

# 嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

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

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12        |
| 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 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.....                                | 16        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 34        |
| 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.....       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 40        |
| 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.....      | 41        |
| 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.....   | 41        |
| 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.....   | 41        |
| 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.....      | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 41        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 41        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....              | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 42        |
| 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        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....              | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 43        |
| 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.....  | 43        |
| 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.....                       | 45        |
| <b>§11 备查文件目录</b> .....                | <b>47</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 47        |
| 11.2 存放地点.....                         | 47        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金 |
| 基金简称       | 嘉实研究阿尔法股票        |
| 基金主代码      | 000082           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2013 年 5 月 28 日  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 609,148,192.88 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报，谋求基金资产的长期增值。  |
| 投资策略   | 本基金将在保持较高的股票仓位和基本面研究的基础上，以谋求基金资产的长期增值为目标，采用“自下而上”精选策略优选个股，通过嘉实研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合，并根据宏观经济运行状况，动态调整大类资产的配置比例，达到增强收益的目的。 |
| 业绩比较基准 | MSCI 中国 A 股指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人              |
|---------|------|---------------------------|--------------------|
| 名称      |      | 嘉实基金管理有限公司                | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 胡勇钦                       | 林葛                 |
|         | 联系电话 | (010) 65215588            | (010) 66060069     |
|         | 电子邮箱 | service@jsfund.cn         | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-600-8800              | 95599              |
| 传真      |      | (010) 65182266            | (010) 68121816     |
| 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 | 北京东城区建国门内大街 69 号   |

|       |                           |                                 |
|-------|---------------------------|---------------------------------|
|       | 中心二期 53 层 09-11 单元        |                                 |
| 办公地址  | 北京市建国门北大街 8 号<br>华润大厦 8 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28<br>号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码  | 100005                    | 100031                          |
| 法定代表人 | 邓红国                       | 周慕冰                             |

## 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 | <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                         |

## 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<br>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       | -21,490,415.74                        |
| 本期利润          | -16,045,102.99                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0703                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -5.26%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -10.44%                               |
| 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      | 51,401,258.60                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0844                                |
| 期末基金资产净值      | 660,549,451.48                        |
| 期末基金份额净值      | 1.084                                 |
| 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   | 66.93%                                |

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；(2) 上述基金

业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 2.55%    | 1.16%       | 0.97%      | 1.05%         | 1.58%  | 0.11%  |
| 过去三个月      | 2.98%    | 1.23%       | -1.73%     | 1.11%         | 4.71%  | 0.12%  |
| 过去六个月      | -10.44%  | 2.03%       | -16.70%    | 1.94%         | 6.26%  | 0.09%  |
| 过去一年       | -17.07%  | 2.40%       | -29.88%    | 2.29%         | 12.81% | 0.11%  |
| 过去三年       | 69.65%   | 1.75%       | 42.81%     | 1.77%         | 26.84% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 66.93%   | 1.72%       | 22.34%     | 1.77%         | 44.59% | -0.05% |

注：本基金业绩比较基准：MSCI 中国 A 股指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%

MSCI 中国 A 股指数是摩根斯坦利资本国际公司（MSCI）编制的，它的样本选自于沪深两个证券市场，并以自由流动量作为权重来选取成份股。MSCI 中国 A 股指数具有覆盖性广、代表性强、指数编制方法透明、市场波动较小、国际化等特点，能够较好的反映中国 A 股市场总体发展趋势。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

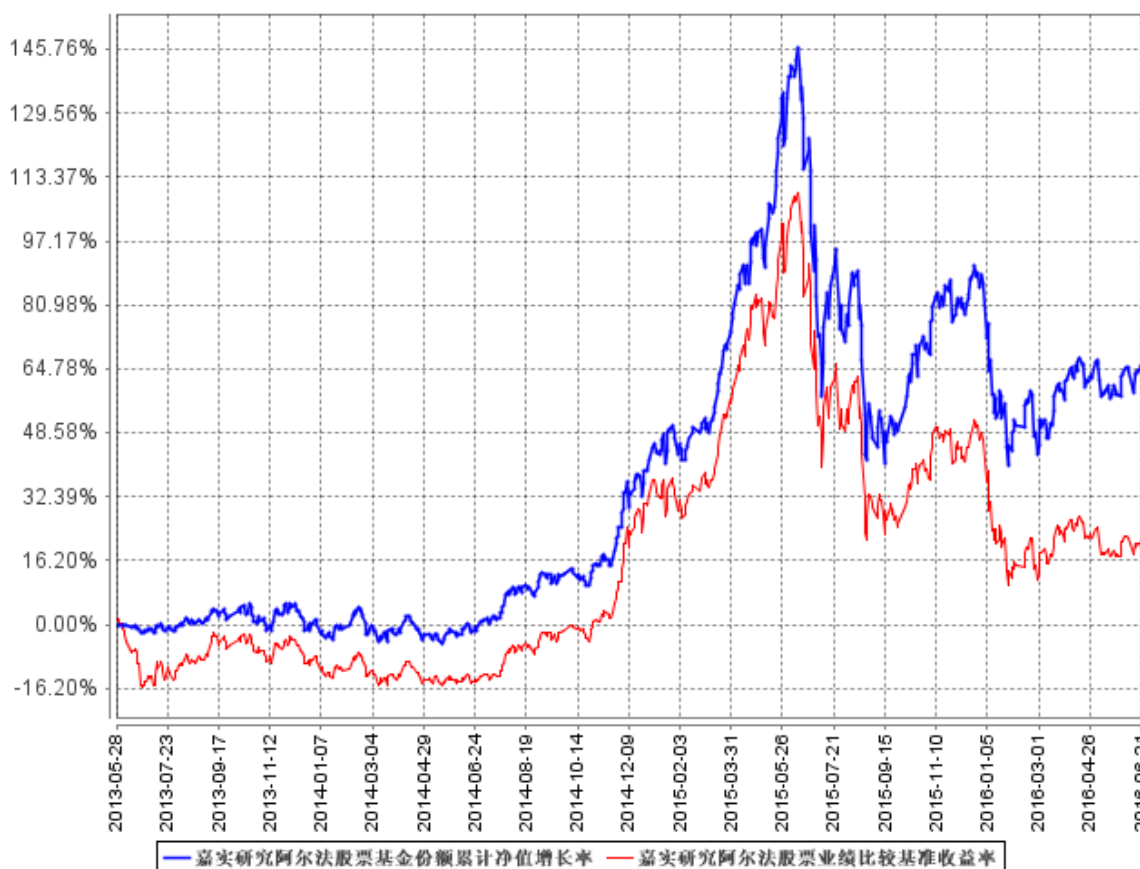
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

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

#### 嘉实研究阿尔法股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实研究阿尔法股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月28日至2016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“第十二部分（二）投资范围和（四）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 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）<br>期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明 |
|----|----|---------------------|------|------------|----|
|    |    | 任职日期                | 离任日期 |            |    |
|    |    |                     |      |            |    |

|    |  |                 |   |      |  |
|----|--|-----------------|---|------|--|
| 张琦 | 本基金、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实对冲套利定期混合、嘉实沪深 300 指数研究增强基金经理，公司研究部副总监 | 2013 年 5 月 28 日 | - | 10 年 | 硕士研究生。2005 年 7 月加入嘉实基金，历任行业研究员、金融地产研究组组长，2011 年 3 月至今担任研究部副总监。具有基金从业资格，中国国籍。                           |
| 刘斌 | 本基金、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实对冲套利定期混合基金经理           | 2014 年 5 月 15 日 | - | 10 年 | 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作。博士，具有基金从业资格。 |

注：（1）基金经理张琦的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理刘斌的任职日期指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；（3）2016 年 7 月 27 日，本基金管理人发布《关于嘉实研究阿尔法股票基金经理变更的公告》，张琦女士、刘斌先生不再担任本基金基金经理，聘请赵宇女士担任本基金基金经理职务。

## 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、《嘉实研究阿尔法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 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

2016 年上半年，A 股市场整体波动剧烈，系统性风险在短期快速释放后，个股呈现严重分化格局。前期，受人民币贬值的悲观预期以及熔断机制的情绪放大作用的影响，市场参与者的风险偏好明显下降，市场快速下跌，幅度较大。随后，市场逐渐进入存量博弈的反弹行情，不同股票间分化逐渐变大。除去年初极端的下跌外，一方面，存量博弈环境下市场估值难以有效提升，偏高的市场估值以及人民币贬值预期等因素的存在也制约了投资者风险偏好的改善，而另一方面，相对充裕的流动性也给予市场一定的支撑，使得市场出现连续向下调整的概率偏低，在此过程中个股分化逐渐加剧，投资热点此起彼伏，切换速度明显偏快。行业和风格方面，景气度高以及防御类行业表现较好，而高估值的行业仍处于估值消化过程，表现相对较差，与此同时，市场参与者的投资风格逐渐向价值类股票倾斜。食品饮料、银行、有色和家电等行业表现居前，而传媒、计算机、餐饮旅游和交通运输等行业跌幅相对较大。

本基金始终坚持以研究部的模拟组合为蓝本构建投资组合，坚持执行自下而上精选个股的投资策略，股票仓位保持在 85%以上，行业偏离基准幅度控制在较小范围内，基于企业内在价值的细致基础研究的投资模式成为获取超额收益来源的重要方式。

### 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 1.084 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.44%，业绩比较基准收益率为-16.70%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在经历了一季度较大幅度的调整后，二季度存量博弈氛围浓厚，同时，截至上半年底，无论是市场整体波动率还是风格波动率均已降低至历史较低水平，在市场整体估值相比历史平均水平并不偏低的情况下，低波动率不利于市场系统性风险的释放。尽管宽松的货币政策依旧存在，近期融资余额也有所增加，我们仍预期市场新增资金有限，同时考虑到未来人民币贬值预期一直存在，因此，市场投资者情绪处于偏谨慎状态概率较大。展望下半年，市场仍处于震荡消化系统性风险过程之中，存量博弈格局依旧，预期指数难有较大上行空间，精选个股仍是当前结构性行

情中的优异策略。

具体操作上，本基金将继续在行业中性的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，力争为持有人创造更多的超额收益。

#### 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

本基金的基金管理人于 2016 年 5 月 27 日发布《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金 2016 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 5 月 20 日，每 10 份基金份额发放现金红利 5.5470 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 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：嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

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<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                   |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 39,056,014.52     | 48,318,561.23       |
| 结算备付金      |         | 3,570,232.99      | 244,856.05          |
| 存出保证金      |         | 243,327.97        | 239,899.27          |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 580,642,237.42    | 292,526,443.17      |
| 其中：股票投资    |         | 580,642,237.42    | 292,526,443.17      |
| 基金投资       |         | -                 | -                   |
| 债券投资       |         | -                 | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                 | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                 | -                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                 | -                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 40,000,000.00     | -                   |
| 应收证券清算款    |         | 11,121.27         | 1,115,205.04        |
| 应收利息       | 6.4.7.5 | 15,597.39         | 17,996.74           |
| 应收股利       |         | -                 | -                   |
| 应收申购款      |         | 257,982.27        | 73,619.79           |
| 递延所得税资产    |         | -                 | -                   |
| 其他资产       | 6.4.7.6 | -                 | -                   |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产总计            |            | 663,796,513.83            | 342,536,581.29              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | -                         | 830,472.81                  |
| 应付赎回款           |            | 1,746,950.80              | 8,474,015.82                |
| 应付管理人报酬         |            | 798,806.72                | 296,990.12                  |
| 应付托管费           |            | 133,134.44                | 49,498.34                   |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 408,807.51                | 224,192.92                  |
| 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    | 159,362.88                | 211,286.27                  |
| 负债合计            |            | 3,247,062.35              | 10,086,456.28               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 609,148,192.88            | 178,316,364.87              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 51,401,258.60             | 154,133,760.14              |
| 所有者权益合计         |            | 660,549,451.48            | 332,450,125.01              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 663,796,513.83            | 342,536,581.29              |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.084 元，基金份额总额 609,148,192.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

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<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年6月30日 |
|-------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b> |          | -12,328,923.83                 | 111,877,784.33                      |
| 1.利息收入      |          | 217,069.86                     | 162,420.84                          |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 205,948.59                     | 153,531.95                          |
| 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  |          | 11,121.27                      | 8,888.89                            |
| 其他利息收入      |          | -                              | -                                   |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 2.投资收益        |          | -18,150,984.28 | 117,064,426.43 |
| 其中：股票投资收益     | 6.4.7.12 | -21,145,223.03 | 115,408,097.05 |
| 基金投资收益        |          | -              | -              |
| 债券投资收益        | 6.4.7.13 | -              | -              |
| 资产支持证券投资收益    |          | -              | -              |
| 贵金属投资收益       |          | -              | -              |
| 衍生工具收益        | 6.4.7.14 | -              | -              |
| 股利收益          | 6.4.7.15 | 2,994,238.75   | 1,656,329.38   |
| 3.公允价值变动收益    | 6.4.7.16 | 5,445,312.75   | -6,137,544.54  |
| 4.汇兑收益        |          | -              | -              |
| 5.其他收入        | 6.4.7.17 | 159,677.84     | 788,481.60     |
| <b>减：二、费用</b> |          | 3,716,179.16   | 3,634,432.71   |
| 1. 管理人报酬      |          | 2,310,148.60   | 2,038,240.29   |
| 2. 托管费        |          | 385,024.75     | 339,706.68     |
| 3. 销售服务费      |          | -              | -              |
| 4. 交易费用       | 6.4.7.18 | 905,392.70     | 1,061,231.86   |
| 5. 利息支出       |          | -              | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |          | -              | -              |
| 6. 其他费用       | 6.4.7.19 | 115,613.11     | 195,253.88     |
| <b>三、利润总额</b> |          | -16,045,102.99 | 108,243,351.62 |
| 减：所得税费用       |          | -              | -              |
| <b>四、净利润</b>  |          | -16,045,102.99 | 108,243,351.62 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

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<br>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）          | 178,316,364.87                        | 154,133,760.14  | 332,450,125.01  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                                     | -16,045,102.99  | -16,045,102.99  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | 430,831,828.01                        | 261,799,371.16  | 692,631,199.17  |
| 其中：1.基金申购款               | 529,614,699.03                        | 301,767,434.46  | 831,382,133.49  |
| 2.基金赎回款                  | -98,782,871.02                        | -39,968,063.30  | -138,750,934.32 |
| 四、本期向基金份额持               | -                                     | -348,486,769.71 | -348,486,769.71 |

|                           |                                 |                 |                 |
|---------------------------|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 有人分配利润产生的基金净值变动           |                                 |                 |                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)           | 609,148,192.88                  | 51,401,258.60   | 660,549,451.48  |
| 项目                        | 上年度可比期间<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(基金净值)           | 152,523,606.21                  | 63,231,092.25   | 215,754,698.46  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)  | -                               | 108,243,351.62  | 108,243,351.62  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -53,776,152.19                  | -71,476,225.60  | -125,252,377.79 |
| 其中：1.基金申购款                | 312,249,106.60                  | 241,859,122.79  | 554,108,229.39  |
| 2.基金赎回款                   | -366,025,258.79                 | -313,335,348.39 | -679,360,607.18 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -                               | -               | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)           | 98,747,454.02                   | 99,998,218.27   | 198,745,672.29  |

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

嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]213号《关于核准嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集365,662,653.80元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第316号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金基金合同》于2013年5月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为365,790,517.47份基金份额,其中认购资金利息折合127,863.67份基金份额。本基金的



基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例范围为：股票资产占基金资产的比例为 85%-95%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 0%-15%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 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》、《嘉实研究阿尔法股票型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<br>2016年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款           | 39,056,014.52     |
| 定期存款           | -                 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                 |
| 其他存款           | -                 |
| 合计：            | 39,056,014.52     |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2016年6月30日 |                |               |
|-------------------|-------------------|----------------|---------------|
|                   | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票                | 558,123,712.04    | 580,642,237.42 | 22,518,525.38 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -              | -             |
| 债券                | 交易所市场             | -              | -             |
|                   | 银行间市场             | -              | -             |
|                   | 合计                | -              | -             |
| 资产支持证券            | -                 | -              | -             |
| 基金                | -                 | -              | -             |
| 其他                | -                 | -              | -             |
| 合计                | 558,123,712.04    | 580,642,237.42 | 22,518,525.38 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目                   | 本期末<br>2016年6月30日 |           |
|----------------------|-------------------|-----------|
|                      | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间同业市场买入返<br>售金融资产款 | -                 | -         |
| 交易所市场买入返售金<br>融资产款   | 40,000,000.00     | -         |
| 合计                   | 40,000,000.00     | -         |

**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<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 14,048.70              |
| 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  | 1,445.94               |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 4.20                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 98.55                  |
| 合计         | 15,597.39              |

**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<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 408,807.51             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 408,807.51             |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 4,938.56               |
| 预提费用        | 154,424.32             |
| 应付指数使用费     | -                      |
| 其他          | -                      |
| 合计          | 159,362.88             |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>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 | 178,316,364.87                        | 178,316,364.87 |
| 本期申购 | 529,614,699.03                        | 529,614,699.03 |
| 本期赎回 | -98,782,871.02                        | -98,782,871.02 |
| 本期末  | 609,148,192.88                        | 609,148,192.88 |

注：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

**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           | 170,823,262.44  | -16,689,502.30  | 154,133,760.14  |
| 本期利润           | -21,490,415.74  | 5,445,312.75    | -16,045,102.99  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 349,915,045.83  | -88,115,674.67  | 261,799,371.16  |
| 其中：基金申购款       | 415,450,621.13  | -113,683,186.67 | 301,767,434.46  |
| 基金赎回款          | -65,535,575.30  | 25,567,512.00   | -39,968,063.30  |
| 本期已分配利润        | -348,486,769.71 | -               | -348,486,769.71 |
| 本期末            | 150,761,122.82  | -99,359,864.22  | 51,401,258.60   |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>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 | 7,861.81                              |
| 其他        | 33,112.29                             |
| 合计        | 205,948.59                            |

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
|            | 卖出股票成交总额                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 279,489,817.54                        |

|          |                |
|----------|----------------|
| 买卖股票差价收入 | -21,145,223.03 |
|----------|----------------|

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

#### 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<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,994,238.75               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 2,994,238.75               |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 5,445,312.75               |
| ——股票投资     | 5,445,312.75               |
| ——债券投资     | -                          |
| ——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         | 5,445,312.75               |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 基金赎回费收入   | 153,328.78                 |
| 基金转出费收入   | 6,349.06                   |
| 债券认购手续费返还 | -                          |
| 印花税手续费返还  | -                          |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 159,677.84                 |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 905,392.70                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 905,392.70                 |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 29,835.26                  |
| 信息披露费     | 74,589.06                  |
| 债券托管账户维护费 | 6,000.00                   |
| 银行划款手续费   | 4,808.79                   |
| 指数使用费     | -                          |
| 上市年费      | -                          |
| 红利手续费     | -                          |
| 其他        | 380.00                     |
| 合计        | 115,613.11                 |

**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 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 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                              | 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管理费  | 2,310,148.60                    | 2,038,240.29                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 222,336.04                      | 389,675.11                      |

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                              | 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 | 385,024.75                      | 339,706.68                      |

注：支付基金托管人中国农业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

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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国农业银行 | 39,056,014.52                         | 164,974.49 | 33,180,479.27                              | 145,206.52 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

| 序号 | 权益登记日           | 除息日 |                 | 每 10 份<br>基金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计   | 备注 |
|----|-----------------|-----|-----------------|-----------------------|----------------|---------------|----------------|----|
|    |                 | 场内  | 场外              |                       |                |               |                |    |
| 1  | 2016 年 5 月 30 日 | -   | 2016 年 5 月 30 日 | 5.5470                | 341,333,418.51 | 7,153,351.20  | 348,486,769.71 |    |
| 合计 | -               | -   |                 | 5.5470                | 341,333,418.51 | 7,153,351.20  | 348,486,769.71 |    |

**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**

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<br>估值单<br>价 | 复牌<br>日期       | 复牌<br>开盘单价 | 数量（股）  | 期末<br>成本总额   | 期末估值总<br>额   | 备注 |
|--------|------|------------------|--------|----------------|----------------|------------|--------|--------------|--------------|----|
| 000002 | 万科 A | 2015 年 12 月 18 日 | 重大事项停牌 | 18.20          | 2016 年 7 月 4 日 | 21.99      | 91,600 | 1,324,379.09 | 1,667,120.00 | -  |

|        |      |            |        |       |            |       |         |              |              |   |
|--------|------|------------|--------|-------|------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 000401 | 冀东水泥 | 2016年4月6日  | 重大事项停牌 | 10.60 | 2016年7月14日 | 11.32 | 148,100 | 1,584,707.93 | 1,569,860.00 | - |
| 000932 | 华菱钢铁 | 2016年3月28日 | 重大事项停牌 | 3.95  | 2016年8月8日  | 4.35  | 262,062 | 915,108.46   | 1,035,144.90 | - |
| 002347 | 泰尔重工 | 2016年4月5日  | 重大事项停牌 | 19.45 | 2016年7月18日 | 21.40 | 61,500  | 839,080.12   | 1,196,175.00 | - |
| 300046 | 台基股份 | 2016年3月7日  | 重大事项停牌 | 21.96 | -          | -     | 15,200  | 280,860.24   | 333,792.00   | - |
| 300353 | 东土科技 | 2016年6月23日 | 重大事项停牌 | 22.09 | -          | -     | 63,000  | 1,139,502.80 | 1,391,670.00 | - |
| 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 | 28,599  | 768,993.02   | 784,756.56   | - |

#### 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

本基金为股票型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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严格控制风险的前提下，力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报，谋求基金资产的长期增值。

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工作流程、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，本基金未持有债券投资(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<br>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              | 39,056,014.52 | -    | -    | -              | 39,056,014.52  |
| 结算备付金             | 3,570,232.99  | -    | -    | -              | 3,570,232.99   |
| 存出保证金             | 243,327.97    | -    | -    | -              | 243,327.97     |
| 交易性金融资产           | -             | -    | -    | 580,642,237.42 | 580,642,237.42 |
| 衍生金融资产            | -             | -    | -    | -              | -              |
| 买入返售金融资产          | 40,000,000.00 | -    | -    | -              | 40,000,000.00  |
| 应收证券清算款           | -             | -    | -    | 11,121.27      | 11,121.27      |
| 应收利息              | -             | -    | -    | 15,597.39      | 15,597.39      |
| 应收股利              | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收申购款             | 42,271.56     | -    | -    | 215,710.71     | 257,982.27     |
| 递延所得税资产           | -             | -    | -    | -              | -              |
| 其他资产              | -             | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计              | 82,911,847.04 | -    | -    | 580,884,666.79 | 663,796,513.83 |
| 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               | -             | -    | -    | 1,746,950.80   | 1,746,950.80   |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 798,806.72     | 798,806.72     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 133,134.44     | 133,134.44     |
| 应付销售服务费             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 408,807.51     | 408,807.51     |
| 应交税费                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付利息                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付利润                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 递延所得税负债             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 159,362.88     | 159,362.88     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 3,247,062.35   | 3,247,062.35   |
| 利率敏感度缺口             | 82,911,847.04 | -    | -    | 577,637,604.44 | 660,549,451.48 |
| 上年度末<br>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                | 48,318,561.23 | -    | -    | -              | 48,318,561.23  |
| 结算备付金               | 244,856.05    | -    | -    | -              | 244,856.05     |
| 存出保证金               | 239,899.27    | -    | -    | -              | 239,899.27     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 292,526,443.17 | 292,526,443.17 |
| 衍生金融资产              | -             | -    | -    | -              | -              |
| 买入返售金融资产            | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 1,115,205.04   | 1,115,205.04   |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 17,996.74      | 17,996.74      |
| 应收股利                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收申购款               | 20,339.18     | -    | -    | 53,280.61      | 73,619.79      |
| 递延所得税资产             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 其他资产                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计                | 48,823,655.73 | -    | -    | 293,712,925.56 | 342,536,581.29 |
| 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             | -             | -    | -    | 830,472.81     | 830,472.81     |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 8,474,015.82   | 8,474,015.82   |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 296,990.12     | 296,990.12     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 49,498.34      | 49,498.34      |
| 应付销售服务费             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 224,192.92     | 224,192.92     |
| 应交税费                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付利息                | -             | -    | -    | -              | -              |

|         |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应付利润    | -             | - | - | -              | -              |
| 递延所得税负债 | -             | - | - | -              | -              |
| 其他负债    | -             | - | - | 211,286.27     | 211,286.27     |
| 负债总计    | -             | - | - | 10,086,456.28  | 10,086,456.28  |
| 利率敏感度缺口 | 48,823,655.73 | - | - | 283,626,469.28 | 332,450,125.01 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：无)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 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<br>2016 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 580,642,237.42         | 87.90         | 292,526,443.17           | 87.99         |
| 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            | 580,642,237.42         | 87.90         | 292,526,443.17           | 87.99         |

#### 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%          | 33,919,214.33                 | 16,342,517.85           |
| 业绩比较基准下降 5% | -33,919,214.33       | -16,342,517.85                |                         |

#### 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 572,663,718.96 元，属于第二层次的余额为 7,978,518.46 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 281,889,703.11 元，第二层次 10,636,740.06 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   | 580,642,237.42 | 87.47         |
|    | 其中：股票  | 580,642,237.42 | 87.47         |
| 2  | 固定收益投资 | -              | -             |
|    | 其中：债券  | -              | -             |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | 40,000,000.00  | 6.03   |
|   | 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      | 42,626,247.51  | 6.42   |
| 7 | 其他各项资产            | 528,028.90     | 0.08   |
|   | 合计                | 663,796,513.83 | 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         | 8,181,076.88   | 1.24         |
| B  | 采矿业              | 14,331,982.83  | 2.17         |
| C  | 制造业              | 313,653,385.81 | 47.48        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,680,313.13  | 2.22         |
| E  | 建筑业              | 5,794,341.96   | 0.88         |
| F  | 批发和零售业           | 8,538,615.36   | 1.29         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,267,730.92  | 2.61         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,707,114.20  | 3.29         |
| J  | 金融业              | 109,367,839.06 | 16.56        |
| K  | 房地产业             | 35,393,504.92  | 5.36         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 6,769,964.30   | 1.02         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 11,117,041.92  | 1.68         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 620,165.00     | 0.09         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 4,748,952.78   | 0.72         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 8,470,208.35   | 1.28         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 580,642,237.42 | 87.90        |

## 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  | 000488 | 晨鸣纸业 | 3,287,518 | 26,102,892.92 | 3.95         |
| 2  | 601169 | 北京银行 | 1,810,600 | 18,775,922.00 | 2.84         |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 1,904,580 | 16,569,846.00 | 2.51         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 854,100   | 14,946,750.00 | 2.26         |
| 5  | 600340 | 华夏幸福 | 537,284   | 13,098,983.92 | 1.98         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 817,276   | 12,455,286.24 | 1.89         |
| 7  | 300012 | 华测检测 | 897,984   | 11,117,041.92 | 1.68         |
| 8  | 600016 | 民生银行 | 1,203,200 | 10,744,576.00 | 1.63         |
| 9  | 000783 | 长江证券 | 919,000   | 10,660,400.00 | 1.61         |
| 10 | 601998 | 中信银行 | 1,588,900 | 9,009,063.00  | 1.36         |
| 11 | 600007 | 中国国贸 | 423,600   | 8,556,720.00  | 1.30         |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 612,600   | 7,651,374.00  | 1.16         |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 466,700   | 7,574,541.00  | 1.15         |
| 14 | 600376 | 首开股份 | 657,725   | 7,313,902.00  | 1.11         |
| 15 | 300296 | 利亚德  | 212,598   | 6,730,852.68  | 1.02         |
| 16 | 601006 | 大秦铁路 | 982,650   | 6,328,266.00  | 0.96         |
| 17 | 300196 | 长海股份 | 156,900   | 6,145,773.00  | 0.93         |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 255,324   | 6,056,285.28  | 0.92         |
| 19 | 002035 | 华帝股份 | 246,507   | 6,034,491.36  | 0.91         |
| 20 | 300200 | 高盟新材 | 366,634   | 5,976,134.20  | 0.90         |
| 21 | 300054 | 鼎龙股份 | 235,200   | 5,884,704.00  | 0.89         |
| 22 | 002446 | 盛路通信 | 178,047   | 5,636,968.02  | 0.85         |
| 23 | 600835 | 上海机电 | 292,100   | 5,605,399.00  | 0.85         |
| 24 | 603167 | 渤海轮渡 | 545,800   | 5,430,710.00  | 0.82         |
| 25 | 002572 | 索菲亚  | 92,800    | 5,198,656.00  | 0.79         |
| 26 | 002007 | 华兰生物 | 161,600   | 5,074,240.00  | 0.77         |
| 27 | 002179 | 中航光电 | 115,500   | 5,003,460.00  | 0.76         |
| 28 | 300084 | 海默科技 | 408,700   | 4,994,314.00  | 0.76         |
| 29 | 600325 | 华发股份 | 429,700   | 4,756,779.00  | 0.72         |
| 30 | 300004 | 南风股份 | 241,838   | 4,740,024.80  | 0.72         |
| 31 | 600816 | 安信信托 | 278,486   | 4,698,058.82  | 0.71         |
| 32 | 600549 | 厦门钨业 | 154,000   | 4,575,340.00  | 0.69         |
| 33 | 002372 | 伟星新材 | 317,720   | 4,562,459.20  | 0.69         |
| 34 | 002425 | 凯撒股份 | 204,700   | 4,503,400.00  | 0.68         |
| 35 | 600525 | 长园集团 | 325,114   | 4,502,828.90  | 0.68         |
| 36 | 601799 | 星宇股份 | 97,800    | 4,481,196.00  | 0.68         |
| 37 | 000858 | 五粮液  | 134,800   | 4,385,044.00  | 0.66         |

|    |        |       |           |              |      |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 38 | 600298 | 安琪酵母  | 243,050   | 4,336,012.00 | 0.66 |
| 39 | 300224 | 正海磁材  | 190,800   | 4,325,436.00 | 0.65 |
| 40 | 000786 | 北新建材  | 474,100   | 4,304,828.00 | 0.65 |
| 41 | 601021 | 春秋航空  | 89,418    | 4,286,698.92 | 0.65 |
| 42 | 300136 | 信维通信  | 202,311   | 4,240,438.56 | 0.64 |
| 43 | 002434 | 万里扬   | 387,400   | 4,214,912.00 | 0.64 |
| 44 | 002271 | 东方雨虹  | 241,900   | 4,167,937.00 | 0.63 |
| 45 | 000969 | 安泰科技  | 294,600   | 4,133,238.00 | 0.63 |
| 46 | 002108 | 沧州明珠  | 156,200   | 4,045,580.00 | 0.61 |
| 47 | 002013 | 中航机电  | 298,106   | 4,018,468.88 | 0.61 |
| 48 | 600259 | 广晟有色  | 69,500    | 3,979,570.00 | 0.60 |
| 49 | 601398 | 工商银行  | 885,900   | 3,933,396.00 | 0.60 |
| 50 | 000902 | 新洋丰   | 309,162   | 3,867,616.62 | 0.59 |
| 51 | 002206 | 海利得   | 225,132   | 3,856,511.16 | 0.58 |
| 52 | 002304 | 洋河股份  | 53,265    | 3,830,818.80 | 0.58 |
| 53 | 000418 | 小天鹅 A | 114,232   | 3,726,247.84 | 0.56 |
| 54 | 600486 | 扬农化工  | 133,700   | 3,663,380.00 | 0.55 |
| 55 | 002196 | 方正电机  | 103,161   | 3,527,074.59 | 0.53 |
| 56 | 000703 | 恒逸石化  | 351,100   | 3,465,357.00 | 0.52 |
| 57 | 600136 | 当代明诚  | 149,600   | 3,463,240.00 | 0.52 |
| 58 | 300258 | 精锻科技  | 214,287   | 3,462,877.92 | 0.52 |
| 59 | 002616 | 长青集团  | 167,100   | 3,458,970.00 | 0.52 |
| 60 | 000065 | 北方国际  | 103,200   | 3,336,456.00 | 0.51 |
| 61 | 000895 | 双汇发展  | 156,400   | 3,265,632.00 | 0.49 |
| 62 | 600782 | 新钢股份  | 606,500   | 3,232,645.00 | 0.49 |
| 63 | 300144 | 宋城演艺  | 129,685   | 3,230,453.35 | 0.49 |
| 64 | 600282 | 南钢股份  | 1,324,300 | 3,112,105.00 | 0.47 |
| 65 | 002111 | 威海广泰  | 117,800   | 3,096,962.00 | 0.47 |
| 66 | 600138 | 中青旅   | 158,000   | 3,052,560.00 | 0.46 |
| 67 | 002746 | 仙坛股份  | 71,800    | 2,992,624.00 | 0.45 |
| 68 | 600261 | 阳光照明  | 401,433   | 2,834,116.98 | 0.43 |
| 69 | 002478 | 常宝股份  | 252,000   | 2,832,480.00 | 0.43 |
| 70 | 002426 | 胜利精密  | 285,980   | 2,816,903.00 | 0.43 |
| 71 | 300119 | 瑞普生物  | 173,000   | 2,776,650.00 | 0.42 |
| 72 | 300406 | 九强生物  | 128,574   | 2,757,912.30 | 0.42 |
| 73 | 000028 | 国药一致  | 42,270    | 2,751,777.00 | 0.42 |
| 74 | 300359 | 全通教育  | 92,635    | 2,747,554.10 | 0.42 |
| 75 | 600418 | 江淮汽车  | 214,300   | 2,717,324.00 | 0.41 |
| 76 | 600617 | 国新能源  | 237,000   | 2,716,020.00 | 0.41 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 77  | 600521 | 华海药业 | 110,630 | 2,690,521.60 | 0.41 |
| 78  | 603308 | 应流股份 | 106,400 | 2,674,896.00 | 0.40 |
| 79  | 002450 | 康得新  | 154,267 | 2,637,965.70 | 0.40 |
| 80  | 600426 | 华鲁恒升 | 297,570 | 2,621,591.70 | 0.40 |
| 81  | 002458 | 益生股份 | 59,400  | 2,602,314.00 | 0.39 |
| 82  | 002311 | 海大集团 | 164,620 | 2,596,057.40 | 0.39 |
| 83  | 300017 | 网宿科技 | 38,491  | 2,586,595.20 | 0.39 |
| 84  | 000998 | 隆平高科 | 136,256 | 2,586,138.88 | 0.39 |
| 85  | 600570 | 恒生电子 | 38,700  | 2,583,999.00 | 0.39 |
| 86  | 002078 | 太阳纸业 | 527,100 | 2,572,248.00 | 0.39 |
| 87  | 000892 | 星美联合 | 178,600 | 2,527,190.00 | 0.38 |
| 88  | 600584 | 长电科技 | 124,200 | 2,520,018.00 | 0.38 |
| 89  | 600216 | 浙江医药 | 187,933 | 2,478,836.27 | 0.38 |
| 90  | 002081 | 金螳螂  | 245,298 | 2,457,885.96 | 0.37 |
| 91  | 600452 | 涪陵电力 | 70,100  | 2,342,041.00 | 0.35 |
| 92  | 002594 | 比亚迪  | 38,300  | 2,336,683.00 | 0.35 |
| 93  | 600885 | 宏发股份 | 75,450  | 2,317,069.50 | 0.35 |
| 94  | 002053 | 云南盐化 | 81,400  | 2,310,946.00 | 0.35 |
| 95  | 002563 | 森马服饰 | 210,357 | 2,278,166.31 | 0.34 |
| 96  | 002516 | 旷达科技 | 373,316 | 2,251,095.48 | 0.34 |
| 97  | 300274 | 阳光电源 | 91,241  | 2,226,280.40 | 0.34 |
| 98  | 300294 | 博雅生物 | 35,000  | 2,200,100.00 | 0.33 |
| 99  | 000157 | 中联重科 | 529,400 | 2,186,422.00 | 0.33 |
| 100 | 600887 | 伊利股份 | 130,000 | 2,167,100.00 | 0.33 |
| 101 | 000963 | 华东医药 | 31,617  | 2,130,985.80 | 0.32 |
| 102 | 600276 | 恒瑞医药 | 51,076  | 2,048,658.36 | 0.31 |
| 103 | 600271 | 航天信息 | 85,016  | 2,023,380.80 | 0.31 |
| 104 | 000593 | 大通燃气 | 158,000 | 1,984,480.00 | 0.30 |
| 105 | 601088 | 中国神华 | 140,669 | 1,979,212.83 | 0.30 |
| 106 | 600517 | 置信电气 | 208,000 | 1,978,080.00 | 0.30 |
| 107 | 600856 | 中天能源 | 101,749 | 1,970,878.13 | 0.30 |
| 108 | 002400 | 省广股份 | 139,470 | 1,970,711.10 | 0.30 |
| 109 | 600233 | 大杨创世 | 100,750 | 1,960,595.00 | 0.30 |
| 110 | 300011 | 鼎汉技术 | 82,000  | 1,924,540.00 | 0.29 |
| 111 | 300203 | 聚光科技 | 72,600  | 1,916,640.00 | 0.29 |
| 112 | 002044 | 美年健康 | 129,174 | 1,869,147.78 | 0.28 |
| 113 | 002643 | 万润股份 | 36,150  | 1,839,312.00 | 0.28 |
| 114 | 300232 | 洲明科技 | 115,900 | 1,837,015.00 | 0.28 |
| 115 | 000550 | 江铃汽车 | 72,978  | 1,777,744.08 | 0.27 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 116 | 300291 | 华录百纳  | 75,500  | 1,776,515.00 | 0.27 |
| 117 | 300401 | 花园生物  | 64,400  | 1,751,680.00 | 0.27 |
| 118 | 002707 | 众信旅游  | 86,044  | 1,746,693.20 | 0.26 |
| 119 | 002705 | 新宝股份  | 109,550 | 1,711,171.00 | 0.26 |
| 120 | 000937 | 冀中能源  | 320,100 | 1,702,932.00 | 0.26 |
| 121 | 300047 | 天源迪科  | 85,200  | 1,699,740.00 | 0.26 |
| 122 | 600395 | 盘江股份  | 202,900 | 1,675,954.00 | 0.25 |
| 123 | 002756 | 永兴特钢  | 73,260  | 1,671,793.20 | 0.25 |
| 124 | 000002 | 万科A   | 91,600  | 1,667,120.00 | 0.25 |
| 125 | 300078 | 思创医惠  | 49,200  | 1,645,248.00 | 0.25 |
| 126 | 002583 | 海能达   | 136,400 | 1,642,256.00 | 0.25 |
| 127 | 600498 | 烽火通信  | 67,300  | 1,634,044.00 | 0.25 |
| 128 | 300347 | 泰格医药  | 54,800  | 1,590,296.00 | 0.24 |
| 129 | 000401 | 冀东水泥  | 148,100 | 1,569,860.00 | 0.24 |
| 130 | 002048 | 宁波华翔  | 68,500  | 1,566,595.00 | 0.24 |
| 131 | 002032 | 苏泊尔   | 42,878  | 1,477,147.10 | 0.22 |
| 132 | 300306 | 远方光电  | 59,949  | 1,422,589.77 | 0.22 |
| 133 | 300036 | 超图软件  | 57,600  | 1,411,200.00 | 0.21 |
| 134 | 300353 | 东土科技  | 63,000  | 1,391,670.00 | 0.21 |
| 135 | 300369 | 绿盟科技  | 32,200  | 1,362,382.00 | 0.21 |
| 136 | 002664 | 信质电机  | 39,300  | 1,336,986.00 | 0.20 |
| 137 | 300271 | 华宇软件  | 70,468  | 1,333,254.56 | 0.20 |
| 138 | 002216 | 三全食品  | 150,000 | 1,290,000.00 | 0.20 |
| 139 | 300015 | 爱尔眼科  | 35,300  | 1,289,509.00 | 0.20 |
| 140 | 300494 | 盛天网络  | 27,652  | 1,284,435.40 | 0.19 |
| 141 | 000925 | 众合科技  | 66,000  | 1,273,800.00 | 0.19 |
| 142 | 002138 | 顺络电子  | 68,600  | 1,243,718.00 | 0.19 |
| 143 | 300033 | 同花顺   | 15,200  | 1,238,040.00 | 0.19 |
| 144 | 002357 | 富临运业  | 79,200  | 1,222,056.00 | 0.19 |
| 145 | 002347 | 泰尔重工  | 61,500  | 1,196,175.00 | 0.18 |
| 146 | 002439 | 启明星辰  | 45,172  | 1,166,792.76 | 0.18 |
| 147 | 002281 | 光迅科技  | 18,000  | 1,155,600.00 | 0.17 |
| 148 | 300327 | 中颖电子  | 21,100  | 1,127,373.00 | 0.17 |
| 149 | 002090 | 金智科技  | 37,000  | 1,086,690.00 | 0.16 |
| 150 | 000932 | 华菱钢铁  | 262,062 | 1,035,144.90 | 0.16 |
| 151 | 000661 | 长春高新  | 9,654   | 1,029,888.72 | 0.16 |
| 152 | 000538 | 云南白药  | 14,400  | 925,920.00   | 0.14 |
| 153 | 600546 | *ST山煤 | 288,800 | 886,616.00   | 0.13 |
| 154 | 603899 | 晨光文具  | 48,300  | 854,910.00   | 0.13 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 155 | 600867 | 通化东宝 | 40,920 | 846,634.80 | 0.13 |
| 156 | 300104 | 乐视网  | 15,830 | 837,565.30 | 0.13 |
| 157 | 603555 | 贵人鸟  | 32,751 | 816,482.43 | 0.12 |
| 158 | 002236 | 大华股份 | 60,250 | 789,275.00 | 0.12 |
| 159 | 600511 | 国药股份 | 28,599 | 784,756.56 | 0.12 |
| 160 | 000826 | 启迪桑德 | 20,300 | 620,165.00 | 0.09 |
| 161 | 300113 | 顺网科技 | 15,153 | 575,207.88 | 0.09 |
| 162 | 300465 | 高伟达  | 4,700  | 353,158.00 | 0.05 |
| 163 | 300046 | 台基股份 | 15,200 | 333,792.00 | 0.05 |
| 164 | 002798 | 帝王洁具 | 1,056  | 91,555.20  | 0.01 |
| 165 | 300512 | 中亚股份 | 749    | 74,840.08  | 0.01 |

## 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  | 000488 | 晨鸣纸业 | 22,550,623.89 | 6.78            |
| 2  | 601169 | 北京银行 | 15,564,424.61 | 4.68            |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 12,091,061.11 | 3.64            |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 11,763,738.71 | 3.54            |
| 5  | 000001 | 平安银行 | 11,142,914.93 | 3.35            |
| 6  | 600340 | 华夏幸福 | 10,847,411.48 | 3.26            |
| 7  | 601998 | 中信银行 | 10,436,642.24 | 3.14            |
| 8  | 000783 | 长江证券 | 9,601,851.68  | 2.89            |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 9,341,309.98  | 2.81            |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 7,834,980.50  | 2.36            |
| 11 | 600007 | 中国国贸 | 7,654,305.10  | 2.30            |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 7,432,748.20  | 2.24            |
| 13 | 300012 | 华测检测 | 7,069,433.24  | 2.13            |
| 14 | 600376 | 首开股份 | 7,043,577.91  | 2.12            |
| 15 | 600048 | 保利地产 | 6,941,313.72  | 2.09            |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 6,894,865.38  | 2.07            |
| 17 | 000807 | 云铝股份 | 5,917,895.42  | 1.78            |
| 18 | 000786 | 北新建材 | 5,175,888.66  | 1.56            |
| 19 | 002007 | 华兰生物 | 5,096,067.74  | 1.53            |
| 20 | 300054 | 鼎龙股份 | 5,013,642.66  | 1.51            |

## 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  | 600048 | 保利地产 | 6,751,095.23 | 2.03            |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 6,522,261.64 | 1.96            |
| 3  | 000807 | 云铝股份 | 5,886,854.34 | 1.77            |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 5,166,627.00 | 1.55            |
| 5  | 601009 | 南京银行 | 4,576,280.52 | 1.38            |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 4,490,455.57 | 1.35            |
| 7  | 002466 | 天齐锂业 | 3,813,040.20 | 1.15            |
| 8  | 002299 | 圣农发展 | 3,568,234.04 | 1.07            |
| 9  | 002426 | 胜利精密 | 3,526,897.53 | 1.06            |
| 10 | 600816 | 安信信托 | 3,455,472.00 | 1.04            |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 3,271,626.11 | 0.98            |
| 12 | 600844 | 丹化科技 | 3,071,228.00 | 0.92            |
| 13 | 002458 | 益生股份 | 2,905,177.32 | 0.87            |
| 14 | 601992 | 金隅股份 | 2,747,266.00 | 0.83            |
| 15 | 600705 | 中航资本 | 2,735,464.00 | 0.82            |
| 16 | 600562 | 国睿科技 | 2,730,782.51 | 0.82            |
| 17 | 300136 | 信维通信 | 2,637,652.26 | 0.79            |
| 18 | 000671 | 阳光城  | 2,580,596.59 | 0.78            |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 2,400,767.00 | 0.72            |
| 20 | 600547 | 山东黄金 | 2,374,029.00 | 0.71            |

## 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 | 562,160,299.04 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 258,344,594.51 |

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。



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

报告期末，本基金未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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   | 243,327.97 |
| 2  | 应收证券清算款 | 11,121.27  |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 15,597.39  |
| 5  | 应收申购款   | 257,982.27 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
|    | 合计      | 528,028.90 |

**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**

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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 8,832        | 68,970.58     | 538,721,709.29 | 88.44%     | 70,426,483.59 | 11.56%     |

**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 | 454.31    | 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<br>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（2013年5月28日）基金份额总额 | 365,790,517.47 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 178,316,364.87 |
| 本报告期基金总申购份额               | 529,614,699.03 |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 98,782,871.02  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 609,148,192.88 |

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

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

#### 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 |
|------|------|-----------|
|------|------|-----------|

|                  | 交易单元<br>数量 | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 备注 |
|------------------|------------|----------------|----------------------|------------|----------------|----|
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 2          | 342,469,229.92 | 41.75%               | 239,733.18 | 41.75%         | -  |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | 1          | 191,580,808.55 | 23.35%               | 134,106.60 | 23.35%         | -  |
| 光大证券股份<br>有限公司   | 1          | 132,537,785.10 | 16.16%               | 92,778.16  | 16.16%         | -  |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | 1          | 94,689,724.40  | 11.54%               | 66,282.85  | 11.54%         | -  |
| 长城证券股份<br>有限公司   | 1          | 59,094,667.96  | 7.20%                | 41,366.32  | 7.20%          | -  |
| 安信证券股份<br>有限公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国都证券股份<br>有限公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国盛证券有限<br>责任公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 2          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国信证券股份<br>有限公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 国元证券股份<br>有限公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 申万宏源证券<br>有限公司   | 2          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 世纪证券有限<br>责任公司   | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |

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：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：德邦证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

### 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 |              |
|--------------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|              | 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 |
| 中银国际证券有限责任公司 | -    | -            | 80,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 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  | 嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金 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 |
| 2  | 关于增加中信银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2016 年 1 月 27 日 |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 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  |

|    |   |                        |                 |
|----|---|------------------------|-----------------|
| 6  | 关于增加北京惠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  |
| 7  | 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  |
| 8  | 关于增加上海好买基金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 4 月 18 日 |
| 9  | 关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与平安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 5 月 3 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 | 嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金 2016 年第一次收益分配公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2016 年 5 月 27 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 | 关于增加徽商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 6 月 1 日  |
| 14 | 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  |
| 15 | 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     | 2016 年 6 月 30 日 |

|  |  |      |  |
|--|--|------|--|
|  |  | 理人网站 |  |
|--|--|------|--|

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实研究阿尔法股票型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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日