汇添富安心中国债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
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7月18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7月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富安心中国债券
交易代码	000395
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月22日
报告期末基金份额总额	208,222,407.90份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过重点投资于高信用等级债券,力争实现资产的稳健增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的80%,其中投资于高等级信用债券的投资比例不低于基金资产净值的70%;持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
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	汇添富安心中国债券A / 汇添富安心中国债券C
下属分级基金的交易代码	000395 / 000396
报告期末下属分级基金的份额总额	177,784,423.36份 / 30,437,984.54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4月1日－2015年6月30日)	
	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
1.本期已实现收益	1,874,946.49	116,028.37
2.本期利润	3,828,706.88	138,085.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0230	0.0124
4.期末基金资产净值	193,940,099.29	33,177,936.83
5.期末基金份额净值	1.091	1.090

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

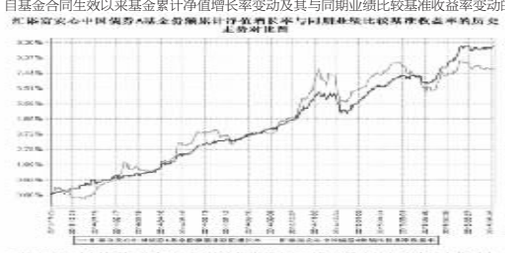
汇添富安心中国债券A

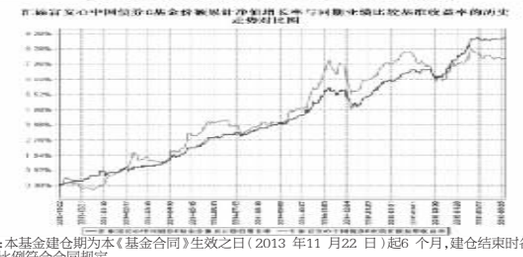
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.15%	0.08%	1.35%	0.10%	0.80%	-0.02%

汇添富安心中国债券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	2.35%	0.08%	1.35%	0.10%	1.00%	-0.02%

3.2.2 目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





注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年11月22日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富信用债券基金的基金经理。	2013年11月22日	-	17年	国籍,中国。学历,英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格:基金从业资格。特许金融分析师(CFA),财务风险经理人(FRM)。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人,基金经理助理,固定收益部负责人,金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理,2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理,2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理,2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理。2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理(香港)有限公司,2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,负责固定收益的研究和投资管理工作。2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理。2014年1月21日至今任汇添富信用债券基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、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 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于投资流动性的需求导致。

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

2015年第二季度,中国人民银行两次下调金融机构法定存款准备金率和一次下调存贷款基准利率,这是国内进一步实施宽松货币政策,并且力度较一季度有所加大。从第二季度的宏观经济数据来看,当前国内的经济情况仍然不容乐观。第二季度的居民消费物价指数(CPI)和生产者出厂价格指数(PPI)依然逐步走低,PPI的负增长持续扩大。从中采采购经理人指数来看,新订单指数下降,主要受新出口订单影响,表明真实的外需仍然偏弱。而国内订单方面,由于地产投资并未企稳,也并未改善,与高频数据显示的一致。就业均处于偏弱状态,并且牵涉到其他的方面,比如收入和消费等。人民币在第二季度相对于美元币值保持稳定。在第二季度,沪深300指数上涨10.41%。债券市场上,中债综合指数上涨2.35%。

本基金在第二季度继续以增加久期和提高组合静态收益率为主要目标,买入了3-7年的AAA级中票。报告期内组合没有提高回购杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金 A 级净值增长率为2.15%,C 级净值增长率为2.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年第三季度,我们认为,在央行上半年的宽松货币政策推动下,经济会出现企稳迹象。特别是房地产行业的销量以及价格的反弹,可能使得整个上下游的行业都出现底部。股票市场的下跌以及政府推出的"救市"政策,包括新股发行暂停,都会使得市场避险情绪上升,从而有部分资金回流到债券市场。我们预计,第三季度,债券市场整体收益率水平会略有下降,幅度大概在10-20个基点左右。但并不会有趋势性的机会。从供需角度分析,政府债券的机会不大,我们更看好中高等级的信用债以及高收益城投债的机会。

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

姓名	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	213,511,750.80	93.00
	其中:债券	213,511,750.80	93.00
	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	5,780,312.12	2.52
7	其他资产	10,302,391.58	4.49
8	合计	229,594,454.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

姓名	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	20,600,000.00	9.07
	其中:政策性金融债	20,600,000.00	9.07
4	企业债券	50,741,750.80	22.34
5	企业短期融资券	10,102,000.00	4.45
6	中期票据	132,068,000.00	58.15
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	213,511,750.80	94.01

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	140303	14进出03	100,000	10,595,000.00	4.66
2	101456009	14北车MTN002	100,000	10,540,000.00	4.64
3	101456060	14国开投MTN002	100,000	10,401,000.00	4.58
4	101552006	15三峡MTN001	100,000	10,265,000.00	4.52
5	122355	14齐鲁债	100,000	10,260,000.00	4.52

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

注:本基金本报告期末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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制 日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,924.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,597,536.53
5	应收申购款	6,701,930.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,302,391.58

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
报告期期初基金份额总额	165,619,123.51	3,575,659.59
报告期期间基金总申购份额	48,930,049.50	41,095,296.11
减:报告期期间基金总赎回份额	36,764,749.65	14,232,971.16
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	177,784,423.36	30,437,984.54

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,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

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富安心中国债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富安心中国债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富安心中国债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富安心中国债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年7月18日

嘉实主题精选混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月15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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21日
报告期末基金份额总额	2,773,014,226.77份
投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用"主题投资策略",从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合,并优先考虑股票类资产的配置,剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%
风险收益特征	较高风险,较高收益。
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4月1日－2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,933,025,254.28
2.本期利润	1,057,056,658.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.3229
4.期末基金资产净值	5,385,596,578.18
5.期末基金份额净值	1.942

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	14.13%	2.83%	9.99%	2.48%	4.14%	0.35%

3.2.2 目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

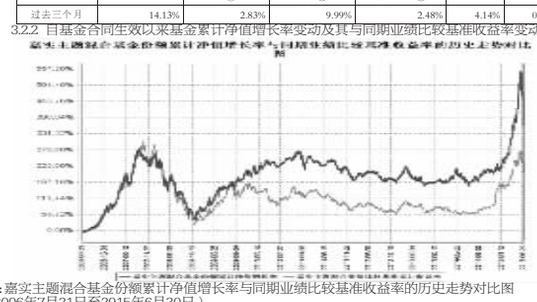


图:嘉实主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006年7月21日至2015年6月30日)

注:按基金合同约定,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十四条((二)投资范围、(八)2.投资组合比例限制)约定:(1)资产配置范围为:股票资产30%～95%,债券0～70%,权证0～3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;(2)持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;(3)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(4)在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五;(5)持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的3%;(6)法律法规和基金合同规定的其他限制。

§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		
邹唯	本基金基金经理	2013年10月29日	-	13年	曾任职于长城证券研究发展中心;嘉实基金管理有限公司研究部,先后任嘉实浦安保本、嘉实稳健混合、嘉实策略混合和嘉实主题混合基金经理;上海磐信投资管理有限公司,任董事总经理。2013年7月加入嘉实基金管理有限公司,硕士研究生,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 管理人对投资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、《嘉实主题精选混合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%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,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,市场先快速上涨,6月中旬之后出现历史罕见的大幅下跌,从整个季度来看,市场指数还是有较大幅度的上涨,创业板指数涨22.4%,沪深300指数和上证综指分别上涨10.41%和14.12%。分行业看,国防军工、纺织服装、轻工制造、交通运输、电力及公用事业等板块涨幅达到了30%以上,而非银金融、石油石化、银行、建筑和有色金属则涨幅较小。整个季度的走势与我们期初的判断基本一致,不过波动幅度大超我们预期。我们原本判断,2季度影响市场的关键因素将不仅仅是资金,基本面因素对市场的影响将逐渐变大,无论是市场,还是个别行业,其二级市场表现均不会长期的背离基本面,对2季度市场的判断是先涨后跌,原计划在季度末降低仓位,不过市场下跌速度过快,组合没有及时的减仓,在6月份组合净值出现了较大的损失。

报告期内,组合基本保持了高仓位,组合的配置大方向依旧延续了以老龄化和节能环保为主线的配置思路。

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1.742元;本报告期基金份额净值增长率为20.80%,业绩比较基准收益率为10.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年3季度,预计后续的宏观经济政策以稳为主,改革政策将逐步落地,流动性仍将维持目前的宽松格局,在6月份的快速下跌之后,市场快速的降低了杠杆,风险有了明显的释放。尽管市场的去杠杆过程仍将持续一段时间,不过,我们对下半年的市场判断较为乐观,毕竟这次牛市的基础仍在。经历过本次历史罕见的快速调整,投资者受到了较大的风险教育,预期上半年鸡犬升天的局面难以重现,个股会剧烈分化,优质成长股将有较好的表现,但质地较差的主题股表现则会相对较差。

在经济转型期的经济、政治环境下,寻找符合改革和转型主线的主题标的,是组合长期取得超额收益的最主要手段,符合这一主线的行业和个股是组合的核心配置,如大健康、节能环保、新能源汽车、移动互联等,当然,在3季度,组合会更加强调所选择标的的质量和催化因素的兑现性。

从制度性主题层面来看,制度变革将带来投资机会,如医疗体制改革、国企改革、体育管理制度变化等,国企改革尽管进度缓慢,但仍是2015年弹性最大的主题。从事件性主题层面来看,并购重组仍会是最值得关注的主题,不过,热点与2014年以及2015年上半年会有明显的不同,具有资源优势的国企(特别是央企及其下属上市子公司)的并购重组应该更加频繁和有力度。

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	5,085,174,659.12	90.80
	其中:股票	5,085,174,659.12	90.80
2	固定收益投资	220,841,000.00	3.94
	其中:债券	220,841,000.00	3.94
	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	173,114,384.03	3.09
7	其他资产	121,065,220.28	2.16
	合计	5,600,195,263.43	100.00

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(%)
A	农、林、牧、渔业	202,595,769.82	3.76
B	采矿业	109,896,244.00	2.04
C	制造业	3,586,935,098.56	66.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	561,621,698.88	10.43
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	322,646,547.86	5.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	156,436,000.00	2.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	144,760,000.00	2.69
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	283,300.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	5,085,174,659.12	94.42

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

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	002283	天润曲轴	24,800,000	422,840,000.00	7.85
2	000028	国药一致	4,524,288	337,104,698.88	6.26
3	300004	南风股份	4,400,000	299,200,000.00	5.56
4	000547	闽福发A	11,000,000	293,480,000.00	5.45
5	000963	华东医药	3,500,000	218,750,000.00	4.06
6	300094	国联水产	6,497,263	202,324,769.82	3.76
7	300107	建新股份	23,434,392	202,004,459.04	3.75
8	600525	长园集团	9,000,000	185,130,000.00	3.44
9	000525	红太阳	8,099,792	181,192,347.04	3.36
10	300397	天和防务	987,485	178,734,785.00	3.32

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	9,955,000.00	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,886,000.00	3.92
	其中:政策性金融债	210,886,000.00	3.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	220,841,000.00	4.10

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	140443	14农发43	1,000,000	100,270,000.00	1.86
2	140230	14国开30	900,000	90,432,000.00	1.68
3	150206	15国开06	200,000	20,184,000.00	0.37
4	080025	08国债25	100,000	9,955,000.00	0.18

注:报告期末,本基金仅持有上述4只债券。

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	2,759,661.04
2	应收证券清算款	104,593,711.65
3	应收股利	-
4	应收利息	5,876,920.10
5	应收申购款	7,834,927.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	121,065,220.28

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

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	000963	华东医药	218,750,000.00	4.06	重大事项停牌
2	300094	国联水产	202,324,769.82	3.76	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	
	4,012,967,127.79
报告期期间基金总申购份额	474,049,295.92
减:报告期期间基金总赎回份额	1,714,002,196.94
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,773,014,226.77

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、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)中国证监会批准嘉实主题精选混合型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实主题精选混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实主题精选混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实主题精选混合型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)报告期内嘉实主题精选混合型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7月18日

嘉实主题新动力股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题新动力股票
基金主代码	070021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月7日
报告期末基金份额总额	651,330,111.40份
投资目标	充分把握驱动中国经济发展和结构转型所带来的主题性投资机会,并在主题的指引下精选具有高成长潜力的上市公司,力争获取长期,持续,稳定的超额收益。
投资策略	通过发掘驱动经济增长及结构转型的新兴增长动力,并以新兴增长动力所指引的主题性投资机会作为主要的投资线索,将主题投资策略融入本基金自上而下的管理流程中。(1)力求前瞻性研判驱动经济发展及转型的新兴增长动力所带来的投资主题;(2)根据投资主题的广度及数量,以及经济周期与市场因素决定大类资产配置决策,优先考虑股票类资产的配置;(3)深入挖掘有望受益于该主题的上市公司股票;(4)在综合考量投资组合的风险与收益的原则下,完成构建并定期调整投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数*95%+上证国债指数*5%
风险收益特征	本基金为一只主动投资的股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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4月1日－2015年6月30日)
1.本期已实现收益	427,690,791.56
2.本期利润	287,482,236.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.3628
4.期末基金资产净值	1,134,822,323.07
5.期末基金份额净值	1.742

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	20.80%	2.95%	10.04%	2.48%	10.76%	0.47%

3.2.2 目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

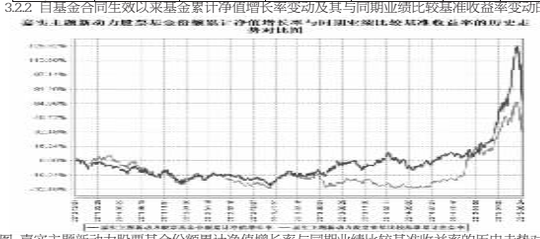


图:嘉实主题新动力股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2010年12月7日至2015年6月30日)

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"第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二)投资组合限制)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