嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

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

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实如意宝定期债券	
基金主代码	000113	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月4日	
报告期末基金份额总额	96,873,846.30份	
投资目标	本基金谋求本金稳妥和稳定收益,在此基础上力争较高回报。	
投资策略	本基金运用“嘉实下行风险波动模型”控制组合较低波动幅度。在此基础上,本基金将深刻的基本面研究、严谨的债券分析与主动的投资风格相结合,通过“自上而下”的宏观研究与“自下而上”的微观分析,挖掘风险收益优化,满足组合收益和流动性要求的投资机会,确定和调整基金资产在非信用类固定收益类证券(国债、央行票据、政策性金融债等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例,力争持续稳定的收益,并择机少量投资可转债,谋求增强收益。	
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+0.5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
下属分级基金的交易代码	000113	000115
报告期末下属分级基金的份额总额	53,780,659.30份	43,093,187.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)	
	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
1. 本期已实现收益	1,674,067.95	971,958.61
2. 本期利润	1,442,462.03	936,098.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0232	0.0218
4. 期末基金资产净值	61,107,363.36	48,767,829.64
5. 期末基金份额净值	1.136	1.132

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)嘉实如意宝定期债券A/B收取认(申)购费,嘉实如意宝定期债券C不收取认(申)购费但计提销售服务费。(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

嘉实如意宝定期债券A/B

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.97%	0.07%	0.61%	0.01%	1.36%	0.06%

嘉实如意宝定期债券C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.98%	0.07%	0.61%	0.01%	1.37%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

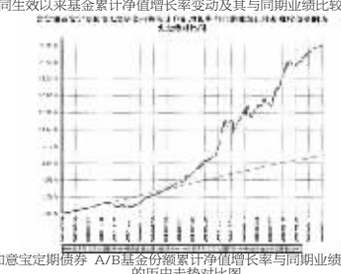

图1:嘉实如意宝定期债券 A/B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月4日至2015年9月30日)

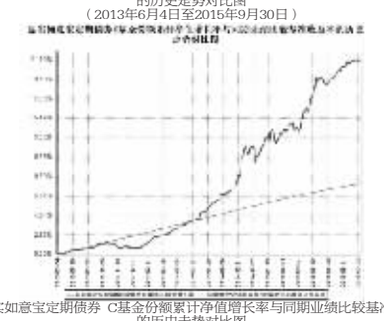

图2:嘉实如意宝定期债券 C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月4日至2015年9月30日)

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 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实丰益信用定期债券基金经理	2013年6月4日	-	11年	经济学硕士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2005年开始从事投资相关工作,曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。

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遵规守信情况的说明

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、《嘉实如意宝定期开放债券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 公平交易专项说明

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未超过该证券当日成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,宏观经济整体运行格局依然低迷,数据持续低于预期。其中工业增加值增速持续在6.0%左右的低位徘徊,城镇固定资产投资增速由6月末的11.4%回落至8月份的10.9%,出口增速由在7,8月份连续两个月出现负增长。同时在稳增长措施推动下,广义货币增速近两月有所反弹,贷款增速也有所回升,财政支出力度有所加大。CPI已经呈现出底部抬升走势,而PPI受制于内需不振,外部大宗商品价格持续下跌的影响,同比增速依然不断创出新低。

三季度在基本面低迷以及权益类市场大幅调整的背景下,天量资金开始回流银行理财及广义基金,投资标的由权益及权益类相关产品向债券产品转变,配置压力加大,资产荒带来了债券市场的上涨。八月的汇改对债市走势带来扰动,对资本外流的担忧引发了债券的调整,但随着汇率预期逐步稳定,债市重回基本面和资金面推动的局面,季度范围内出现一波明显的上涨行情,中长端利率债下行20-30bp,信用息差进一步压缩。

权益市场在3季度出现巨幅震荡,触发因素是监管层对于配资问题的查处,而深层原因我们认为是市场估值和基本面的持续背离以及在前期蕴含了较大的风险。

报告期内本基金本着稳健投资原则,在风险和收益之间进行平衡。在获取绝对回报为主的前提下,增强策略灵活性,大类资产配置上三季度维持接近0仓位的权益类配置,开放期结束后增加债券品种投资,特别加大利率品种的投资力度,维持中性杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实如意宝定期债券A/B基金份额净值为1.136元,本报告期基金份额净值增长率为1.97%;截至报告期末嘉实如意宝定期债券C基金份额净值为1.132元,本报告期基金份额净值增长率为1.98%;同期业绩比较基准收益率为0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期高频数据仍然显示经济前景并不乐观,前期货币政持续宽松,地产销量持续恢复,财政支出力度明显加大,管理层稳增长举措不断推出等政策很难估计对经济的作用会何时体现,但相比较于目前市场对经济的悲观预期,下阶段经济数据继续大幅低于预期的概率在降低,有望出现阶段性的平稳走势。同时CPI与PPI均面临着较低的基数效应,外围大宗商品进入9月份以后也进入底部震荡,停止了进一步的下跌。因此我们预计四季度CPI将延续低位回升,PPI可能出现拐点。

目前整个债券市场增量资金进入明显,整体收益持续下行,利率债收益率处于历史中枢偏低水平,高等级信用债利差已经处于历史最低水平区间。在宏观经济趋势持续,央行货币政策保持宽松的大格局下整体风险尚可。但部分债券品种出现估值泡沫迹象,需要特别关注部分行业信用基本面持续恶化现象,当前此类行业债券的信用利差并未充分反映,季度内有几个信用风险的关注点,需要密切关注事件进展。从大类资产配置角度而言,由于目前债市整体收益率也出现下降,而权益市场经过前期大幅下跌,风险收益比也逐渐落入合理水平,若权益类市场的触底反弹,前期避险资金对于债市的推动作用可能也会有所减弱。

综合来看,我们认为四季度债市将进入震荡休整状态,需要观察资金面的波动水平,当前的收益率水平或已经部分蕴含了经济继续下滑的预期,需要关注经济超预期企稳的风险。

本基金将继续本着稳健投资的原则,以中高等级信用债为主,积极运用杠杆策略,自下而上精选中低等级信用债,同时做好久期管理,关注可能的可转债再融资开闸,提高对权益类关注度,加大对中长期利率债的关注,整体操作上中性,平衡类属配置。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	133,004,209.18	94.60
	其中:债券	133,004,209.18	94.60
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,118,056.11	2.93
7	其他资产	3,467,656.90	2.47
	合计	140,589,922.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	102,944,209.18	93.69
5	企业短期融资券	20,136,000.00	18.33
6	中期票据	9,924,000.00	9.03
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	133,004,209.18	121.05

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112044	11中泰01	100,000	10,874,000.00	9.90
2	112002	08中联债	105,000	10,679,550.00	9.72
3	122596	12沪城开	100,000	10,664,000.00	9.71
4	011599208	15包钢集SCP004	100,000	10,080,000.00	9.17
5	011599244	15吉利SCP002	100,000	10,056,000.00	9.15

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,692.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,458,964.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,467,656.90

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
报告期期初基金份额总额	104,947,749.11	47,279,034.73
报告期期间基金总申购份额	9,990,408.12	18,416,020.59
减:报告期期间基金总赎回份额	61,157,497.93	22,601,868.32
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	53,780,659.30	43,093,187.00

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实如意宝定期开放债券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)报告期内嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

(1)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)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

8.3 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
2015年10月27日

深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

【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。

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

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实深证基本面120ETF
场内简称	深F120
基金主代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
报告期末基金份额总额	62,906,143.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面120指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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.本期已实现收益	-37,498,170.47
2.本期利润	-43,650,515.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6261
4.期末基金资产净值	70,790,348.51
5.期末基金份额净值	1.1253

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-32.10%	3.19%	-32.67%	3.48%	0.57%	-0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

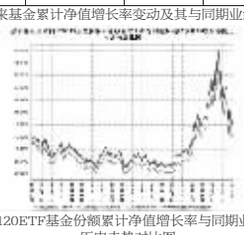

图:嘉实深证基本面120ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年8月1日至2015年9月30日)

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3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“十五、基金的投资(二)投资范围和(八)2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(ODII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODII-FOF-LOF)基金经理,公司指数投资部总监	2014年3月11日	-	17年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家(天同)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《深证基本面120交易型开放式指数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 公平交易专项说明

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未超过该证券当日成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.31%,年度化拟合偏离度为4.88%。本季度初市场发生剧烈震荡,报告期内市场持续多日发生巨幅波动,且指数成份股停牌股票比例较大及基金申购赎回等因素,导致了报告期内基金的跟踪误差与正常市场情况相比较大。

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1.1253元;本报告期基金份额净值增长率为-32.10%,业绩比较基准收益率为-32.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,将继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,950,854.32	98.10
	其中:股票	69,950,854.32	98.10
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	-	-
	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	1,346,720.91	1.89
7	其他资产	11,656.20	0.02
	合计	71,309,231.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	1,859,045.02	2.63
C	制造业	42,895,114.78	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,756,855.94	2.48
E	建筑业	596,870.70	0.84
F	批发和零售业	2,777,685.96	3.92
G	交通运输、仓储和邮政业	729,537.69	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	483,979.00	0.68
J	金融业	5,645,884.51	7.98
K	房地产业	12,267,929.52	17.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	937,951.20	1.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,950,854.32	98.81

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	634,227	8,073,709.71	11.41
2	000651	格力电器	215,894	3,493,164.92	4.93
3	000858	五 粮 液	104,817	2,696,941.41	3.81
4	000630	铜陵有色	789,500	2,644,825.00	3.74
5	000333	美的集团	100,532	2,536,422.36	3.58
6	000001	平安银行	219,129	2,298,663.21	3.25
7	002024	苏宁云商	127,200	1,541,664.00	2.18
8	000157	中联重科	293,500	1,464,565.00	2.07
9	000338	潍柴动力	160,074	1,362,229.74	1.92
10	000568	泸州老窖	65,837	1,352,291.98	1.91

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,626.46
2	应收证券清算款	4,430.50
3	应收股利	-
4	应收利息	599.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	11,656.20

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000858	五 粮 液	2,696,941.41	3.81	重大事项停牌
2	000630	铜陵有色	2,644,825.00	3.74	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	97,906,143.00
报告期期间基金总申购份额	669,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	704,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	62,906,143.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

(2)《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(3)《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(4)《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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
2015年10月27日

嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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。

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

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	嘉实深证基本面120ETF联接
基金主代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
报告期末基金份额总额	61,517,892.71份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
业绩比较基准	深证基本面120指数*95%+银行同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金为深证基本面120ETF的联接基金,其业绩表现与深证基本面120指数及深证基本面120ETF的表现密切相关,长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年9月27日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面120指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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.本期已实现收益	11,232,317.39
2.本期利润	-41,603,586.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6195
4.期末基金资产净值	70,313,516.26
5.期末基金份额净值	1.1430

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-31.09%	3.03%	-31.19%	3.30%	0.10%	-0.27%

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

图:嘉实深证基本面120联接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
(2011年8月1日至2015年9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3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“十四、基金的投资(二)投资范围和(八)2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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