

嘉实领先成长混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2016年1月21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,并对其内容的准确性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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1月18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。

基金管理人的过往业绩并不代表未来表现。投资人应在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中期财务数据未经审计。

本报告期末2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	-	-
3	G 制造业	1,426,910,766.17	67.41
4	D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	E 建造业	12,300,000.00	0.58
6	F 批发和零售业	64,447,033.12	2.57
7	G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	H 住宿和餐饮业	-	-
9	I 信息传输、软件和信息技术服务业	272,464,340.60	12.87
10	J 金融业	-	-
11	K 房地产业	-	-
12	L 租赁和商务服务业	-	-
13	M 科学研究、技术服务业	-	-
14	N 水利、环境和公共设施管理业	63,644,822.32	3.01
15	O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
16	P 教育	-	-
17	Q 卫生和社会工作	-	-
18	R 文化、体育和娱乐业	36,000,000.00	1.70
19	综合	67,700,962.21	3.04
20	合计	1,985,700,962.21	88.14

本基金主要投资于中国经济中快速成长的行业,并投资于其领先成长的企业,在严格的风险控制的前提下,力争为基金持有人取得长期持续的稳定收益。

投资策略 在大类资产配置上,首先参考公司投研决策委员会所形成的大类资产配置意见,在严格控制风险的前提下优化配置资产;在选股选择上,本基金将精选具有核心竞争力的公司,且有较明显超额收益预期的成长股,在个股选择上,以期间的动态结构分布为重,以收益曲线为辅,择时买卖策略,构建能够提供稳定回报的股票和债券的投资组合。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+上证国债指数收益率*5%。

风险收益特征 本基金为混合型基金,风险收益特征介于股票基金与货币市场基金之间,属于较高风险、较高收益的基金品种。

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

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日~2015年12月31日)

1.本期实现收益 47,832,767.43

2.本期利润 562,693,814.17

3.期初至报告期末基金期间利润 0.0465

4.期末未分配利润 2,116,794,599.86

2.16%

注:(1)本期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,本期利润为本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)加上本期利润。

(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金产生的交易费用, 计入费用后实际收益将低于所列数字。

§ 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

邵秋涛 基金基金经理,研究总监,长盛基金总经理 2011年6月31日 - 17年

注:(1)任期间是指本基金基金合同生效之日起;(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》的规定;

4.2 管理人对本基金运作合规性声明

报告期内,本基金严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实领先成长混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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约定,不存在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《公开募集证券投资基金公平交易行为监督指引(试行)》和公司内部公平交易制度,在同日反向交易成交较少的单边交易量超

过该报告期内所有账户总成交量的1%,合共2K笔,其中旗下组合被动跟踪标的指数量需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.3.2 基金经理的公平交易制度说明

4.4 报告期内基金投资额度和交易分析说明

4.5 报告期内基金投资组合情况

4.5.1 基金投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,985,700,962.21 87.49

2 基金投资 - 0.58

3 固定收益投资 30,036,000.00 1.41

4 货币市场基金 - 0.41

5 银行存款和结算备付金 30,036,000.00 1.41

6 其他资产 - 0.00

7 买入返售金融资产 11,365,867.06 0.53

8 其他资产 - 0.00

9 合计 2,132,622,502.47 100.00

§ 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 1,985,700,962.21 87.49

2 基金投资 - 0.58

3 固定收益投资 30,036,000.00 1.41

4 货币市场基金 - 0.41

5 银行存款和结算备付金 30,036,000.00 1.41

6 其他资产 - 0.00

7 买入返售金融资产 11,365,867.06 0.53

8 其他资产 - 0.00

9 合计 2,132,622,502.47 100.00

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额 821,403,182.94

报告期期间申购份数 258,676,988.59

减:报告期期间赎回份数 258,443,060.69

报告期期间转换场内变动份额 0

报告期末基金份额总额 821,635,964.64

注:报告期期间基金总申购份额与总赎回份额、差额即为净申购或赎回份额;基金总份额净值=基金资产净值/总份额。

5.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.1.1 报告期内固有资金持有情况

5.1.2 报告期内固有资金投资情况

5.1.3 报告期内固有资金投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 存出保证金 2,952,827.76 0.14

2 应收证券清算款 - 0.00

3 应收利息 1,042,981.00 0.05

4 应收申购款 7,370,048.28 0.03

5 其他应收款 - 0.00

6 待摊费用 - 0.00

7 其他 - 0.00

8 合计 11,365,867.06 0.53

注:报告期期间基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金的基金份额。

5.2 报告期内基金投资组合变动情况

5.2.1 基金投资组合变动

5.2.2 报告期内基金投资组合变动

5.2.3 报告期内基金投资组合变动

5.2.4 报告期内基金投资组合变动

5.2.5 报告期内基金投资组合变动

5.2.6 报告期内基金投资组合变动

5.2.7 报告期内基金投资组合变动

5.2.8 报告期内基金投资组合变动

5.2.9 报告期内基金投资组合变动

5.2.10 报告期内基金投资组合变动

5.2.11 报告期内基金投资组合变动

5.2.12 报告期内基金投资组合变动

5.2.13 报告期内基金投资组合变动

5.2.14 报告期内基金投资组合变动

5.2.15 报告期内基金投资组合变动

5.2.16 报告期内基金投资组合变动

5.2.17 报告期内基金投资组合变动

5.2.18 报告期内基金投资组合变动

5.2.19 报告期内基金投资组合变动

5.2.20 报告期内基金投资组合变动

5.2.21 报告期内基金投资组合变动

5.2.22 报告期内基金投资组合变动

5.2.23 报告期内基金投资组合变动

5.2.24 报告期内基金投资组合变动

5.2.25 报告期内基金投资组合变动

5.2.26 报告期内基金投资组合变动

5.2.27 报告期内基金投资组合变动

5.2.28 报告期内基金投资组合变动

5.2.29 报告期内基金投资组合变动

5.2.30 报告期内基金投资组合变动

5.2.31 报告期内基金投资组合变动

5.2.32 报告期内基金投资组合变动

5.2.33 报告期内基金投资组合变动

5.2.34 报告期内基金投资组合变动

5.2.35 报告期内基金投资组合变动

5.2.36 报告期内基金投资组合变动

5.2.37 报告期内基金投资组合变动

5.2.38 报告期内基金投资组合变动

5.2.39 报告期内基金投资组合变动