

嘉实成长收益证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
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.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48
§12 补充披露	48

§ 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

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 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	邓红国	田国立

2.4 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	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

2.5 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 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

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。

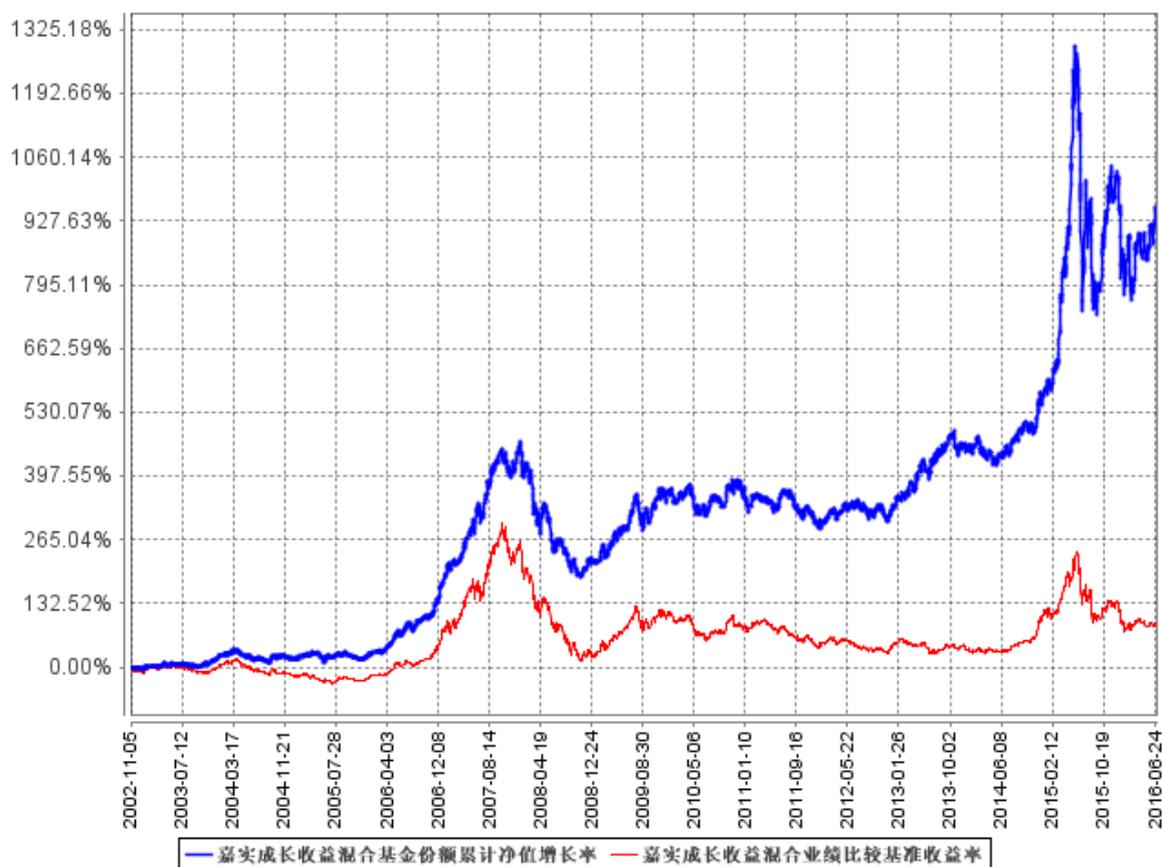
3.2 基金净值表现

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，但整体加杠杆的空间不大。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、产业升级、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、季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
资产：			
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
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		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
所有者权益:			
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
一、收入		-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
减：二、费用		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
三、利润总额		-199,373,666.77	1,922,328,355.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-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
项目	上年度可比期间 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)	2,741,246,373.53	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 基金基本情况

嘉实成长收益证券投资基金(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”)证监基金字[2002]68号《关于同意嘉实成长收益证券投资基金设立的批复》核准,由基金发起人嘉实基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《嘉实成长收益证券投资基金基金合同》发起,并于2002年11月5日募集成立。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2,001,914,857.51元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第99号验资报告予以验证。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《嘉实成长收益证券投资基金招募说明书》和《关于嘉实成长收益基金实施基金份额拆分和限量持续销售的公告》的有关规定,本基金于2008年2月27日进行了基金份额拆分,拆分比例为1.688598859,并于2008年2月27日进行了变更登记。

根据《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》,自2016年1月7日起,对本基金增加H类基金份额类别,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额。本基金根据基金销售地及申购赎回费率的不同,将基金份额分为不同的类别。仅在中国大陆地区销售并收取申购和赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;仅在中国香港地区销售并收取申购和赎回费用的基金份额,称为H类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实成长收益证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产30%-75%,债券资产20%-65%,现金资产比例控制在5%左右。其中,基金对收益型资产类(包括收益型股票和债券)的投资不低于基金资产净值的40%,对国债的投资不低于基金资产净值的20%。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%,其中股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容。本基金的业绩比较基准为上证A股指数。

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(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实成长收益证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协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本报告期末的财务状况以及本报告期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

本基金本报告期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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税: a) 同业存款; b) 买入返售金融资产(质押式、买断式); c) 国债、地方政府债; d) 金融债券。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的

股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	531,823,481.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	531,823,481.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,459,247,096.81	3,794,717,985.27	335,470,888.46	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,100,301,300.00	1,099,663,000.00	-638,300.00
	合计	1,100,301,300.00	1,099,663,000.00	-638,300.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,559,548,396.81	4,894,380,985.27	334,832,588.46	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 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（2016 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（2016 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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	106,816.39
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	1,436.79
应收债券利息	16,423,463.82
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	330.05
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	534.51
合计	16,532,581.56

6.4.7.6 其他资产

本期末（2016 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,742,532.37
银行间市场应付交易费用	3,325.00
合计	1,745,857.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	152,321.98
预提费用	303,878.22
应付指数使用费	-
其他	-
合计	456,200.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,825,869,411.84	2,265,726,865.30
本期申购	1,634,156,803.65	967,769,532.07
本期赎回	-986,378,092.61	-584,149,440.99
本期末	4,473,648,122.88	2,649,346,956.38

注（1）：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

（2）：嘉实成长收益混合 H 类基金本报告期无申购、赎回业务，本期末基金份额总额为 0.00 份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,035,655,755.37	-366,426,706.05	2,669,229,049.32
本期利润	-158,950,469.37	-40,423,197.40	-199,373,666.77
本期基金份额交易产生的变动数	492,671,377.85	-171,371,055.22	321,300,322.63
其中：基金申购款	1,231,965,746.47	-393,914,753.24	838,050,993.23
基金赎回款	-739,294,368.62	222,543,698.02	-516,750,670.60
本期已分配利润	-39,484,669.69	-	-39,484,669.69
本期末	3,329,891,994.16	-578,220,958.67	2,751,671,035.49

注：嘉实成长收益混合 H 类基金本报告期无未分配利润发生额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	53,035.60
其他	31,135.81
合计	1,916,584.82

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	2,946,067,904.59
减：卖出股票成本总额	3,083,660,819.33
买卖股票差价收入	-137,592,914.74

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,351,613,576.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,315,083,724.78
减：应收利息总额	41,472,866.12
买卖债券差价收入	-4,943,014.78

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,539,552.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,539,552.39

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-40,423,197.40
——股票投资	-41,577,242.18
——债券投资	1,154,044.78
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	-40,423,197.40
----	----------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	955,654.26
基金转出费收入	197,708.47
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	1,153,362.73

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	8,110,669.66
银行间市场交易费用	7,575.00
合计	8,118,244.66

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	18,000.00
银行划款手续费	17,065.56
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	800.00
合计	239,743.78

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方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

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。

6.4.10.2 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 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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	5,886,063.77	5,609,582.02

的托管费		
------	--	--

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.2 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（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。

6.4.10.5 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 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	
	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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	本期利润分
---	-----	--------	------	-------	-------

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 红数	发放总额	发放总额	配 合计	备注
1	2016年1 月18日	-	2016年 1月18 日	0.1000	22,129,719.85	17,354,949.84	39,484,669.69	2015年年 度收益分 配于2016 年实施
合 计	-	-		0.1000	22,129,719.85	17,354,949.84	39,484,669.69	

6.4.12 期末（2016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

6.4.12.1.1 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	-

6.4.12.1.2 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。

6.4.12.1.3 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。

6.4.12.2 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	复牌日期	复牌 开盘单	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
----------	----------	------	----------	-----------	------	-----------	-------	------------	--------	----

				价		价				
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	东土科技	2016年6月23日	重大事项停牌	22.09	-	-	10,919,908	191,512,151.52	241,220,767.72	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项停牌	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	重大事项停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

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（2016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（2016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

本基金为混合型证券投资基金，属于中等风险投资品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。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在获取稳定的现金收益的基础上，积极谋求资本增值机会。

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。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：无)。

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于开放日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于开放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。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	531,823,481.33	-	-	-	531,823,481.33
结算备付金	3,542,767.10	-	-	-	3,542,767.10
存出保证金	1,319,786.63	-	-	-	1,319,786.63
交易性金融资产	1,099,663,000.00	-	-	3,794,717,985.27	4,894,380,985.27
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	-	-	-	16,532,581.56	16,532,581.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	560,207.46	-	-	5,706,247.97	6,266,455.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,636,909,242.52	-	-	3,816,956,814.80	5,453,866,057.32
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	-	-	-	248,977.93	248,977.93
应付赎回款	-	-	-	42,886,802.80	42,886,802.80
应付管理人报酬	-	-	-	6,437,337.54	6,437,337.54
应付托管费	-	-	-	1,072,889.61	1,072,889.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,745,857.37	1,745,857.37
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	456,200.20	456,200.20
负债总计	-	-	-	52,848,065.45	52,848,065.45
利率敏感度缺口	1,636,909,242.52	-	-	3,764,108,749.35	5,401,017,991.87
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	501,212,929.41	-	-	-	501,212,929.41

结算备付金	4,776,938.02	-	-	4,776,938.02
存出保证金	1,498,642.82	-	-	1,498,642.82
交易性金融资产	1,102,909,000.00	-	3,316,000,812.31	4,418,909,812.31
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	-	-	27,133,264.23	27,133,264.23
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	422,612.43	-	4,394,323.26	4,816,935.69
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	1,610,820,122.68	-	3,347,528,399.80	4,958,348,522.48
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	13,672,928.10	13,672,928.10
应付管理人报酬	-	-	6,195,289.86	6,195,289.86
应付托管费	-	-	1,032,548.33	1,032,548.33
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	2,041,957.43	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	-	-	449,884.14	449,884.14
负债总计	-	-	23,392,607.86	23,392,607.86
利率敏感度缺口	1,610,820,122.68	-	3,324,135,791.94	4,934,955,914.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	758,132.46	833,061.72

	市场利率上升 25 个基点	-756,853.09	-831,579.30
--	---------------	-------------	-------------

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,794,717,985.27	70.26	3,316,000,812.31	67.19
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	3,794,717,985.27	70.26	3,316,000,812.31	67.19

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	226,032,602.97	178,408,696.15
业绩比较基准下降 5%	-226,032,602.97	-178,408,696.15	

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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次的余额为 3,409,405,475.63 元，属于第二层次的余额为 1,484,975,509.64 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 3,115,766,056.05 元，第二层次 1,303,143,756.26 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入

值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。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)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起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，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

(d) 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。

(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	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所有股票投资明细

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
11	002023	海特高新	7,592,000	131,569,360.00	2.44
12	002426	胜利精密	11,873,750	116,956,437.50	2.17
13	600118	中国卫星	2,500,006	84,000,201.60	1.56
14	600702	沱牌舍得	2,860,075	72,188,293.00	1.34
15	601799	星宇股份	1,517,617	69,537,210.94	1.29
16	600498	烽火通信	2,831,186	68,741,196.08	1.27
17	002046	轴研科技	6,516,578	67,316,250.74	1.25
18	300200	高盟新材	3,612,999	58,891,883.70	1.09
19	300302	同有科技	1,666,665	54,116,612.55	1.00
20	600562	国睿科技	1,507,305	51,685,488.45	0.96
21	600520	*ST中发	2,563,278	47,984,564.16	0.89
22	300377	赢时胜	900,000	44,541,000.00	0.82
23	000963	华东医药	580,963	39,156,906.20	0.72
24	600511	国药股份	1,293,066	35,481,731.04	0.66
25	002192	融捷股份	899,992	33,254,704.40	0.62
26	002108	沧州明珠	1,201,400	31,116,260.00	0.58
27	002580	圣阳股份	1,494,700	28,339,512.00	0.52
28	300166	东方国信	1,000,000	27,470,000.00	0.51
29	600211	西藏药业	611,392	27,121,349.12	0.50
30	002079	苏州固锔	2,350,500	26,255,085.00	0.49
31	002746	仙坛股份	536,600	22,365,488.00	0.41
32	300224	正海磁材	907,200	20,566,224.00	0.38
33	002271	东方雨虹	1,169,912	20,157,583.76	0.37
34	600570	恒生电子	299,941	20,027,060.57	0.37
35	600452	涪陵电力	581,400	19,424,574.00	0.36
36	300294	博雅生物	300,000	18,858,000.00	0.35
37	002206	海利得	1,094,394	18,746,969.22	0.35
38	300068	南都电源	820,000	17,925,200.00	0.33
39	300416	苏试试验	505,700	17,497,220.00	0.32
40	300054	鼎龙股份	698,753	17,482,800.06	0.32
41	002603	以岭药业	1,024,400	16,298,204.00	0.30
42	002573	清新环境	960,850	16,257,582.00	0.30
43	002169	智光电气	700,000	15,925,000.00	0.29
44	002434	万里扬	1,439,600	15,662,848.00	0.29

45	300196	长海股份	352,100	13,791,757.00	0.26
46	300203	聚光科技	499,913	13,197,703.20	0.24
47	002299	圣农发展	500,000	12,950,000.00	0.24
48	300334	津膜科技	709,912	12,813,911.60	0.24
49	300034	钢研高纳	559,802	12,371,624.20	0.23
50	300012	华测检测	989,294	12,247,459.72	0.23
51	002343	慈文传媒	240,078	11,643,783.00	0.22
52	300213	佳讯飞鸿	400,000	11,296,000.00	0.21
53	300084	海默科技	911,800	11,142,196.00	0.21
54	002051	中工国际	511,780	10,066,712.60	0.19
55	603308	应流股份	400,000	10,056,000.00	0.19
56	002184	海得控制	359,949	9,470,258.19	0.18
57	300369	绿盟科技	217,424	9,199,209.44	0.17
58	300389	艾比森	264,907	6,508,764.99	0.12
59	000892	星美联合	410,000	5,801,500.00	0.11
60	300005	探路者	300,000	5,115,000.00	0.09
61	002026	山东威达	399,936	5,027,195.52	0.09
62	600990	四创电子	45,000	3,901,050.00	0.07
63	002185	华天科技	300,000	3,819,000.00	0.07
64	002357	富临运业	239,993	3,703,091.99	0.07
65	600850	华东电脑	103,987	2,983,387.03	0.06
66	600593	大连圣亚	83,600	2,590,764.00	0.05
67	300373	扬杰科技	100,000	2,411,000.00	0.04
68	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.01
69	002123	荣信股份	29,700	617,463.00	0.01
70	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.00
71	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
72	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
73	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
74	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.00
75	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
76	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
77	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
78	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
79	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
80	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
81	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
82	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
83	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00

84	300282	汇冠股份	196	6,909.00	0.00
85	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
86	600230	*ST 沧大	54	535.14	0.00

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。

7.8 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	3	277,142,225.48	4.23%	194,001.58	4.23%	-

有限公司						
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	1	-	-	-	-	-

责任公司						
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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。

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	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 7 日
2	嘉实成长收益证券投资基金 2015 年年度收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 15 日
3	关于增加中证金牛为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 20 日
4	关于增加福建海峡银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 2 月 24 日
5	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 18 日
6	关于增加大泰金石为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 6 日
7	关于增加北京葱次方嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 7 日

8	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 8 日
9	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 22 日
10	关于增加联讯证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 6 日
11	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 6 日
12	关于增加利得基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 30 日
13	关于增加中正达广为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 8 日
14	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与大同证券定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 14 日
15	关于增加天津滨海农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 20 日
16	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实成长收益证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实成长收益证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实成长收益证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实成长收益证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实成长收益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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2016 年 8 月 27 日

§ 12 补充披露

补充披露 1：期末基金资产组合情况

名称	数量(股)	公允价值(人民币元)
(1) 股票投资		
上市投资		
中国(100%)		
天银机电	12,714,263	387,276,450.98
利亚德	9,006,216	285,136,798.56
奥普光电	4,068,548	250,012,274.60

东土科技	10,919,908	241,220,767.72
威海广泰	7,934,663	208,602,290.27
华兰生物	6,400,000	200,960,000.00
中直股份	4,443,746	184,326,584.08
启明星辰	6,648,700	171,735,921.00
光迅科技	2,376,814	152,591,458.80
蒙发利	12,084,795	145,138,387.95
海特高新	7,592,000	131,569,360.00
胜利精密	11,873,750	116,956,437.50
中国卫星	2,500,006	84,000,201.60
沱牌舍得	2,860,075	72,188,293.00
星宇股份	1,517,617	69,537,210.94
烽火通信	2,831,186	68,741,196.08
轴研科技	6,516,578	67,316,250.74
高盟新材	3,612,999	58,891,883.70
同有科技	1,666,665	54,116,612.55
国睿科技	1,507,305	51,685,488.45
*ST 中发	2,563,278	47,984,564.16
赢时胜	900,000	44,541,000.00
华东医药	580,963	39,156,906.20
国药股份	1,293,066	35,481,731.04
融捷股份	899,992	33,254,704.40
沧州明珠	1,201,400	31,116,260.00
圣阳股份	1,494,700	28,339,512.00
东方国信	1,000,000	27,470,000.00
西藏药业	611,392	27,121,349.12
苏州固锔	2,350,500	26,255,085.00
仙坛股份	536,600	22,365,488.00
正海磁材	907,200	20,566,224.00
东方雨虹	1,169,912	20,157,583.76
恒生电子	299,941	20,027,060.57
涪陵电力	581,400	19,424,574.00
博雅生物	300,000	18,858,000.00
海利得	1,094,394	18,746,969.22
南都电源	820,000	17,925,200.00
苏试试验	505,700	17,497,220.00
鼎龙股份	698,753	17,482,800.06
以岭药业	1,024,400	16,298,204.00
清新环境	960,850	16,257,582.00
智光电气	700,000	15,925,000.00
万里扬	1,439,600	15,662,848.00
长海股份	352,100	13,791,757.00
聚光科技	499,913	13,197,703.20
圣农发展	500,000	12,950,000.00

津膜科技	709,912	12,813,911.60
钢研高纳	559,802	12,371,624.20
华测检测	989,294	12,247,459.72
慈文传媒	240,078	11,643,783.00
佳讯飞鸿	400,000	11,296,000.00
海默科技	911,800	11,142,196.00
中工国际	511,780	10,066,712.60
应流股份	400,000	10,056,000.00
海得控制	359,949	9,470,258.19
绿盟科技	217,424	9,199,209.44
艾比森	264,907	6,508,764.99
星美联合	410,000	5,801,500.00
探路者	300,000	5,115,000.00
山东威达	399,936	5,027,195.52
四创电子	45,000	3,901,050.00
华天科技	300,000	3,819,000.00
富临运业	239,993	3,703,091.99
华东电脑	103,987	2,983,387.03
大连圣亚	83,600	2,590,764.00
扬杰科技	100,000	2,411,000.00
中国核建	37,059	775,274.28
荣信股份	29,700	617,463.00
久之洋	1,473	258,025.41
小康股份	8,662	206,761.94
玲珑轮胎	15,341	199,126.18
三棵树	1,327	154,038.16
百利科技	2,815	116,681.75
上海沪工	1,263	76,664.10
三德科技	1,354	63,461.98
盛讯达	1,306	61,186.10
环球印务	1,080	47,131.20
哈森股份	2,372	34,394.00
洪汇新材	1,629	24,565.32
合诚股份	1,095	20,126.10
新宏泰	1,602	13,600.98
科大国创	926	9,306.30
汇冠股份	196	6,909.00
丰元股份	971	5,631.80
*ST 沧大	54	535.14
合计		3,794,717,985.27
(2) 债券投资		
上市投资		
中国 (100%)		
15 国开 22	3,400,000	339,966,000.00

16 农发 01	2,800,000	279,944,000.00
16 国开 04	1,900,000	189,772,000.00
15 农发 19	1,100,000	110,022,000.00
15 国开 15	500,000	50,000,000.00
16 国开 11	500,000	49,990,000.00
16 国开 09	500,000	49,915,000.00
11 进出 14	300,000	30,054,000.00
合计		1,099,663,000.00
总投资资产		4,894,380,985.27
银行存款和结算备付金		535,366,248.43
其他各项资产		24,118,823.62
合计		5,453,866,057.32

补充披露 2: 投资组合变动表

序号	证券类别	占基金资产净值的比例 (%) 2016 年 6 月 30 日	占基金资产净值的比例 (%) 2015 年 12 月 31 日
1	股票	70.26	67.19
2	债券	20.36	22.35