

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

[2015]第一季度报告

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4月21日

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4月17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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表未来表现。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1月1日起至2015年3月31日止。

\$ 2 基金产品概况

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	4,602,435.71	0.88	
C 制造业	266,554,458.24	50.80	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,633,018.00	1.65	
E 建筑业	12,021,340.00	2.31	
F 批发和零售业	9,335,800.00	1.78	
G 交通运输、仓储和邮政业	15,414,203.60	2.94	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	121,522,715.35	23.19	
J 金融业	11,885,077.32	2.27	
K 房地产业	13,819,014.88	2.64	
L 钛白粉和商务服务业	3,891,479.20	0.74	
M 科学研究、技术服务及地质勘查业	5,032,223.63	0.96	
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 文化、体育和娱乐业	8,910,367.44	1.76	
R 综合	5,869,720.66	1.12	
合计	487,273,336.40	92.97	

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五名股票投资明细

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	300347	泰格医药	16,553.53	8,910,367.44	1.70
2	300130	新国都	104,900	8,369,971.00	1.60
3	300274	阳光电源	256,925	8,324,370.00	1.59
4	300300	汉缆股份	181,900	8,274,631.00	1.58
5	300113	顺络电子	209,500	7,981,903.00	1.52
6	002467	六三	299,000	7,632,455.00	1.46
7	002542	中化岩土	401,800	7,501,600.00	1.43
8	300179	万达电	284,700	7,376,577.00	1.41
9	300764	佳创视讯	449,300	7,269,674.00	1.39
10	300203	聚光科技	251,200	7,232,048.00	1.38

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	19,204,000.00	3.66
4	企业债券	19,204,000.00	3.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		19,204,000.00	3.66

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	100338	14+3期票	20,000	19,204,000.00	3.66

注:注:1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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)嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的利润总额以人民币计算,单位为人民币元,精确到小数点后两位;列示货币基金的利润总额(不包括以人民币认购或申购基金时产生的利息收入)。

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

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140001	深证100指数	33,860	1,889.00	11.43%
2	140002	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
3	140003	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
4	140004	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
5	140005	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
6	140006	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
7	140007	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
8	140008	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
9	140009	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%
10	140010	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%

注:注:(1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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)上表系基金业绩指标不包括持有个人认购或申购基金时产生的利息收入。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	黄金	0.00	0.00	0.00%

注:注:1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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)上表系基金业绩指标不包括持有个人认购或申购基金时产生的利息收入。

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及权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	深证100指数	1,376	22.43%	0.51%

注:注:1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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)上表系基金业绩指标不包括持有个人认购或申购基金时产生的利息收入。

5.9 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股指期货及权证交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货及权证交易。

5.10 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 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股票期权交易情况说明

报告期内,本基金未参与股票期权交易。

5.12 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组合情况

序号	资产类别	资产名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	股票	487,273,336.40	85.20
2	固定收益类投资	债券	19,204,000.00	3.36
3	贵金属投资	黄金	0.00	0.00
4	货币市场基金	货币基金	32,188,709.90	5.62
5	其他资产	其他	33,291,048.58	5.82
合计			571,927,350.88	100.00

注:注:1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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)嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金的利润总额以人民币计算,单位为人民币元,精确到小数点后两位;列示货币基金的利润总额(不包括以人民币认购或申购基金时产生的利息收入)。

5.13 其他资产构成情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	315,671.04
2	应收券商清算款	28,438,895.40
3	应收银行存款	618,622.22
4	应收利息	3,917,851.92
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计		33,291,048.58

注:注:1)本期已实现收益指基金本期已实现收入、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