

嘉实企业变革股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

2016年第1号

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。
 信息披露报告数据截至2015年12月31日(“报告期末”),本报告所列数据未经审计。

1.报告期末基本资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,009,074,228.52	88.51
2	其中:股票	2,009,074,228.52	88.51
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	其中:国债、金融债、企业债、央行票据、中期票据、短期融资券	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其中:资产支持证券	-	-
10	其中:其他固定收益类资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	274,000,454.67	11.32
12	其他货币资金	3,001,730.11	0.13
13	合计	2,286,076,313.30	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	223,289,243.58	6.88
B	矿业	-	-
C	制造业	1,701,597,213.06	54.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,326,413.04	2.93
E	建筑业	96,326,413.04	2.93
F	批发和零售业	30,706,703.62	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	3,600,263.00	0.11
H	住宿和餐饮业	13,518,113.00	0.42
I	信息技术、软件和信息技术服务业	404,262,181.60	12.46
J	金融业	66,326,413.04	2.04
K	房地产业	96,326,413.04	2.93
L	租赁和商务服务业	96,326,413.04	2.93
M	科学研究和技术服务业	112,419,096.43	3.47
N	水利、环境和公共设施管理业	96,326,413.04	2.93
O	教育	-	-
P	文化艺术和体育	-	-
Q	综合	90,716,793.00	2.79
合计		2,009,074,228.52	88.69

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

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	000266	凯乐集团	6,267,335	106,194,701.86	5.12
2	601338	维信诺	6,160,362	127,464,511.04	6.10
3	300012	新华保险	4,571,777	112,419,096.43	5.47
4	000512	盐湖股份	4,809,213	106,564,672.00	3.46
5	000299	万邦医药	8,527,148	104,402,369.00	3.22
6	002043	爱康集团	6,052,796	100,279,120.00	3.09
7	603555	贵广网络	2,796,112	86,267,448.16	3.03
8	601318	中国平安	2,647,914	66,326,404.00	2.04
9	000075	中兴通讯	2,096,363	53,178,794.00	2.04
10	000364	际华集团	3,791,001	86,389,081.16	2.68

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.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。

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

支持类资产投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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。

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。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓损益明细

序号	品种	持仓数量	公允价值(元)	浮动损益
1	IF1603	100	10,000.00	-10,748,000.00

公允价值变动损益合计(元)

-10,748,000.00

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金的投资范围包括股指期货,并遵守中国证监会及相关法律法规的规定,合理

利用股指期货等衍生工具,利用数量方法对股指期货的套期保值。投资策略

则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险敞口的影响很小,符合既定的投资

政策和风险控制要求。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末,本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1) 报告期末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。

(2) 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库

之外的证券。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,441,136.31
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	83,762.86
6	其他资产	1,268,818.36
7	待摊费用	-
8	其他	3,891,738.11

(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) 报告期末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	受限数量(股)	受限金额(元)	受限原因
1	001338	维信诺	6,160,362	335	重大资产重组

十二、基金业绩比较

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金

财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不

代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基

金的招募说明书。

1.本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②
自2015年12月31日至2016年2月29日	17.10%	24.0%
自2015年12月31日至2016年1月31日	17.10%	24.0%
自2015年12月31日至2016年1月15日	17.10%	24.0%
自2015年12月31日至2016年1月1日	17.10%	24.0%
自2015年12月31日至2016年1月1日	17.10%	24.0%

注:本基金基金合同生效日2015年12月21日至报告期期末2016年1月

按基金合同附页说明的约定,本基金自基金合同生效日起前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(十二)“投

资范围、(四)投资策略”条款的有关规定。

2.本基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证红利指数收益率×40%

(2015年12月21日至2015年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2015年12月21日至报告期期末2016年1月

按基金合同附页说明的约定,本基金自基金合同生效日起前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(十二)“投

资范围、(四)投资策略”条款的有关规定。

三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

4.基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和诉讼费;

5.基金份额持有人大会费用;

6.转出基金赎回费用,则不收取赎回费用。

7.基金转换时,如涉及的转出基金,收取该基金的赎回费用。

8.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支

的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按照前一基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的

计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理

人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按照前一基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费

的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人

和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

本基金信息披露费按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规

的规定执行。

(4) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(5) 基金份额持有人大会费用

(6) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

(7) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支

的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按照前一基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的

计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理

人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按照前一基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费

的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人

和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

本基金信息披露费按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规

的规定执行。

(4) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(5) 基金份额持有人大会费用

(6) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

(7) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支

的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按照前一基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的

计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理

人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按照前一基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费

的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人

和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

本基金信息披露费按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规

的规定执行。

(4) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(5) 基金份额持有人大会费用

(6) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

(7) 基金合同生效后与基金相关的审计费、律师费、仲裁费和

诉讼费

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支

的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按照前一基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的

计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理

人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金

财产中一次性支付,给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按照前一基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费

的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人