

# 嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金 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。

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	嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实新收益混合
基金主代码	000870
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 10 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	908,295,585.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，追求长期稳健的绝对收益。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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

### 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
--------------------	---

网址	
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	965,655,230.11
本期利润	938,431,102.12
加权平均基金份额本期利润	0.7150
本期加权平均净值利润率	50.70%
本期基金份额净值增长率	81.36%
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	735,282,358.01
期末可供分配基金份额利润	0.8095
期末基金资产净值	1,643,577,943.23
期末基金份额净值	1.810
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	81.00%

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) 上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	-11.06%	2.93%	0.28%	0.01%	-11.34%	2.92%
过去三个月	30.69%	2.73%	0.83%	0.01%	29.86%	2.72%
过去六个月	81.36%	2.36%	1.72%	0.01%	79.64%	2.35%
自基金合同生效起至今	81.00%	2.23%	1.95%	0.01%	79.05%	2.22%

注：本基金业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+1%

上述“一年期银行定期存款利率”是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。

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：

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

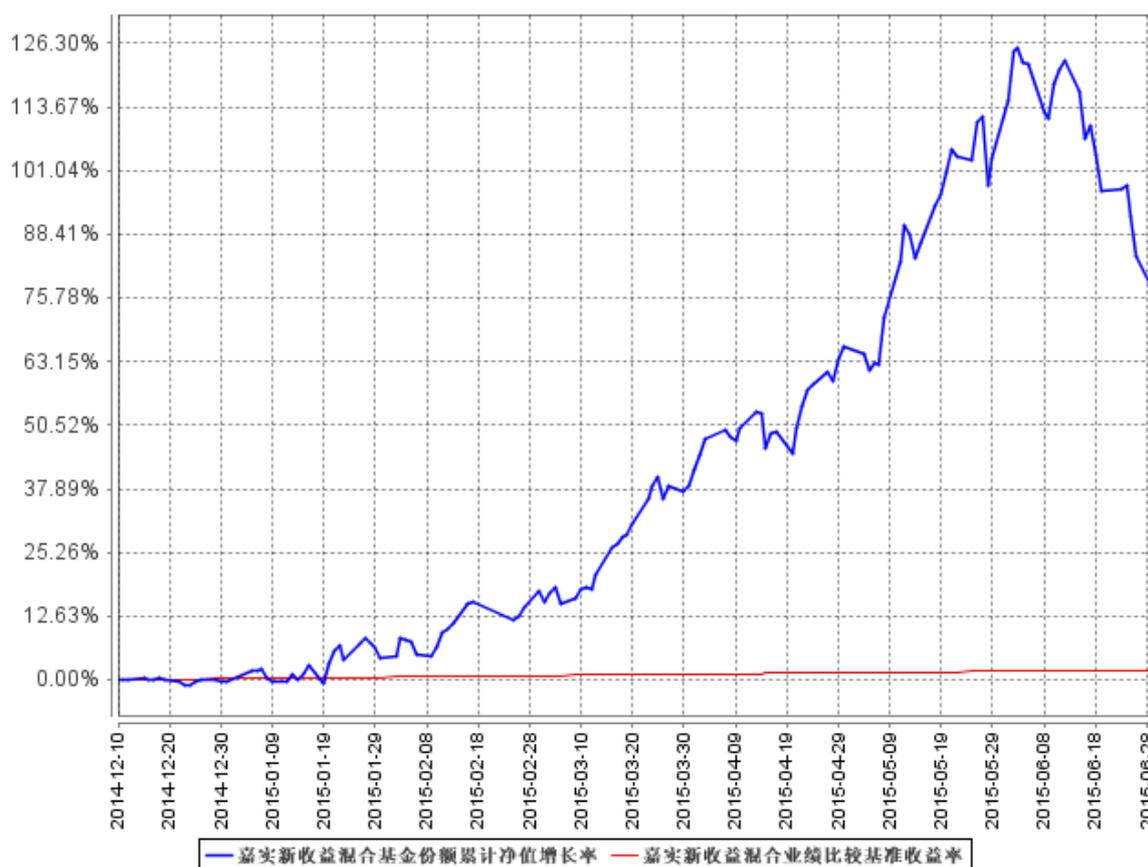
$$\text{Return}(t)=100\% \times (\text{一年期银行定期存款税后利率}+1\%)/365$$

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

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

嘉实新收益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：嘉实新收益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

(2014 年 12 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日)

注 1：本基金基金合同生效日 2014 年 12 月 10 日至报告期末未满 1 年。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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

注 2：2015 年 1 月 13 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实新收益混合基金经理变更的公告》，

增聘陈少平女士担任本基金基金经理职务,与现任基金经理翟琳琳女士共同管理本基金。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于 1999 年 3 月 25 日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 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		
陈少平	本基金、嘉实研究精选股票基金经理，公司研究总监	2015 年 1 月 13 日	-	12 年	曾任海问投资咨询公司研究员，泰达宏利基金管理公司研究部总监、基金经理。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司。硕士研究生，具有基金从业资格。
翟琳琳	本基金、嘉实价值优势、嘉实稳健混合基金经理	2014 年 12 月 10 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）基金经理翟琳琳的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理陈少平的任职日期指公司作出决定后公告之日，离任日期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、《嘉实新收益灵活配置混合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

1 季度宏观经济数据继续恶化，宏观经济复苏的迹象不明显，但是政府稳定经济的态度渐渐明朗，托经济和保持宽松性态度明确，为市场奠定了良好的基础。由于传统地产链条缺乏投资机会，资金追逐新兴产业的机会，这些行业呈现较好的投资机会。本基金在年初重点配置了以互联网金融为代表的创业板，取得了较好的收益。

2 季度经济继续弱势，地产等经济数据的底部仍然不明朗，前半段市场在宽松的流动性背景、杠杆资金带动市场追逐以创新为代表的创业板股票，相关公司涨幅巨大。后半段由于流动性拐点出现，市场在清查配资等负面情绪下，出现了恐慌性下跌。本基金前期继续配置代表创新方向的创业板股票，在下跌早期较早的进行了风险的防范，大幅降低了仓位，取得了较好的业绩。

### 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 1.810 元；本报告期基金份额净值增长率为 81.36%，业绩比较基准收益率为 1.72%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着去年底以来的流动性持续宽松，地产数据也有一定的企稳迹象，经济在三季度见底的可能性较大，宏观经济短期内持续下滑的危险有所缓解，但远未消失。工业活动仍然比较弱势。

资金层面看，市场的流动性仍然充裕，但是环比趋势减弱。在二季度末大幅下跌之后，短期看市场反弹可能性在增强。考虑到流动性边际影响减弱，下半年市场可能会出现分化，前期涨幅较大的题材股面临一定的压力，市场可能会更加关注业绩确定性更强、低估值的消费、电力、金融等。以及随着经济的企稳，部分产业链条可能出现较好的景气上升机会，包括养殖等行业。

基于对经济和流动性 的判断，本基金将在谨慎的仓位上，更关注精选个股和行业，关注国企改革、传媒、医药、环保新能源、军工以及电力等板块。

## 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

根据本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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”）在对嘉实新收益灵活配置混合型（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：嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,029,258,604.51	1,522,714,334.54
结算备付金		19,801,209.44	-
存出保证金		1,627,456.92	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,084,772,075.55	1,535,855,159.28
其中：股票投资		1,084,772,075.55	1,535,855,159.28
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	187,546.93	312,517.12
应收股利		-	-
应收申购款		167,447.35	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,135,814,340.70	3,058,882,010.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 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		316,082,672.62	754,193,265.07
应付赎回款		167,675,498.62	-
应付管理人报酬		1,974,867.98	1,326,107.82
应付托管费		394,973.61	265,221.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,681,089.47	1,176,679.86

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	427,295.17	-
负债合计		492,236,397.47	756,961,274.34
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	908,295,585.22	2,306,555,251.00
未分配利润	6.4.7.10	735,282,358.01	-4,634,514.40
所有者权益合计		1,643,577,943.23	2,301,920,736.60
负债和所有者权益总计		2,135,814,340.70	3,058,882,010.94

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.810 元，基金份额总额 908,295,585.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金

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 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		971,253,006.17
1.利息收入		1,233,361.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,233,361.02
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益		973,213,888.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	971,230,061.96
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	1,983,826.60
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-27,224,127.99
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.17	24,029,884.58
<b>减：二、费用</b>		32,821,904.05
1. 管理人报酬		9,101,756.78
2. 托管费		1,820,351.38
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	21,718,522.86

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	181,273.03
<b>三、利润总额</b>		938,431,102.12
减：所得税费用		-
<b>四、净利润</b>		938,431,102.12

注：本基金合同生效日为 2014 年 12 月 10 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金

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（基金净值）	2,306,555,251.00	-4,634,514.40	2,301,920,736.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	938,431,102.12	938,431,102.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,398,259,665.78	-198,514,229.71	-1,596,773,895.49
其中：1.基金申购款	1,923,179,446.95	1,249,885,202.86	3,173,064,649.81
2.基金赎回款	-3,321,439,112.73	-1,448,399,432.57	-4,769,838,545.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	908,295,585.22	735,282,358.01	1,643,577,943.23

注：本基金合同生效日为 2014 年 12 月 10 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
赵学军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王红

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
常旭

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]1123号《关于准予嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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》和《嘉实新收益灵活配置混合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人民币2,306,141,508.29元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第775号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年12月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,306,555,251.00份基金份额,其中认购资金利息折合413,742.71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《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括通知存款、协议存款、定期存款等)、大额存单等固定收益类资产以及现金,以及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规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

### 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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净

值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（3）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

（4）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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

### 6.4.5.3 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 关联方关系

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
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易各关联方

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

## 6.4.7 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。

### 6.4.7.1 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)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	9,101,756.78
其中：支付销售机构的客户维护费	3,074,441.96

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 1.0% 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 × 1.0% / 当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,820,351.38

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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

### 6.4.7.3 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），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。

### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.7.4.1 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），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。

#### 6.4.7.4.2 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。

### 6.4.7.5 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	1,029,258,604.51	1,104,001.12	-	-
------	------------------	--------------	---	---

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。

#### 6.4.7.6 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），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.8 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1.1 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
300147	香雪制药	2015年6月18日	2015年7月2日	配股未上市	10.46	30.80	130,650	1,366,599.00	4,024,020.00	-

##### 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2015年6月30日），本基金未持有流通受限的债券。

##### 6.4.8.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015年6月30日），本基金未持有流通受限的其他证券。

##### 6.4.8.2 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
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项停牌	36.49	-	-	55,800	1,810,521.00	2,036,142.00	-
000150	宜华健康	2015年4月15日	重大事项停牌	55.87	-	-	209	3,662.77	11,676.83	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项停牌	30.36	2015年7月2日	30.78	1,113,726	37,866,300.46	33,812,721.36	-
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项停牌	19.13	-	-	399,782	4,725,179.32	7,647,829.66	-
000963	华东	2015	重大	62.50	2015	69.20	67,800	3,796,991.51	4,237,500.00	-

	医药	年 6 月 26 日	事项停牌		年 8 月 5 日						
002020	京新药业	2015 年 4 月 16 日	重大事项停牌	29.44	2015 年 8 月 10 日	26.10	151,400	2,596,762.43	4,457,216.00		-
002296	辉煌科技	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	21.12	2015 年 8 月 24 日	18.98	1,044,700	36,705,054.20	22,064,064.00		-
002329	皇氏集团	2015 年 6 月 12 日	重大事项停牌	57.76	2015 年 8 月 13 日	62.53	1,149,264	42,493,686.39	66,381,488.64		-
002649	博彦科技	2015 年 6 月 1 日	重大事项停牌	61.61	2015 年 8 月 18 日	75.43	135,654	9,304,235.00	8,357,642.94		-
002683	宏大爆破	2015 年 5 月 11 日	重大事项停牌	35.48	-	-	21,800	579,902.00	773,464.00		-
300056	三维丝	2015 年 6 月 5 日	重大事项停牌	35.79	-	-	1,150,463	44,522,143.41	41,175,070.77		-
300094	国联水产	2015 年 6 月 29 日	重大事项停牌	31.14	-	-	1,772,622	61,337,492.40	55,199,449.08		-
300113	顺网科技	2015 年 5 月 5 日	重大事项停牌	53.60	2015 年 8 月 6 日	51.93	430,600	26,705,317.39	23,080,160.00		-
300142	沃森生物	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	37.63	-	-	2	51.62	75.26		-
300162	雷曼光电	2015 年 4 月 15 日	重大事项停牌	23.40	2015 年 7 月 20 日	21.06	52,750	1,291,189.42	1,234,350.00		-
300212	易华录	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	59.94	2015 年 7 月 13 日	54.00	37	2,716.20	2,217.78		-
300228	富瑞特装	2015 年 6 月 24 日	重大事项停牌	79.76	2015 年 7 月 30 日	81.82	34,143	2,309,529.49	2,723,245.68		-
300291	华录百纳	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	37.76	2015 年 7 月 13 日	34.65	15,800	418,651.98	596,608.00		-
300310	宜通世纪	2015 年 6 月 16 日	重大事项停牌	47.52	-	-	854,749	31,230,156.85	40,617,672.48		-

300377	赢时胜	2015年5月20日	重大事项停牌	145.51	2015年7月15日	168.99	297,390	47,690,604.84	43,273,218.90	-
300418	昆仑万维	2015年5月5日	重大事项停牌	144.78	2015年8月6日	140.09	69,000	10,383,614.00	9,989,820.00	-
600074	保千里	2015年6月26日	重大事项停牌	20.92	-	-	147,400	1,956,977.84	3,083,608.00	-
600139	西部资源	2015年6月8日	重大事项停牌	22.12	-	-	28	452.39	619.36	-

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 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。

#### 6.4.8.3.2 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	1,084,772,075.55	50.79
	其中：股票	1,084,772,075.55	50.79
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	1,049,059,813.95	49.12
7	其他各项资产	1,982,451.20	0.09
	合计	2,135,814,340.70	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	156,897,723.58	9.55
B	采矿业	31,323,558.68	1.91
C	制造业	587,430,230.48	35.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,086,115.10	0.31
E	建筑业	9,554,491.26	0.58
F	批发和零售业	4,276,674.20	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,940,352.64	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	210,435,868.02	12.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	57,316,581.55	3.49
L	租赁和商务服务业	8,714,400.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	3,621,608.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	3,519,545.00	0.21
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	2,654,927.04	0.16
S	综合	-	-
	合计	1,084,772,075.55	66.00

## 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	002329	皇氏集团	1,149,264	66,381,488.64	4.04
2	300094	国联水产	1,772,622	55,199,449.08	3.36
3	000998	隆平高科	1,844,886	49,996,410.60	3.04
4	000858	五粮液	1,566,200	49,648,540.00	3.02
5	300186	大华农	1,105,249	48,188,856.40	2.93

6	002405	四维图新	1,075,977	47,127,792.60	2.87
7	300377	赢时胜	297,390	43,273,218.90	2.63
8	300056	三维丝	1,150,463	41,175,070.77	2.51
9	300310	宜通世纪	854,749	40,617,672.48	2.47
10	002192	*ST 路翔	1,275,688	39,176,378.48	2.38

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	600570	恒生电子	164,333,765.75	7.14
2	002657	中科金财	150,705,919.26	6.55
3	000998	隆平高科	137,966,672.85	5.99
4	600446	金证股份	137,593,871.47	5.98
5	300226	上海钢联	119,023,514.75	5.17
6	000712	锦龙股份	104,294,295.48	4.53
7	002189	利达光电	101,784,871.10	4.42
8	300059	东方财富	101,265,031.10	4.40
9	000732	泰禾集团	95,398,977.10	4.14
10	002405	四维图新	93,179,859.52	4.05
11	600096	云天化	91,739,141.83	3.99
12	300378	鼎捷软件	84,449,678.31	3.67
13	002450	康得新	75,800,401.12	3.29
14	300274	阳光电源	75,311,450.51	3.27
15	002192	*ST 路翔	73,625,150.46	3.20
16	300155	安居宝	71,776,301.96	3.12
17	300431	暴风科技	71,737,360.86	3.12
18	600565	迪马股份	70,856,119.79	3.08
19	300212	易华录	70,084,328.12	3.04
20	300195	长荣股份	68,875,261.71	2.99
21	300094	国联水产	68,631,739.79	2.98
22	002329	皇氏集团	68,032,090.65	2.96
23	601058	赛轮金宇	66,573,274.48	2.89
24	000792	盐湖股份	65,812,589.40	2.86

25	600571	信雅达	65,524,272.98	2.85
26	002469	三维工程	64,747,964.70	2.81
27	600118	中国卫星	64,554,364.28	2.80
28	000858	五粮液	60,466,826.29	2.63
29	600153	建发股份	60,106,125.40	2.61
30	002439	启明星辰	59,842,103.74	2.60
31	002153	石基信息	59,173,408.15	2.57
32	600185	格力地产	58,780,891.37	2.55
33	300377	赢时胜	58,640,483.41	2.55
34	300295	三六五网	55,716,244.56	2.42
35	300124	汇川技术	55,707,732.19	2.42
36	600588	用友网络	55,595,786.68	2.42
37	300352	北信源	53,996,663.20	2.35
38	000710	天兴仪表	52,257,075.50	2.27
39	002100	天康生物	51,212,135.14	2.22
40	300284	苏交科	51,202,743.51	2.22
41	002501	利源精制	51,169,059.48	2.22
42	600271	航天信息	49,581,985.92	2.15
43	300056	三维丝	48,669,521.64	2.11
44	000800	一汽轿车	48,312,813.63	2.10
45	300367	东方网力	48,197,588.14	2.09
46	300186	大华农	47,264,128.72	2.05
47	002280	联络互动	47,151,201.68	2.05
48	300118	东方日升	47,148,773.71	2.05
49	601633	长城汽车	46,671,914.82	2.03
50	600873	梅花生物	46,481,850.27	2.02
51	000997	新大陆	46,403,899.36	2.02

#### 7.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	002657	中金金财	215,839,711.86	9.38
2	600446	金证股份	199,002,005.70	8.65
3	600570	恒生电子	189,936,092.44	8.25

4	300059	东方财富	185,148,526.10	8.04
5	300378	鼎捷软件	140,020,039.69	6.08
6	000712	锦龙股份	122,245,532.19	5.31
7	300226	上海钢联	108,004,372.19	4.69
8	002189	利达光电	104,700,363.01	4.55
9	300274	阳光电源	97,304,045.02	4.23
10	600096	云天化	94,116,691.62	4.09
11	000998	隆平高科	93,884,882.43	4.08
12	002501	利源精制	87,741,390.49	3.81
13	600571	信雅达	86,516,675.48	3.76
14	000002	万科A	81,090,228.92	3.52
15	300155	安居宝	79,911,502.83	3.47
16	600271	航天信息	78,789,594.96	3.42
17	601633	长城汽车	76,885,379.81	3.34
18	300010	立思辰	76,882,532.44	3.34
19	300004	南风股份	72,477,549.60	3.15
20	002280	联络互动	71,554,905.88	3.11
21	600588	用友网络	69,653,887.54	3.03
22	300212	易华录	69,104,138.46	3.00
23	300431	暴风科技	68,670,867.10	2.98
24	601288	农业银行	68,124,087.50	2.96
25	601688	华泰证券	67,993,186.23	2.95
26	601398	工商银行	66,406,758.15	2.88
27	600118	中国卫星	66,191,642.69	2.88
28	002153	石基信息	65,766,148.81	2.86
29	300195	长荣股份	65,429,265.52	2.84
30	300348	长亮科技	64,921,619.43	2.82
31	600565	迪马股份	64,663,501.47	2.81
32	002439	启明星辰	64,633,660.34	2.81
33	002469	三维工程	64,385,874.93	2.80
34	600153	建发股份	63,810,856.90	2.77
35	600685	中船防务	63,607,355.05	2.76
36	000550	江铃汽车	62,723,457.54	2.72
37	601818	光大银行	62,046,605.60	2.70
38	300352	北信源	61,457,316.81	2.67
39	002271	东方雨虹	60,540,764.17	2.63
40	300284	苏交科	59,923,737.37	2.60
41	000792	盐湖股份	59,433,963.46	2.58

42	600185	格力地产	59,399,324.43	2.58
43	000732	泰禾集团	58,261,386.53	2.53
44	300124	汇川技术	57,199,061.42	2.48
45	601788	光大证券	57,137,181.89	2.48
46	002446	盛路通信	57,129,530.59	2.48
47	300295	三六五网	56,858,280.14	2.47
48	000800	一汽轿车	56,698,945.54	2.46
49	002405	四维图新	56,465,482.57	2.45
50	002100	天康生物	55,125,824.90	2.39
51	000401	冀东水泥	54,637,638.98	2.37
52	300085	银之杰	54,173,741.55	2.35
53	600549	厦门钨业	53,342,019.66	2.32
54	600873	梅花生物	52,305,337.19	2.27
55	002604	龙力生物	52,076,068.98	2.26
56	000997	新大陆	52,009,478.05	2.26
57	600270	外运发展	50,671,397.55	2.20
58	600547	山东黄金	50,492,362.38	2.19
59	002279	久其软件	50,289,200.92	2.18
60	300367	东方网力	48,675,956.56	2.11
61	300166	东方国信	47,921,709.76	2.08
62	300022	吉峰农机	47,869,635.63	2.08
63	300011	鼎汉技术	47,076,151.76	2.05
64	601006	大秦铁路	46,488,911.62	2.02
65	300118	东方日升	46,133,338.18	2.00
66	002450	康得新	45,981,983.41	2.00

### 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	7,311,087,791.32
卖出股票收入（成交）总额	8,706,176,809.02

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，在本报告编制日以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	1,627,456.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	187,546.93
5	应收申购款	167,447.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,982,451.20

**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	002329	皇氏集团	66,381,488.64	4.04	重大事项停牌
2	300094	国联水产	55,199,449.08	3.36	重大事项停牌
3	300377	赢时胜	43,273,218.90	2.63	重大事项停牌
4	300056	三维丝	41,175,070.77	2.51	重大事项停牌
5	300310	宜通世纪	40,617,672.48	2.47	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
21,711	41,835.73	282,257,951.90	31.08%	626,037,633.32	68.92%

**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	1,484,516.10	0.16%

**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（2014 年 12 月 10 日）基金份额总额	2,306,555,251.00
本报告期期初基金份额总额	2,306,555,251.00
本报告期基金总申购份额	1,923,179,446.95
减：本报告期基金总赎回份额	3,321,439,112.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	908,295,585.22

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （1）基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 1 月 13 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实新收益混合基金经理变更的公告》，聘请陈少平女士担任本基金基金经理职务，与现任基金经理翟琳琳女士共同管理本基金。

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**

报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金的审计机构。

**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	
国泰君安证券股份有限公司	3	2,504,206,432.81	15.64%	1,752,959.71	15.64%	新增
海通证券股份有限公司	2	2,502,218,038.90	15.62%	1,751,561.75	15.62%	新增
华泰证券股份有限公司	4	2,448,515,949.66	15.29%	1,713,961.15	15.29%	新增
东方证券股份有限公司	2	2,145,090,202.51	13.39%	1,501,575.07	13.39%	新增
齐鲁证券有限公司	1	1,475,279,816.51	9.21%	1,032,704.06	9.21%	新增
长江证券股份有限公司	1	842,808,068.83	5.26%	589,970.65	5.26%	新增
广发证券股份有限公司	6	835,923,703.21	5.22%	585,150.22	5.22%	新增
安信证券股份有限公司	3	826,826,942.09	5.16%	578,778.88	5.16%	新增
长城证券有限责任公司	3	426,842,883.11	2.67%	298,793.49	2.67%	新增
方正证券股份有限公司	2	337,107,914.38	2.10%	235,975.56	2.10%	新增

民生证券股份 有限公司	2	332,328,432.92	2.07%	232,630.58	2.07%	新增
华创证券有限 责任公司	2	304,491,703.96	1.90%	213,146.98	1.90%	新增
中国银河证券 股份有限公司	2	235,619,994.32	1.47%	164,935.96	1.47%	新增
中信建投证券 股份有限公司	2	224,700,463.96	1.40%	157,290.33	1.40%	新增
中国民族证券 有限责任公司	1	198,131,409.80	1.24%	138,691.96	1.24%	新增
东吴证券有限 责任公司	1	183,132,138.77	1.14%	128,192.48	1.14%	新增
兴业证券股份 有限公司	3	119,725,354.60	0.75%	83,807.75	0.75%	新增
中国国际金融 有限公司	2	72,948,551.00	0.46%	51,063.99	0.46%	新增
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增

平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	新增
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
申万宏源证券 有限公司	2	-	-	-	-	新增
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	新增
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
中信证券（浙 江）有限责任公 司	1	-	-	-	-	新增
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	新增
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	新增

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日