2,851,192.00	14.39
68	000524	岭南控股	2,737,655.00	13.81
69	002341	新纶科技	2,675,477.00	13.50
70	600153	建发股份	2,645,734.93	13.35
71	002358	森源电气	2,576,872.48	13.00
72	002098	浔兴股份	2,560,616.00	12.92
73	600323	瀚蓝环境	2,428,372.00	12.25
74	600015	华夏银行	2,400,220.00	12.11
75	300313	天山生物	2,395,358.12	12.09
76	002086	东方海洋	1,823,564.82	9.20
77	600511	国药股份	1,817,018.05	9.17
78	002563	森马服饰	1,641,025.16	8.28
79	000625	长安汽车	1,636,446.17	8.26
80	300003	乐普医疗	1,608,614.01	8.12
81	000024	招商地产	1,583,856.29	7.99
82	000028	国药一致	1,560,645.21	7.87
83	002572	索菲亚	1,552,178.00	7.83
84	600081	东风科技	1,524,150.45	7.69
85	002400	省广股份	1,505,492.85	7.60
86	300012	华测检测	1,490,111.46	7.52
87	300304	云意电气	1,367,346.11	6.90
88	000690	宝新能源	1,317,338.00	6.65

89	300073	当升科技	1,266,708.99	6.39
90	600887	伊利股份	1,265,490.00	6.39
91	000099	中信海直	1,247,389.00	6.29
92	600446	金证股份	1,238,708.00	6.25
93	002253	川大智胜	1,215,102.02	6.13
94	002228	合兴包装	1,212,773.00	6.12
95	600660	福耀玻璃	1,212,645.00	6.12
96	002041	登海种业	1,211,368.00	6.11
97	300210	森远股份	1,202,082.00	6.07
98	600138	中青旅	1,172,273.80	5.91
99	000975	银泰资源	1,151,979.29	5.81
100	002727	一心堂	1,071,830.00	5.41
101	002609	捷顺科技	1,034,107.00	5.22
102	300115	长盈精密	1,001,777.64	5.05
103	002311	海大集团	949,068.00	4.79
104	000932	华菱钢铁	940,993.00	4.75
105	002410	广联达	931,045.00	4.70
106	002477	雏鹰农牧	910,700.00	4.59
107	002436	兴森科技	889,455.00	4.49
108	002124	天邦股份	865,172.88	4.37
109	600079	人福医药	857,545.78	4.33
110	600585	海螺水泥	843,511.28	4.26
111	002202	金风科技	840,000.00	4.24
112	300306	远方光电	839,961.00	4.24
113	002002	鸿达兴业	792,912.43	4.00
114	000963	华东医药	790,508.50	3.99
115	300175	朗源股份	738,113.00	3.72
116	000758	中色股份	703,414.00	3.55
117	000902	新洋丰	680,700.00	3.43
118	000059	*ST 华锦	674,400.00	3.40
119	000401	冀东水泥	666,949.51	3.37
120	002007	华兰生物	629,250.00	3.17
121	002648	卫星石化	627,745.35	3.17
122	000513	丽珠集团	591,374.40	2.98
123	002030	达安基因	577,581.80	2.91
124	000797	中国武夷	564,217.40	2.85
125	600217	*ST 秦岭	558,360.04	2.82
126	600270	外运发展	552,799.80	2.79

127	000786	北新建材	550,697.22	2.78
128	600833	第一医药	545,817.00	2.75
129	601992	金隅股份	535,750.98	2.70
130	600559	老白干酒	521,035.00	2.63
131	603019	中科曙光	509,566.80	2.57
132	300049	福瑞股份	482,178.00	2.43
133	002020	京新药业	480,538.50	2.42
134	000887	中鼎股份	469,409.57	2.37
135	601199	江南水务	464,346.33	2.34
136	600525	长园集团	438,228.99	2.21
137	002250	联化科技	436,415.05	2.20
138	000876	新希望	429,877.00	2.17
139	300336	新文化	428,439.76	2.16
140	600271	航天信息	424,600.00	2.14
141	300164	通源石油	418,000.00	2.11
142	600166	福田汽车	412,201.23	2.08

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	617,686,776.70
卖出股票收入（成交）总额	565,733,695.78

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

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,797.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,925.40
5	应收申购款	3,986,683.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	4,061,406.72

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300056	三维丝	6,442,200.00	5.26	重大事项停牌

2	000963	华东医药	4,375,000.00	3.57	重大事项停牌
---	--------	------	--------------	------	--------

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,135	20,025.18	9,947,277.17	12.01%	72,856,833.44	87.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	210,353.63	0.25%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年6月26日）基金份额总额	588,616,310.91
本报告期期初基金份额总额	16,254,823.17
本报告期基金总申购份额	193,104,193.50
减：本报告期基金总赎回份额	126,554,906.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	82,804,110.61

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

2015 年 3 月 12 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》，翟琳女士不再担任本基金基金经理；聘请董理先生担任本基金基金经理职务。

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
海通证券股份有限公司	2	378,804,825.85	32.02%	265,166.66	32.02%	-
东北证券股份有限公司	2	228,140,997.13	19.28%	159,699.65	19.28%	-
民生证券股份有限公司	2	173,037,929.17	14.63%	121,126.54	14.63%	-
安信证券股份有限公司	3	110,317,633.87	9.33%	77,222.37	9.32%	-
方正证券股份有限公司	3	96,628,211.19	8.17%	67,640.63	8.17%	-
广发证券股份有限公司	5	91,656,675.00	7.75%	64,159.68	7.75%	-
长江证券股份有限公司	1	87,914,203.13	7.43%	61,540.95	7.43%	-
国信证券股份有限公司	1	16,526,267.14	1.40%	11,568.41	1.40%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	4	-	-	-	-	-

股份有限公司						
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	2	-	-	-	-	-

有限公司						
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券（浙 江）有限责任公 司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增 1 个

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日