

嘉实事件驱动股票型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期基金无利润分配。

本报告期内2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

嘉实事件驱动股票型证券投资基金

基金主代码 001416

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年6月7日

报告期末基金资产总额 14,716,234,561.01份

投资目标 立足于中国经济的投资环境，将上市公司的观察对象投资策略和机制

投资策略 在深入挖掘公司治理、行业经营、结构变化以及行业

风险特征 本基金主要投资于股票市场，通过精选个股，选择

基金经理管理的基金资产，力争为基金份额持有人创造

基金经理 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 2,180,116,467.71

2.本期利润 -1,938,784,811.11

3.本期末余额 2,124,227,596.26

4.期末未分配利润 -12,116

5.期末可供分配利润 11,234,227,596.26

注：本基金已实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）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未分配利润（即上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④

过去三个月 -13.69% 12.2% -22.4% 9.6% -20.7%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 -2,180,116,467.71

2.本期利润 -1,938,784,811.11

3.本期末余额 -2,124,227,596.26

4.期末未分配利润 -12,116

5.期末可供分配利润 11,234,227,596.26

注：本基金已实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）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未分配利润（即上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字）。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张自力 本基金、嘉实美国存托凭证(ODI)基金经理、定期报告负责人 2015年6月9日 - 19年 理论物理博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科技大学，具有丰富的海外市场研究经验，曾任美国投资银行家协会（Investment Bankers Association of America）资深研究员，研究总监总经理助理，负责直接投资、并购、重组、海外上市等项目的多宗交易，具备深厚的金融和海外市场资金方面的经验。2012年加入嘉实基金管理有限公司，担任基金经理、定期报告负责人，现兼任定期报告负责人。

注：(1)任本基金基金经理时基金合同生效之日；(2)证券从业的年限从业之日起至本基金从业人员开始从事基金工作之日止。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金运作严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《嘉实事件驱动型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，不存在损害基金持有人谋取非法利益。本基金运作管理符合有关法律法规的规定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等交易原则的执行情况

报告期内，公司所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同向反向交易较少的单边交易量虽然占总成交量的比例较小，不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司不存在利用内幕信息进行交易的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作情况

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

4.4.2 报告期内基金投资组合运作情况的说明

4.4.3 报告期内基金投资组合运作情况的总说明

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望第四季度，在经济方面看，目前货币政策仍然宽松，无风险利率继续下行，大量资金仍在寻找低风险资产，温和通胀预期下，无风险利率可能继续下行，但之后将进入加息周期，因此存在一定的不确定性。

我们预计第四季度利率将呈现先升后降的结构性行情，市场大幅反弹概率较低，但仍有反弹可能。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 -11,637,730.41

2.本期利润 -10,402,646.59

3.本期末余额 915,446,294.22

4.期末未分配利润 1,192

注：本基金本期实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，(2)上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用。

3.2 基金资产净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④

过去三个月 -2.30% 0.66% 1.44% 0.01% -2.74% 0.6%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 -11,637,730.41

2.本期利润 -10,402,646.59

3.本期末余额 915,446,294.22

4.期末未分配利润 1,192

注：本基金本期实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，(2)上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

曲扬 本基金基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人 2014年4月18日 - 11年 曾任中信基金管理研究部和债券部基金经理，嘉实基金管理有限公司基金经理，现任中信基金管理研究部和债券部基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人，具有基金从业资格。

胡永青 本基金基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人 2015年4月18日 - 12年 曾任嘉实基金管理有限公司基金经理，嘉实基金管理有限公司基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人，具有基金从业资格。

注：(1)任本基金基金经理时基金合同生效之日；(2)证券从业的年限从业之日起至本基金从业人员开始从事基金工作之日止。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《嘉实事件驱动型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，不存在损害基金持有人谋取非法利益。本基金运作管理符合有关法律法规的规定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等交易原则的执行情况

报告期内，公司所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同向反向交易较少的单边交易量虽然占总成交量的比例较小，不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司不存在利用内幕信息进行交易的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作情况

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

4.4.2 报告期内基金投资组合运作情况的说明

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望第四季度，在经济方面看，目前货币政策仍然宽松，无风险利率继续下行，大量资金仍在寻找低风险资产，温和通胀预期下，无风险利率可能继续下行，但之后将进入加息周期，因此存在一定的不确定性。

我们预计第四季度利率将呈现先升后降的结构性行情，市场大幅反弹概率较低，但仍有反弹可能。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 -11,637,730.41

2.本期利润 -10,402,646.59

3.本期末余额 915,446,294.22

4.期末未分配利润 1,192

注：本基金本期实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，(2)上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用。

3.2 基金资产净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④

过去三个月 -2.30% 0.66% 1.44% 0.01% -2.74% 0.6%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初余额 -11,637,730.41

2.本期利润 -10,402,646.59

3.本期末余额 915,446,294.22

4.期末未分配利润 1,192

注：本基金本期实现收益指基金本期收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，(2)上期述基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项费用。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

曲扬 本基金基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人 2014年4月18日 - 11年 曾任中信基金管理研究部和债券部基金经理，嘉实基金管理有限公司基金经理，现任中信基金管理研究部和债券部基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人，具有基金从业资格。

胡永青 本基金基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人 2015年4月18日 - 12年 曾任嘉实基金管理有限公司基金经理，嘉实基金管理有限公司基金经理，嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金经理，定期报告负责人，具有基金从业资格。

注：(1)任本基金基金经理时基金合同生效之日；(2)证券从业的年限从业之日起至本基金从业人员开始从事基金工作之日止。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《嘉实事件驱动型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，不存在损害基金持有人谋取非法利益。本基金运作管理符合有关法律法规的规定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等交易原则的执行情况

报告期内，公司所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同向反向交易较少的单边交易量虽然占总成交量的比例较小，不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司不存在利用内幕信息进行交易的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作情况

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

操作上，本基金基于资产流动性的考虑，严格控制仓位，降低杠杆率，期末逐步降低久期，降低杠杆，提升组合信用等级。

4.4.2 报告期内基金投资组合运作情况的说明

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望第四季度，在经济方面看，目前货币政策仍然宽松，无风险利率继续下行，大量资金仍在寻找低风险资产，温和通胀