

# 嘉实成长收益证券投资基金 2016 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：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 24 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。

本基金已根据香港《证券及期货条例》第 104 条在香港获得证券及期货事务监察委员会认可及可供在香港向公众销售。证券及期货事务监察委员会认可不代表对本基金的推荐或认许，亦不代表其对本基金的商业利弊或其表现作出保证。此并不意指本基金适合所有投资者，亦并非认许本基金适合任何特定投资者或投资者类别。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实成长收益证券投资基金
基金简称	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 5 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	4,473,648,122.88 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金，在获取稳定的现金收益的基础上，积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现“稳定收益”的目标；同时通过实施“行业优选、积极轮换”的策略，实现“资本增值”目标。
业绩比较基准	上证 A 股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的贝塔值不超过 0.75。在此前提下，本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证 A 股指数涨幅的 65%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证 A 股指数跌幅的 55%。

注：据《关于嘉实成长收益证券投资基金增设 H 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》，本基金自 2016 年 1 月 7 日起增加 H 类份额，报告期末基金份额为 0。

### 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-158,950,469.37
本期利润	-199,373,666.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0467
本期加权平均净值利润率	-4.21%
本期基金份额净值增长率	-5.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,751,671,035.49
期末可供分配基金份额利润	0.6151
期末基金资产净值	5,401,017,991.87
期末基金份额净值	1.2073
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	954.19%

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。(4) 本基金自 2016 年 1 月 7 日起增加 H 类基金份额类别，仅在中国香港地区销售。

### 3.2 基金净值表现

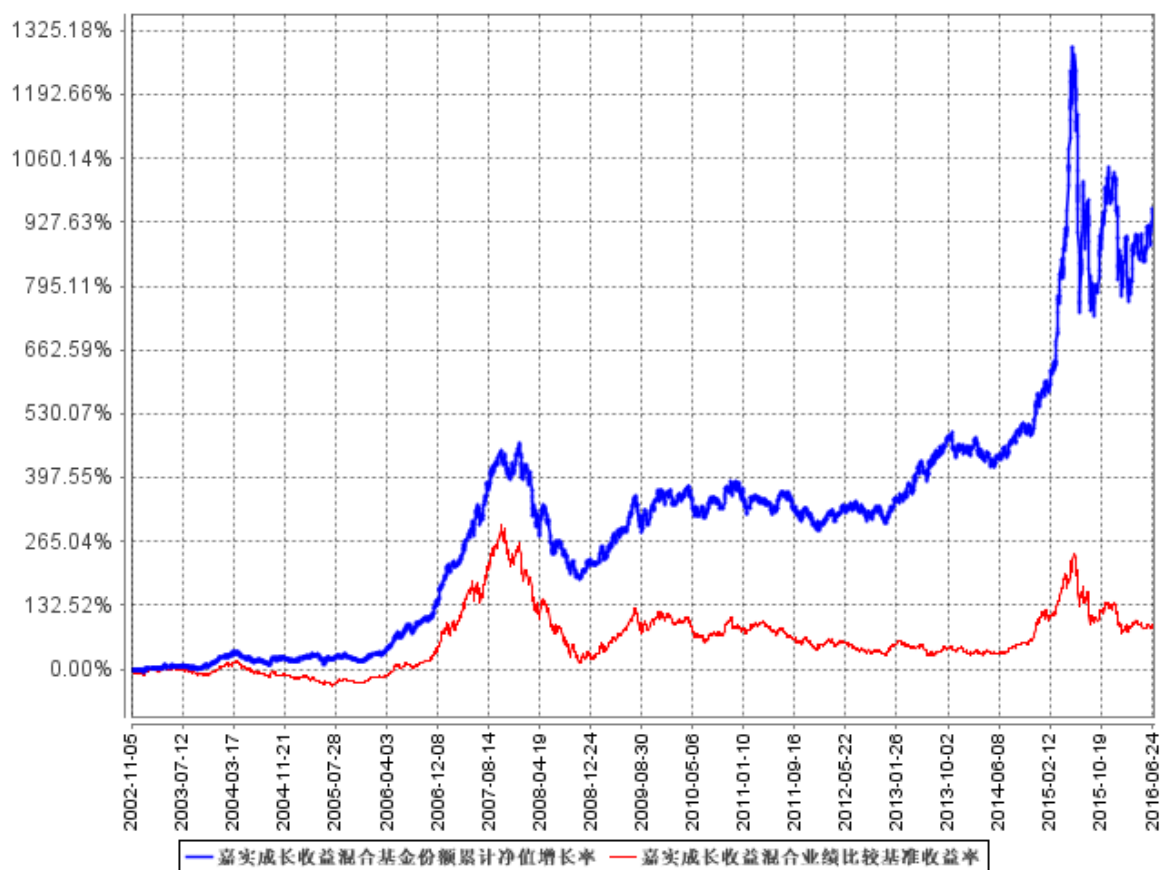
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.21%	1.29%	0.45%	1.02%	4.76%	0.27%

过去三个月	7.24%	1.30%	-2.45%	1.10%	9.69%	0.20%
过去六个月	-5.52%	1.97%	-17.22%	1.93%	11.70%	0.04%
过去一年	-4.57%	2.26%	-31.55%	2.30%	26.98%	-0.04%
过去三年	108.72%	1.68%	48.05%	1.79%	60.67%	-0.11%
自基金合同生效起至今	954.19%	1.30%	91.61%	1.69%	862.58%	-0.39%

### 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

#### 嘉实成长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：嘉实成长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

(2002年11月5日至2016年6月30日)

注：按基金合同规定，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十八条（二）投资范围和（六）投资组合比例限制的约定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%；（5）本基金的股票资产中至

少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 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、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实

新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。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		
邵秋涛	本基金基金经理，嘉实领先成长股票基金经理	2013 年 6 月 7 日	-	18 年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券，从事行业研究工作，先后担任研究员、高级研究员；2006 年 12 月加盟嘉实基金管理有限公司，历任公司高级研究员、投资经理，现任成长策略组组长。金融硕士，具有基金从业资格，澳大利亚籍。
谢泽林	本基金基金经理、新机遇混合基金经理	2015 年 12 月 31 日	-	6 年	2009 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司研究部，曾任行业研究员一职。硕士研究生，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、《嘉实成长收益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 1 次，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

国内经济弱复苏在二季度逐步被证伪，经济增速贴地运行，民间投资失速，通胀预期减弱，A 股市场年初经历大幅下跌之后维持低位震荡。但另一方面，新兴产业仍保持蓬勃发展的态势，如集成电路、新能源汽车、军工信息化、小间距 LED 显示、人工智能等，经济呈现结构性机会，A 股市场也相应呈现结构性机会，上述新兴产业的股票表现相对较好。除此以外，传统产业如养殖、黄金由于价格上涨带来板块的阶段性机会，传统产业中一些业绩持续增长、估值相对较低的优质企业，股价表现也相对较好。

本基金主要以新兴产业作为投资主线，在信息安全、国防军工、新技术、新材料、新消费、新服务、改革转型等领域挖掘长线投资机会，并且较好控制净值回撤幅度，上半年净值增长率为 -5.52%，跑赢大盘指数，为持有人取得较好的回报率。

#### 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 1.2073 元；本报告期基金份额净值增长率为 -5.52%，业绩比较基准收益率为 -17.22%。

### 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，国内经济增速预计维持平稳，民间投资增速虽下降、政府投资可能会更加积极，但整体加杆杠的空间不大。经济增长的主要内生动力，一方面来自新兴产业的持续拉动，另一方面需要改革的进一步推进。下半年 A 股市场整体可能以震荡行情为主，但预计仍不缺乏结构性机会。

中国正处于从中等收入国家向中高收入国家发展的过程中，技术创新、工业升级、消费升级等层出不穷，这个过程会不断诞生新蓝筹，而这些新蓝筹在成长初期总会遭到较多质疑。我们关

注工业互联网、人工智能、大数据、信息安全、航空航天、新能源、新材料等新兴产业，通过不断的深度研究和调研，积极寻找新兴产业中具备核心技术的优质企业、理想远大的优秀企业家，以期获得较好的中长期投资回报。

我们关注国家对改革的进一步推进，改革将带来垄断利润的进一步释放，将带来经济效率的进一步提升。国企改革、供给侧改革，特别是国有的科技企业混改，将带来投资机会。我们也关注传统产业中一些景气底部反转的行业，把握阶段性的博弈机会。

鉴于今年震荡的行情，我们的选股会遵循更加严格的标准，综合权衡估值与成长性的匹配，在股票仓位上会更加灵活把握，争取为投资人实现更好的投资回报。

#### 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、合规部等部门负责人组成，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 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实成长收益证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.1000 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 报告期内本基金未实施利润分配。

(3) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为 -199,373,666.77 以及本基金基金合同（二十二（三）收益分配原则）“3、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配”，因此报告期内本基金未实施利润分配，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”）在嘉实成长收益证券投资基金（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：嘉实成长收益证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	531,823,481.33	501,212,929.41
结算备付金		3,542,767.10	4,776,938.02
存出保证金		1,319,786.63	1,498,642.82
交易性金融资产	6.4.7.2	4,894,380,985.27	4,418,909,812.31
其中：股票投资		3,794,717,985.27	3,316,000,812.31
基金投资		-	-
债券投资		1,099,663,000.00	1,102,909,000.00
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	16,532,581.56	27,133,264.23
应收股利		-	-
应收申购款		6,266,455.43	4,816,935.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,453,866,057.32	4,958,348,522.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		248,977.93	-
应付赎回款		42,886,802.80	13,672,928.10
应付管理人报酬		6,437,337.54	6,195,289.86
应付托管费		1,072,889.61	1,032,548.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,745,857.37	2,041,957.43
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	456,200.20	449,884.14
负债合计		52,848,065.45	23,392,607.86
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,649,346,956.38	2,265,726,865.30
未分配利润	6.4.7.10	2,751,671,035.49	2,669,229,049.32
所有者权益合计		5,401,017,991.87	4,934,955,914.62
负债和所有者权益总计		5,453,866,057.32	4,958,348,522.48

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，嘉实成长收益混合 A 类基金份额净值 1.2073 元，基金份额总额 4,473,648,122.88 份；嘉实成长收益混合 H 类基金份额总额 0.00 份。嘉实成长收益混合基金份额总额合计为 4,473,648,122.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实成长收益证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-149,813,232.04	1,975,164,014.06
1.利息收入		18,452,979.76	20,432,654.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,916,584.82	1,135,203.85
债券利息收入		16,496,599.19	19,228,198.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,795.75	69,252.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-128,996,377.13	2,070,133,170.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-137,592,914.74	2,060,582,549.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,943,014.78	1,666,818.17
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	13,539,552.39	7,883,803.38
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-40,423,197.40	-120,221,257.79
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	1,153,362.73	4,819,447.06
<b>减：二、费用</b>		49,560,434.73	52,835,658.12
1. 管理人报酬		35,316,382.52	33,657,492.20
2. 托管费		5,886,063.77	5,609,582.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	8,118,244.66	13,066,451.28
5. 利息支出		-	254,724.55
其中：卖出回购金融资产支出		-	254,724.55
6. 其他费用	6.4.7.19	239,743.78	247,408.07
<b>三、利润总额</b>		-199,373,666.77	1,922,328,355.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-199,373,666.77	1,922,328,355.94

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实成长收益证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	2,265,726,865.30	2,669,229,049.32	4,934,955,914.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-199,373,666.77	-199,373,666.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	383,620,091.08	321,300,322.63	704,920,413.71
其中：1.基金申购款	967,769,532.07	838,050,993.23	1,805,820,525.30
2.基金赎回款	-584,149,440.99	-516,750,670.60	-1,100,900,111.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-39,484,669.69	-39,484,669.69
五、期末所有者权益(基金净值)	2,649,346,956.38	2,751,671,035.49	5,401,017,991.87
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	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)	2,741,246,373.53	881,007,416.66	3,622,253,790.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,922,328,355.94	1,922,328,355.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-313,308,297.39	48,448,004.81	-264,860,292.58
其中：1.基金申购款	2,422,780,880.89	2,842,217,321.04	5,264,998,201.93
2.基金赎回款	-2,736,089,178.28	-2,793,769,316.23	-5,529,858,494.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-43,804,829.05	-43,804,829.05
五、期末所有者权益(基金净值)	2,427,938,076.14	2,807,978,948.36	5,235,917,024.50

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（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。

#### 6.4.4.2 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	35,316,382.52	33,657,492.20
其中：支付销售机构的客户维护费	2,245,496.03	1,746,898.98

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 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	5,886,063.77	5,609,582.02

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**

单位：人民币元

上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	510,090,000.00	165,311.95

注：本期（2016年1月1日至2016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（2016年1月1日至2016年6月30日）及上年度可比期间（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。

**6.4.4.4.2 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（2016年6月30日）及上年度末（2015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	
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015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	531,823,481.33	1,832,413.41	939,055,621.10	1,058,710.67

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。

**6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本期（2016年1月1日至2016年6月30日）及上年度可比期间（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。

## 6.4.5 期末（2016 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
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

#### 6.4.5.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2016 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债券。

#### 6.4.5.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2016 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
002046	轴研科技	2016年5月9日	重大事项停牌	10.33	2016年8月22日	11.36	6,516,578	71,596,883.67	67,316,250.74	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项停牌	27.47	-	-	1,000,000	25,129,330.89	27,470,000.00	-
300282	汇冠股份	2016年4月21日	重大事项停牌	35.25	2016年7月26日	36.78	196	4,967.32	6,909.00	-
300334	津膜科技	2016年5月19日	重大事项停牌	18.05	-	-	709,912	12,621,311.99	12,813,911.60	-
300353	东土	2016年6月	重大事项	22.09	-	-	10,919,908	191,512,151.52	241,220,767.72	-

	科技	月 23 日	项停牌							
600511	国药股份	2016 年 2 月 18 日	重大事件停牌	27.44	2016 年 8 月 4 日	30.16	1,293,066	58,426,392.35	35,481,731.04	-
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	重大事件停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

### 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（2016 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（2016 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	3,794,717,985.27	69.58
	其中：股票	3,794,717,985.27	69.58
2	固定收益投资	1,099,663,000.00	20.16
	其中：债券	1,099,663,000.00	20.16
	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	535,366,248.43	9.82
7	其他各项资产	24,118,823.62	0.44
	合计	5,453,866,057.32	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	35,315,488.00	0.65
B	采矿业	11,142,196.00	0.21



C	制造业	3,260,830,431.60	60.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,424,574.00	0.36
E	建筑业	10,841,986.88	0.20
F	批发和零售业	74,638,637.24	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	3,703,091.99	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	335,945,182.99	6.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,384,267.57	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	18,848,346.00	0.35
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	11,643,783.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	3,794,717,985.27	70.26

### 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	300342	天银机电	12,714,263	387,276,450.98	7.17
2	300296	利亚德	9,006,216	285,136,798.56	5.28
3	002338	奥普光电	4,068,548	250,012,274.60	4.63
4	300353	东土科技	10,919,908	241,220,767.72	4.47
5	002111	威海广泰	7,934,663	208,602,290.27	3.86
6	002007	华兰生物	6,400,000	200,960,000.00	3.72
7	600038	中直股份	4,443,746	184,326,584.08	3.41
8	002439	启明星辰	6,648,700	171,735,921.00	3.18
9	002281	光迅科技	2,376,814	152,591,458.80	2.83
10	002614	蒙发利	12,084,795	145,138,387.95	2.69

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.jsfund.cn>) 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300342	天银机电	319,664,521.44	6.48
2	300353	东土科技	187,465,844.15	3.80
3	002281	光迅科技	143,516,567.43	2.91
4	002614	蒙发利	123,313,194.83	2.50
5	002426	胜利精密	110,860,818.24	2.25
6	600887	伊利股份	99,257,749.43	2.01
7	600682	南京新百	98,789,043.24	2.00
8	002338	奥普光电	98,631,990.46	2.00
9	600562	国睿科技	86,378,935.80	1.75
10	002649	博彦科技	84,364,928.45	1.71
11	300294	博雅生物	79,613,868.49	1.61
12	300377	赢时胜	75,575,064.02	1.53
13	600038	中直股份	71,562,278.04	1.45
14	600498	烽火通信	71,411,774.53	1.45
15	300302	同有科技	70,962,829.62	1.44
16	600048	保利地产	70,671,294.03	1.43
17	002184	海得控制	67,029,174.43	1.36
18	600702	沱牌舍得	66,469,717.35	1.35
19	601799	星宇股份	62,061,709.52	1.26
20	002023	海特高新	61,980,880.43	1.26

### 7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002253	川大智胜	261,392,242.74	5.30
2	300296	利亚德	155,398,030.15	3.15
3	600887	伊利股份	140,652,665.99	2.85

4	002465	海格通信	107,760,736.84	2.18
5	000892	星美联合	104,139,567.91	2.11
6	300302	同有科技	91,769,568.61	1.86
7	600682	南京新百	91,342,207.15	1.85
8	000733	振华科技	83,990,856.34	1.70
9	603588	高能环境	78,807,887.26	1.60
10	300294	博雅生物	74,253,341.63	1.50
11	002335	科华恒盛	74,083,820.69	1.50
12	600118	中国卫星	72,748,367.75	1.47
13	002649	博彦科技	72,619,192.15	1.47
14	600048	保利地产	70,820,376.97	1.44
15	002739	万达院线	69,022,485.34	1.40
16	002125	湘潭电化	66,757,683.60	1.35
17	002184	海得控制	63,411,702.55	1.28
18	002023	海特高新	51,008,234.30	1.03
19	600230	*ST 沧大	49,781,207.16	1.01
20	002643	万润股份	48,546,087.77	0.98

### 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	3,603,955,234.47
卖出股票收入（成交）总额	2,946,067,904.59

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,099,663,000.00	20.36
	其中：政策性金融债	1,099,663,000.00	20.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

	合计	1,099,663,000.00	20.36
--	----	------------------	-------

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150222	15 国开 22	3,400,000	339,966,000.00	6.29
2	160401	16 农发 01	2,800,000	279,944,000.00	5.18
3	160204	16 国开 04	1,900,000	189,772,000.00	3.51
4	150419	15 农发 19	1,100,000	110,022,000.00	2.04
5	150215	15 国开 15	500,000	50,000,000.00	0.93

## 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	1,319,786.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,532,581.56
5	应收申购款	6,266,455.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	24,118,823.62

**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	300353	东土科技	241,220,767.72	4.47	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
175,071	25,553.34	669,027,419.07	14.95%	3,804,620,703.81	85.05%

**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	175,647.67	0.00%

**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（2002年11月5日）基金份额总额	2,002,279,940.18
本报告期期初基金份额总额	3,825,869,411.84
本报告期基金总申购份额	1,634,156,803.65
减：本报告期基金总赎回份额	986,378,092.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,473,648,122.88

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**

2016年1月20日本基金管理人发布公告，戴京焦女士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**

本报告期内，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**

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	
兴业证券股份有限公司	3	1,212,154,918.87	18.51%	848,514.53	18.51%	-
长江证券股份有限公司	1	1,050,357,925.62	16.04%	735,257.83	16.04%	-
中泰证券股份有限公司	4	778,230,865.08	11.88%	544,768.35	11.88%	新增 3 个
安信证券股份有限公司	3	550,658,284.57	8.41%	385,460.79	8.41%	-
中信建投证券股份有限公司	2	503,722,086.98	7.69%	352,608.94	7.69%	-
中国银河证券股份有限公司	2	436,557,885.78	6.67%	305,593.70	6.67%	-
广发证券股份有限公司	5	359,839,356.27	5.50%	251,890.19	5.50%	-
华创证券有限责任公司	2	328,315,006.31	5.01%	229,824.92	5.01%	-
东兴证券股份有限公司	1	316,530,295.92	4.83%	221,571.22	4.83%	-
方正证券股份有限公司	3	277,142,225.48	4.23%	194,001.58	4.23%	-
申万宏源证券有限公司	2	235,816,399.67	3.60%	165,073.14	3.60%	-
东吴证券有限责任公司	1	215,488,810.26	3.29%	150,842.16	3.29%	-

东方证券股份 有限公司	4	156,147,240.59	2.38%	109,303.06	2.38%	-
华泰证券股份 有限公司	4	127,144,844.75	1.94%	89,002.07	1.94%	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
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 股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-



英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	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 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-

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：宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

注 4：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注 5：新时代证券有限责任公司更名为新时代证券股份有限公司。

注 6：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 7：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

注 8：中信证券（浙江）有限责任公司更名为中信证券股份有限公司。

注 9：报告期内，本基金退租以下交易单元：华融证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

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**  
2016 年 8 月 27 日