

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

[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

基金管理人的董事及高级管理人员不存虚假记载、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。

基金托管人和基金管理人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，并对基金财产的管理运用和投资基金资产，但不保证基金一定盈利。

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预示其未来表现。投资人投资于本基金，在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金的中期财务数据未经审计。

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 嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金主代码 000414

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2013年12月6日

报告期末基金份额总额 282,060,489.30份

投资目标 通过多策略收益策略对冲并锁定基金的基本性风险,寻求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金主要投资于中低波动率的品种为特征的对冲策略,则侧重于行业轮动、行业分散和个股精选;而对冲策略则主要通过大类资产配置、股票、债券、商品等金融工具的组合投资,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+一年期银行定期存款利率(税后)×40%

风险收益特征 稳小而快,具有较低的波动率,由于对收益锁定的投资策略不确定,因此,风险不保底,但能获得一定的稳定性。

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

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 6,092,081.04

2.期初利润 426,328.06

3.期初至报告期基金份额总额 0.0022

4.期末基金份额净值 325,300,406.03

5.期末基金分类净值 1.163

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申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于上述列数字。

3.2 基金分类净值增长率及与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.2.1 报告期内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

过去三个月 0.17% 0.42% 0.40% 0.00% -0.31% 0.42%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的比较

图:嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金成立以来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12月6日至2015年9月30日)

注:按基金合同的招募说明约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“十二、投资限制”之“四、投资限制”的有关规定。

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

张晓 嘉实绝对收益策略基金经理、嘉实宏观研究员 3000点研究组基金经理、嘉实基金管理有限公司研究部总监、公司研究部总监 10年

刘斌 嘉实绝对阿尔法基金经理 2014年6月15日 - 9年

注:(1)本基金基金经理任职是指本基金合同生效之日起,基金经理对本基金履行期间即视同担任基金经理。(2)本基金的含义遵从《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本基金管理人承诺按照诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋取最大利益。

4.2 基金经理对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本基金管理人承诺按照诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金公平交易行为管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第3号——公平交易》,未发现本基金存在不公平对待不同投资者的情况。

4.3.2 相关制度和措施的完善情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.3 相关人员的管理情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.4 相关投资系统的运行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.5 不同投资组合之间的公平交易情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.6 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.7 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.8 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.9 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.10 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.11 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.12 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.13 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.14 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.15 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.16 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.17 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.18 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.19 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.20 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.21 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.22 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.23 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.24 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.25 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.26 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.27 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.28 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.29 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.30 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.31 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.32 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.33 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.34 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.35 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.36 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.37 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.38 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.39 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.40 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.41 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.42 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.43 相关制度的制定和执行情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.44 相关人员的培训情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.45 相关投资系统的定期评估情况

本基金的公平交易制度和流程已集成于投资决策、交易执行、业绩评估等环节,并覆盖了所有投资人员。

4.3.46 相关法律法规、监管机构及自律组织的要求