

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金

## 2015年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015年8月29日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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            | 嘉实美国成长股票型证券投资基金     |                      |
| 基金简称            | 嘉实美国成长股票（QDII）      |                      |
| 基金主代码           | 000043              |                      |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                      |
| 基金合同生效日         | 2013年6月14日          |                      |
| 基金管理人           | 嘉实基金管理有限公司          |                      |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司          |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 30,031,756.74份      |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                      |
| 下属分级基金的基金简称：    | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |
| 下属分级基金的交易代码：    | 000043              | 000044               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 24,464,680.16份      | 5,567,076.58份        |

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人             | 基金托管人                |
|---------|------|-------------------|----------------------|
| 名称      |      | 嘉实基金管理有限公司        | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 胡勇钦               | 王永民                  |
|         | 联系电话 | (010) 65215588    | (010) 66594896       |
|         | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-600-8800      | 95566                |
| 传真      |      | (010) 65182266    | (010) 66594942       |

## 2.4 境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司                         |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币         | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇        |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 1,946,986.18                | 2,185,740.66                |
| 本期利润          | 1,408,866.85                | 940,030.76                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0416                      | 0.1693                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.37%                       | 2.22%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.58%                       | 2.57%                       |
| 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      | 4,025,847.44                | 7,836,975.96                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1646                      | 1.4077                      |
| 期末基金资产净值      | 30,179,449.82               | 42,147,854.25               |
| 期末基金份额净值      | 1.234                       | 1.238                       |
| 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   | 23.40%                      | 23.80%                      |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额以人民币申购获得人民币份额，赎回获得人民币赎回款；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额以美元申购获得美元份额，赎回获得美元赎回款；（3）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；（5）嘉实美国成长股票 (QDII) 美元现汇的期末基金份额净值单位为美

元。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -1.04%   | 0.72%       | -1.80%     | 0.72%         | 0.76%  | 0.00% |
| 过去三个月      | -0.80%   | 0.69%       | -0.25%     | 0.65%         | -0.55% | 0.04% |
| 过去六个月      | 2.58%    | 0.81%       | 3.03%      | 0.76%         | -0.45% | 0.05% |
| 过去一年       | 7.96%    | 0.77%       | 8.47%      | 0.74%         | -0.51% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.40%   | 0.74%       | 31.57%     | 0.69%         | -8.17% | 0.05% |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -0.96%   | 0.73%       | -1.80%     | 0.72%         | 0.84%  | 0.01% |
| 过去三个月      | -0.48%   | 0.69%       | -0.25%     | 0.65%         | -0.23% | 0.04% |
| 过去六个月      | 2.57%    | 0.81%       | 3.03%      | 0.76%         | -0.46% | 0.05% |
| 过去一年       | 8.60%    | 0.77%       | 8.47%      | 0.74%         | 0.13%  | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.80%   | 0.73%       | 31.57%     | 0.69%         | -7.77% | 0.04% |

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

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

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

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

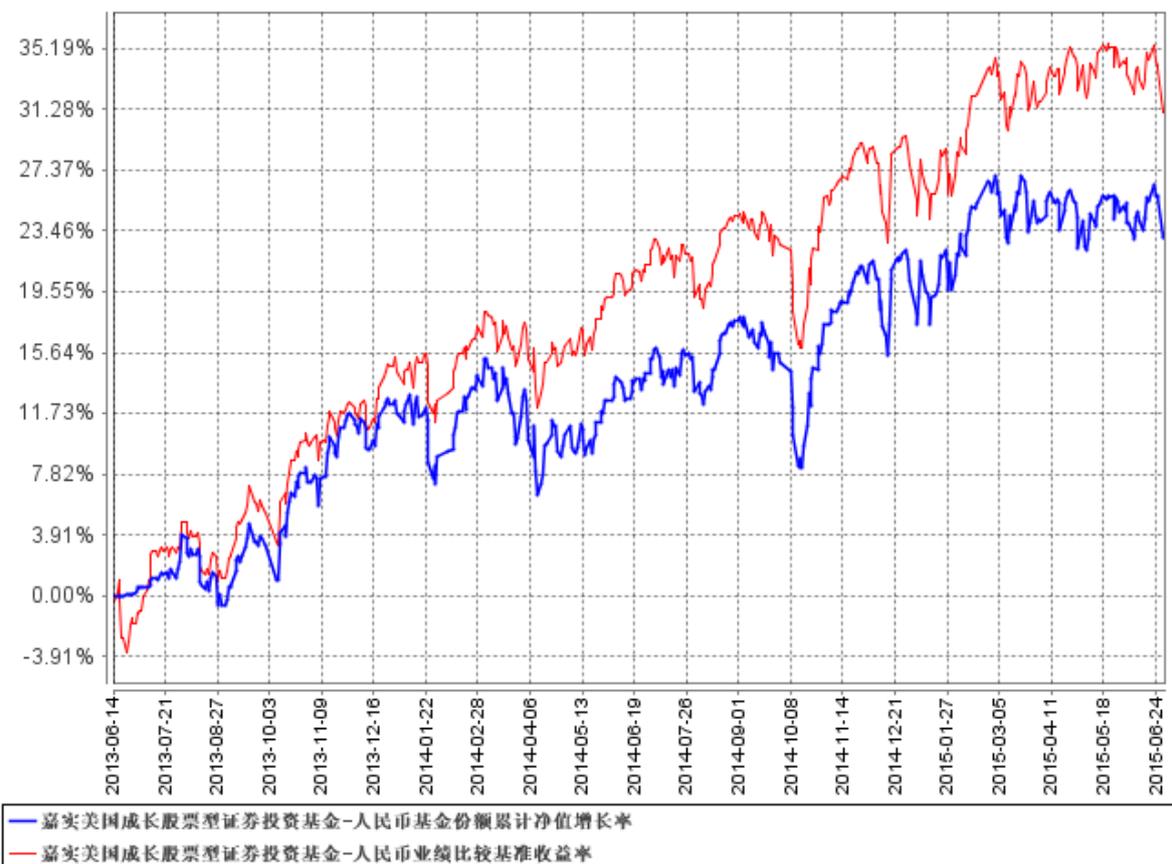


图 1：嘉实美国成长股票（QDII）人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013年6月14日至2015年6月30日）

## 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

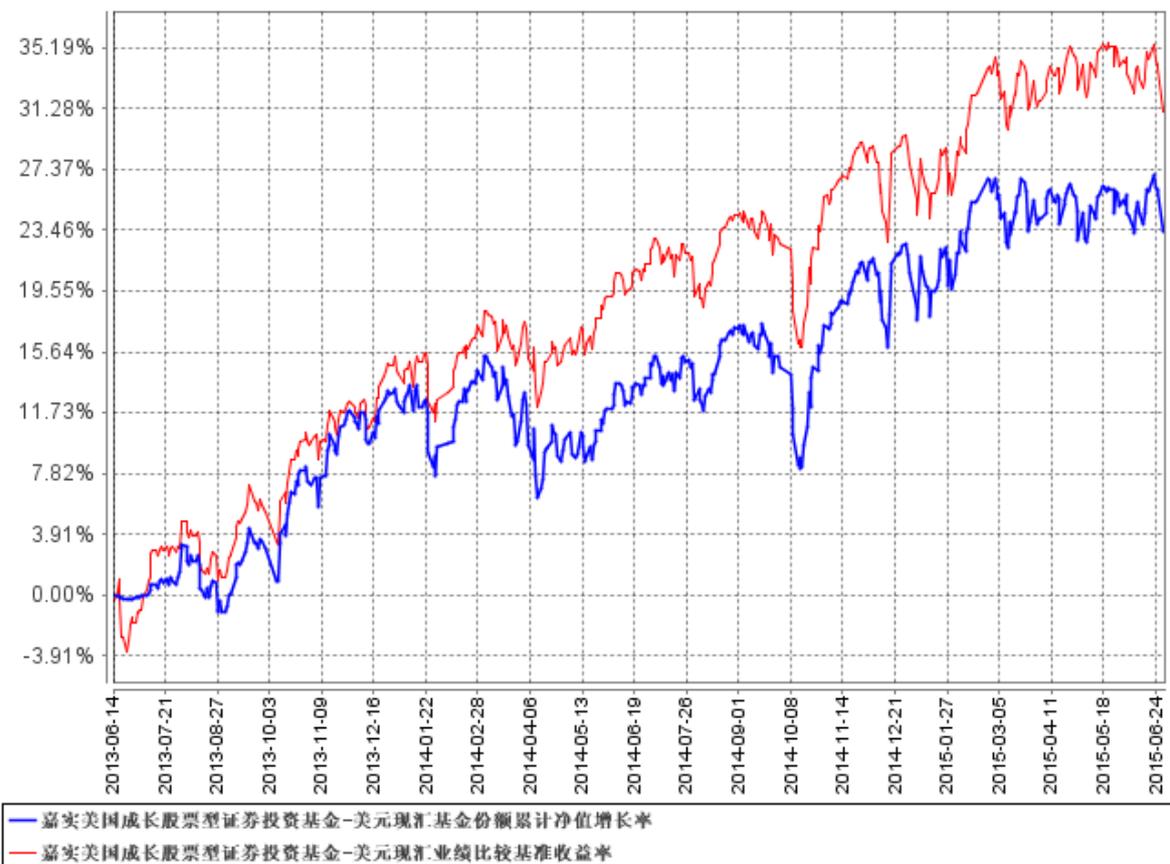


图 2: 嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013年6月14日至2015年6月30日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（三）投资范围和（九）投资限制”的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 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 |        |  |
| 张自力 | 本基金基金经理、嘉实事件驱动股票基金经理、定量投资部负责人 | 2013 年 6 月 14 日 | -    | 18 年   | 理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有 18 年公募基金从业经验。曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，投资决策委员会成员、定量投资部负责人。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 3 次，均为旗下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

美国股票市场在 2015 年前二季度整体呈现窄幅震荡行情。其中，1 月份震荡上行，2 月份市场受部分盈利公告的驱动表现较好，3 月份波动较大，市场回撤，4 月份、5 月份震荡上行，6 月末出现较大回撤，市场在 2015 年第一季度整体呈现震荡上行，二季度期末与期初基本持平。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准，在一季度实现正向超额收益，二季度基本持平，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响基金净值超额收益略有减损。具体而言，一月份市场并未产生一月份效应，波动之后仅略有上升。二月份本基金减持高配了高科技等成长性行业，加大了对权重股的风险控制，在市场连续上行的整月中保持了相对市场的超额收益，三月份受本基金的超额收益由于市场风格切换受到部分侵蚀。在一季度内，国际油价也是影响市场趋势和风格的重要因素，本基金在油价下行过程中坚持了对航空等行业的配置，并对产油和油服行业的权重进行下限控制。二季度整体而言，大盘成长与大盘价值类风格区分度不明显，成长股中，小盘成长在 4 月末和 6 月末相对大盘成长出现了较大幅度回撤，而在 5 月至 6 月中旬则显著强于大盘成长。本基金择机对小盘成长进行有限配置，捕捉到此类市场机会，二季度超额收益的贡献之一就是 5 月份小盘成长风格上的暴露。行业上，本基金主要配置于信息科技等行业，信息科技也是超额收益贡献最大的行业。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 1.234 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.58%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 1.238 美元，本报告期基金份额净值增长率为 2.57%；同期业绩比较基准收益率为 3.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期 2015 年美国的货币政策继续保持稳健，加息操作将于今年晚些时候实施，目前资本市场定价已经计入加息预期，因而货币政策不会对市场产生过大震荡。实体经济将继续走强，基于此判断我们认为 2015 年全年美国股票市场整体上也将继续 2014 年的上行趋势，已经过去的前两季度表明，美股市场在经历了波动震荡和风格转换后，依然呈现了相对稳健的趋势，我们对后市走势保持乐观向上的判断。

市场方面，我们认为进入强势美元阶段，各类美元资产都不同程度的升值，美国股票市场在长期上仍将继续上涨。目前市场领先指标仍是向上，没有疲弱的迹象。但由于企业盈利长期成长

趋势不变，我们认为美国经济将保持持续的增长动力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构为纽约、纳斯达克交易所等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十九（三）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”）在对嘉实美国成长股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015年6月30日         | 上年度末<br>2014年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 4,723,995.90              | 5,696,591.34                |
| 结算备付金           |            | -                         | -                           |
| 存出保证金           |            | -                         | -                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 69,424,037.25             | 74,603,464.16               |
| 其中：股票投资         |            | 66,563,671.38             | 74,602,130.83               |
| 基金投资            |            | 2,860,365.87              | 1,333.33                    |
| 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    | 24,262.80                 | -                           |
| 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    | 552.95                    | 760.14                      |
| 应收股利            |            | 35,925.90                 | 73,921.62                   |
| 应收申购款           |            | 104,318.13                | 336,979.03                  |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 74,313,092.93             | 80,711,716.29               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | -                         | 629,730.03                  |
| 应付赎回款           |            | 1,677,817.61              | 980,581.85                  |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬       |          | 109,406.35    | 120,059.14    |
| 应付托管费         |          | 21,273.46     | 23,344.82     |
| 应付销售服务费       |          | -             | -             |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | -             | -             |
| 应交税费          |          | -             | -             |
| 应付利息          |          | -             | -             |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 177,291.44    | 353,337.61    |
| 负债合计          |          | 1,985,788.86  | 2,107,053.45  |
| <b>所有者权益:</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 58,775,558.45 | 65,429,664.91 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 13,551,745.62 | 13,174,997.93 |
| 所有者权益合计       |          | 72,327,304.07 | 78,604,662.84 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 74,313,092.93 | 80,711,716.29 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值

1.234 元，基金份额总额 24,464,680.16 份；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 1.238 美元，基金份额总额 5,567,076.58 份。嘉实美国成长股票 (QDII) 基金份额总额合计为 30,031,756.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：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<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b> |          | 3,492,140.52                             | 2,589,479.93                                  |
| 1.利息收入      |          | 12,962.31                                | 14,925.93                                     |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 12,962.31                                | 14,925.93                                     |
| 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      |          | 5,072,528.05                             | 1,978,013.10                                  |
| 其中：股票投资收益   | 6.4.7.12 | 4,536,259.34                             | 1,639,309.24                                  |
| 基金投资收益      | 6.4.7.13 | 9,496.74                                 | -187,986.37                                   |
| 债券投资收益      | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益  |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益     |          | -  | -   |
| 衍生工具收益      | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 股利收益        | 6.4.7.16 | 526,771.97                               | 526,690.23                                    |

|                |          |                     |                     |
|----------------|----------|---------------------|---------------------|
| 3.公允价值变动收益     | 6.4.7.17 | -1,783,829.23       | 549,058.32          |
| 4.汇兑收益         | 6.4.7.21 | 137,953.85          | -1,814.04           |
| 5.其他收入         | 6.4.7.18 | 52,525.54           | 49,296.62           |
| <b>减：二、费用</b>  |          | <b>1,143,242.91</b> | <b>1,303,963.29</b> |
| 1. 管理人报酬       |          | 751,737.30          | 838,228.27          |
| 2. 托管费         |          | 146,171.17          | 162,988.80          |
| 3. 销售服务费       |          | -                   | -                   |
| 4. 交易费用        | 6.4.7.19 | 49,071.65           | 110,010.02          |
| 5. 利息支出        |          | -                   | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出  |          | -                   | -                   |
| <b>6. 其他费用</b> | 6.4.7.20 | <b>196,262.79</b>   | <b>192,736.20</b>   |
| <b>三、利润总额</b>  |          | <b>2,348,897.61</b> | <b>1,285,516.64</b> |
| 减：所得税费用        |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润</b>   |          | <b>2,348,897.61</b> | <b>1,285,516.64</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>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<br>(基金净值)               | 65,429,664.91                   | 13,174,997.93 | 78,604,662.84  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期净利润) | -                               | 2,348,897.61  | 2,348,897.61   |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数          | -6,654,106.46                   | -1,972,149.92 | -8,626,256.38  |
| 其中：1.基金申购款                        | 33,203,908.56                   | 7,678,857.16  | 40,882,765.72  |
| 2.基金赎回款                           | -39,858,015.02                  | -9,651,007.08 | -49,509,022.10 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动 | -                               | -             | -              |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)               | 58,775,558.45                   | 13,551,745.62 | 72,327,304.07  |
| 项目                                | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |               |                |
|                                   | 实收基金                            | 未分配利润         | 所有者权益合计        |

|                                   |                |               |                |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)               | 78,996,966.81  | 9,811,333.41  | 88,808,300.22  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期净利润) | -              | 1,285,516.64  | 1,285,516.64   |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数          | 3,403,140.56   | 571,637.71    | 3,974,778.27   |
| 其中: 1.基金申购款                       | 40,579,891.92  | 4,975,562.98  | 45,555,454.90  |
| 2.基金赎回款                           | -37,176,751.36 | -4,403,925.27 | -41,580,676.63 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动 | -              | -             | -              |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)               | 82,400,107.37  | 11,668,487.76 | 94,068,595.13  |

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:

|              |             |             |
|--------------|-------------|-------------|
| _____<br>赵学军 | _____<br>王红 | _____<br>常旭 |
| 基金管理人负责人     | 主管会计工作负责人   | 会计机构负责人     |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系               |
|--------------------|-----------------------|
| 嘉实基金管理有限公司         | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金代销机构          |
| 德意志证券亚洲有限公司        | 与基金管理人股东处于同一控股集团      |

#### 6.4.4 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

###### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称       | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                  |
|-------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|             | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 德意志证券亚洲有限公司 | 27,096,292.41              | 32.49%           | 91,518,662.28                   | 67.21%           |

###### 6.4.4.1.2 债券交易

本期（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.4.1.3 债券回购交易

本期（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.4.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称       | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 |                  | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                  |
|-------------|--------------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|             | 成交金额                           | 占当期基金<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期基金<br>成交总额的比例 |
| 德意志证券亚洲有限公司 | -                              | -                | 11,281,642.21                   | 45.43%           |

注：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基金交易。

###### 6.4.4.1.5 权证交易

本期（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称       | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日      |            |          |              |
|-------------|---------------------------------|------------|----------|--------------|
|             | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 德意志证券亚洲有限公司 | 14,683.31                       | 30.52%     | -        | -            |
| 关联方名称       | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |            |          |              |
|             | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 德意志证券亚洲有限公司 | 75,355.75                       | 69.50%     | -        | -            |

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

#### 6.4.4.2 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<br>2015年1月1日至2015年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 751,737.30                     | 838,228.27                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 273,760.63                     | 301,510.33                          |

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8% / 当年天数。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 146,171.17                     | 162,988.80                          |

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.35% / 当年天数。

**6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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

**6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本期末(2015年6月30日)及上年度末(2014年12月31日),其他关联方未持有本基金。

**6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位:人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国银行股份有限公司 | 4,723,995.90                   | 12,735.12 | 7,750,399.80                    | 14,575.01 |

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(2015年1月1日至2015年6月30日)及上年度可比期间(2014年1月1日至2014年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.5 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本期末(2015年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本期末(2015年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

本期末(2015年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 66,563,671.38 | 89.57         |
|    | 其中：普通股            | 66,563,671.38 | 89.57         |
|    | 存托凭证              | -             | -             |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | 2,860,365.87  | 3.85          |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | 24,262.80     | 0.03          |
|    | 其中：远期             | -             | -             |
|    | 期货                | -             | -             |
|    | 期权                | -             | -             |
|    | 权证                | 24,262.80     | 0.03          |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 4,723,995.90  | 6.36          |
| 8  | 其他各项资产            | 140,796.98    | 0.19          |
|    | 合计                | 74,313,092.93 | 100.00        |

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 美国     | 66,563,671.38 | 92.03         |
| 合计     | 66,563,671.38 | 92.03         |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 非必需消费品 | 14,176,636.73 | 19.60         |
| 必需消费品  | 6,476,786.05  | 8.95          |
| 能源     | 2,338,074.54  | 3.23          |
| 金融     | 2,587,261.03  | 3.58          |
| 医疗保健   | 9,270,390.20  | 12.82         |
| 工业     | 7,356,304.75  | 10.17         |
| 信息技术   | 20,175,041.57 | 27.89         |
| 原材料    | 3,356,807.31  | 4.64          |
| 电信     | 826,369.20    | 1.14          |
| 合计     | 66,563,671.38 | 92.03         |

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

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)             | 公司名称(中文) | 证券代码     | 所在证券市场    | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|----------|----------|-----------|----------|-------|--------------|---------------|
| 1  | APPLE INC            | -        | AAPL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 8,088 | 6,201,864.49 | 8.57          |
| 2  | HOME DEPOT INC       | -        | HD UN    | 纽约证券交易所   | 美国       | 2,507 | 1,703,266.75 | 2.35          |
| 3  | GILEAD SCIENCES INC  | -        | GILD UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 2,039 | 1,459,476.01 | 2.02          |
| 4  | WALT DISNEY CO/THE   | -        | DIS UN   | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 2,074 | 1,447,250.27 | 2.00          |
| 5  | BIOGEN INC           | -        | BIIB UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国       | 582   | 1,437,265.05 | 1.99          |
| 6  | 3M CO                | -        | MMM UN   | 纽约证券交易所   | 美国       | 1,508 | 1,422,539.35 | 1.97          |
| 7  | MASTERCARD INC-CLASS | -        | MA UN    | 纽约证券交易所   | 美国       | 2,482 | 1,418,461.33 | 1.96          |
| 8  | BOEING CO/THE        | -        | BA UN    | 纽约证券交易所   | 美国       | 1,650 | 1,399,329.68 | 1.93          |
| 9  | GOOGLE INC-CL A      | -        | GOOGL UW | 纽约证券交易所   | 美国       | 399   | 1,317,333.83 | 1.82          |

|    |              |   |         |               |    |       |              |      |
|----|--------------|---|---------|---------------|----|-------|--------------|------|
| 10 | CELGENE CORP | - | CELG UW | 纳斯达克证<br>券交易所 | 美国 | 1,681 | 1,189,404.18 | 1.64 |
|----|--------------|---|---------|---------------|----|-------|--------------|------|

注：（1）本表所使用的证券代码为彭博代码。（2）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。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                         | 证券代码     | 本期累计买入金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|----------------------------------|----------|--------------|------------------------|
| 1  | APPLE INC                        | AAPL UW  | 1,338,891.42 | 1.70                   |
| 2  | RED HAT INC                      | RHT UN   | 1,098,513.81 | 1.40                   |
| 3  | GOOGLE INC-CL A                  | GOOGL UW | 1,093,344.60 | 1.39                   |
| 4  | BIG LOTS INC                     | BIG UN   | 1,044,332.02 | 1.33                   |
| 5  | AETNA INC                        | AET UN   | 1,018,326.17 | 1.30                   |
| 6  | QUALCOMM INC                     | QCOM UW  | 1,000,102.78 | 1.27                   |
| 7  | METTLER-TOLEDO INTER             | MTD UN   | 938,927.99   | 1.19                   |
| 8  | MANHATTAN ASSOCIATES             | MANH UW  | 894,647.49   | 1.14                   |
| 9  | CIMPRESS NV                      | CMPR UW  | 864,893.10   | 1.10                   |
| 10 | LEIDOS HOLDINGS INC              | LDOS UN  | 856,916.59   | 1.09                   |
| 11 | ASPEN TECHNOLOGY INC             | AZPN UW  | 851,437.11   | 1.08                   |
| 12 | WEBMD HEALTH CORP                | WBMD UW  | 850,433.35   | 1.08                   |
| 13 | SEALED AIR CORP                  | SEE UN   | 833,099.54   | 1.06                   |
| 14 | MEDNAX INC                       | MD UN    | 782,348.18   | 1.00                   |
| 15 | GAP INC/THE                      | GPS UN   | 781,279.03   | 0.99                   |
| 16 | MARRIOTT VACATIONS W             | VAC UN   | 771,674.04   | 0.98                   |
| 17 | WYNDHAM WORLDWIDE CO             | WYN UN   | 770,994.77   | 0.98                   |
| 18 | TAKE-TWO INTERACTIVE<br>SOFTWARE | TTWO UW  | 764,158.66   | 0.97                   |
| 19 | NIKE INC -CL B                   | NKE UN   | 738,743.88   | 0.94                   |
| 20 | O'REILLY AUTOMOTIVE              | ORLY UW  | 729,928.00   | 0.93                   |

### 7.5.2 累计卖出金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)       | 证券代码    | 本期累计卖出金额     | 占期初基金<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|----------------|---------|--------------|------------------------|
| 1  | MICROSOFT CORP | MSFT UW | 2,397,810.77 | 3.05                   |
| 2  | APPLE INC      | AAPL UW | 1,523,270.10 | 1.94                   |

|    |                               |          |              |      |
|----|-------------------------------|----------|--------------|------|
| 3  | FACEBOOK INC-A                | FB UW    | 1,134,652.13 | 1.44 |
| 4  | PAREXEL INTERNATIONAL<br>CORP | PRXL UW  | 1,112,960.18 | 1.42 |
| 5  | EDWARDS LIFESCIENCES<br>CORP  | EW UN    | 1,060,022.13 | 1.35 |
| 6  | BALL CORP                     | BLL UN   | 1,034,392.63 | 1.32 |
| 7  | GOOGLE INC-CL A               | GOOGL UW | 1,026,475.40 | 1.31 |
| 8  | CR BARD INC                   | BCR UN   | 994,283.84   | 1.26 |
| 9  | BIG LOTS INC                  | BIG UN   | 929,852.62   | 1.18 |
| 10 | LEVEL 3 COMMUNICATIONS<br>INC | LVLT UN  | 923,702.81   | 1.18 |
| 11 | ABBVIE INC                    | ABBV UN  | 828,032.83   | 1.05 |
| 12 | NVR INC                       | NVR UN   | 821,039.87   | 1.04 |
| 13 | LEIDOS HOLDINGS INC           | LDOS UN  | 820,575.99   | 1.04 |
| 14 | CATERPILLAR INC               | CAT UN   | 818,412.37   | 1.04 |
| 15 | TJX COMPANIES INC             | TJX UN   | 801,488.50   | 1.02 |
| 16 | SAFEWAY INC                   | SWY UN   | 799,568.37   | 1.02 |
| 17 | HEALTHSOUTH CORP              | HLS UN   | 797,460.64   | 1.01 |
| 18 | MACY'S INC                    | M UN     | 791,395.11   | 1.01 |
| 19 | WEBMD HEALTH CORP             | WBMD UW  | 768,126.33   | 0.98 |
| 20 | HANESBRANDS INC               | HBI UN   | 758,483.65   | 0.96 |

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 36,297,866.50 |
| 卖出收入（成交）总额 | 47,109,842.66 |

注：7.5.1项“买入金额”、7.5.2项“卖出金额”及7.5.3项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称   | 公允价值      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|---|-----------|--------------|
| 1  | 权证投资  | Safeways general merchandise retailer           | 23,149.70 | 0.03         |
| 2  | 权证投资  | Safeways real-estate development subsidiary PDC | 1,113.10  | 0.00         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只金融衍生品投资。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称    | 基金类型                         | 运作方式   | 管理人    | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------------------------------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1  | HEDJ UP | WISDOMTREE EUROPE HEDGED EQU | ETF 基金 | 交易型开放式 | 2,028,026.26 | 2.80         |
| 2  | DXJ UP  | WISDOMTREE JAPAN HEDGED EQ   | ETF 基金 | 交易型开放式 | 831,581.65   | 1.15         |
| 3  | IWV UP  | ISHARES RUSSELL 3000 ETF     | ETF 基金 | 交易型开放式 | 757.96       | 0.00         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 35,925.90  |
| 4  | 应收利息    | 552.95     |
| 5  | 应收申购款   | 104,318.13 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
|   | 合计    | 140,796.98 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                 | 持有人户数(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  |
| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 1,852    | 13,209.87 | 0.00  | 0.00%  | 24,464,680.16 | 100.00% |
| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 290      | 19,196.82 | 0.00  | 0.00%  | 5,567,076.58  | 100.00% |
| 合计                   | 2,129    | 14,106.04 | 0.00  | 0.00%  | 30,031,756.74 | 100.00% |

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

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额 |
|----|------|-----------|--------|
|----|------|-----------|--------|

|                  |                      |           | 比例    |
|------------------|----------------------|-----------|-------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 95,127.72 | 0.39% |
|                  | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0.00      | 0.00% |
|                  | 合计                   | 95,127.72 | 0.32% |

### 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                             | 份额级别                 | 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 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 0                  |
|                                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0                  |
|                                | 合计                   | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 0                  |
|                                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0                  |
|                                | 合计                   | 0                  |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                               | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |
|----------------------------------|---------------------|----------------------|
| 基金合同生效日 (2013 年 6 月 14 日) 基金份额总额 | 430,245,997.74      | 7,592,329.66         |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 38,139,630.94       | 4,427,698.24         |
| 本报告期基金总申购份额                      | 17,227,936.85       | 2,592,036.79         |
| 减:本报告期基金总赎回份额                    | 30,902,887.63       | 1,452,658.45         |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | -                   | -                    |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 24,464,680.16       | 5,567,076.58         |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|  |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 瑞银证券亚洲有限公司<br>UBS Securities Asia Limited                    | -      | 55,938,447.39 | 67.07%       | 32,767.96 | 68.10%     | -  |
| 德意志证券亚洲有限公司<br>Deutsche Securities Asia Limited              | -      | 27,096,292.41 | 32.49%       | 14,683.31 | 30.52%     | -  |
| 中信证券国际有限公司<br>CITIC Securities International Company Limited | -      | 372,969.36    | 0.45%        | 663.55    | 1.38%      | -  |
| 瑞士信贷(香港)有限公司<br>Credit Suisse (Hong Kong) Limited            | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 花旗环球金融亚洲有限公司<br>Citigroup Global Markets Asia Limited        | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 麦格理资本证券股份有限公司<br>Macquarie Securities Group                  | -      | -             | -            | -         | -          | -  |

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称              | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易          |              |
|-------------------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|---------------|--------------|
|                   | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 |
| 瑞银证券亚洲有限公司<br>UBS | -    | -            | -      | -              | -    | -            | 10,662,115.42 | 100.00%      |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Securities Asia<br>Limited                             |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 德意志证券亚洲有<br>限公司 Deutsche<br>Securities Asia<br>Limited |  |  |  |  |  |  |  |  |

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

嘉实基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日