

嘉实研究精选股票型证券投资基金

2015年第二季度报告

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、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内容，确认复核结果不存在虚假记载、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。

基金投资组合并不表示其未来表现。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 嘉实研究精选股票

基金代码 070013

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2008年6月27日

报告期末基金份额总额 2,114,963,211.07份

通过特许系统，深入的基本面研究，挖掘企业在价值，寻找具备长期增长潜力的上市公司，以获得基金资产长期稳定的增值。

优先权投资账户的配置，使用“自下而上”的选股策略，结合公司与行业分析的结合方法，精选个股，挖掘股票投资组合，将资产配置于投资类和消费类等大类资产，债券投资采取“自上而下”的策略。

业绩比较基准 沪深300指数×95%+上证国债指数×5%

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

主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 2,161,592,996.00

2.本期利润 1,551,197,949.48

3.加权平均基金份额本期利润 0.05149

4.期末基金份额净值 6,995,947.0334

5.期末基金资产净值 3,246.00

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将低于所列数字。

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变动的比较

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 过去三个月 1342% 30% 10.00% 2.48% 3.38% 0.57%

3.2.2 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

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 过去三个月 1342% 30% 10.00% 2.48% 3.38% 0.57%

图:嘉实研究精选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(2005年5月27日至2015年6月30日)

注:1)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投资组合应当符合基金合同规定的相关比例限制(见“二、投资范围”之“(七)投资组合比例限制”的约定)。

2)2015年10月1日，基金管理人已公告《嘉实基金管理有限公司基金经理变更的公告》，张弢先生不再担任本基金基金经理；聘请陈平女士担任本基金基金经理。

§ 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间 证券从业年限 说明

陈少平 本基金基金经理兼新发基金组合基金经理 2015年4月10日 - 12年 曾任海投投资咨询有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司基金经理，2014年9月加入嘉实基金管理有限公司，担任基金经理助理，2015年4月10日担任本基金基金经理。

张弢 本基金基金经理 2010年6月8日 2015年4月10日 11年 曾任兴证证券有限公司金融工程分析师，兴业证券股份有限公司金融工程分析师，2010年6月加入嘉实基金管理有限公司，担任基金经理助理，2015年4月10日担任本基金基金经理。

(1)任项目经理，离任日期前公司作出决定后公告之日；(2)证券从业年限从行业协会/证券从业资格证获得之日起算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实研究精选股票型证券投资基金合同》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约定和规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金法》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资决策和流程独立运作，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面完全公平的机会；通过完善交易系统内各交易所的公平交易执行细则、严格的流程控制，持续改进公平交易制度，确保公平交易原则的实现；通过日常监控、公平对待旗下管理的组合，确保旗下不同组合公平交易的机会。

4.4 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未有涉及异常交易的专项说明。

4.5 报告期内基金的利润分配情况说明

报告期内，本基金未进行利润分配。

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 6,496,359,473,980 89.06%

其中:股票 6,496,359,473,980 89.06%

2 固定收益投资 332,168,000.00 4.60%

其中:债券 332,168,000.00 4.60%

3 货币市场工具 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产 6,000.00 0.00%

其中:资产支持证券 - -

6 银行存款和结算备付金合计 363,223,171.45 5.03

7 其他资产 29,204,827.62 0.40

合计 7,219,956,473,977 100.00%

注:1)本期已实现收益指本期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将低于所列数字。

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变动的比较

序号 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 投资组合基准收益率(%) 相对基准收益率(%)

过去三个月 26.30% 2.40% 21.76% 2.60% 354% -0.20%

3.2.2 自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

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 866,610,414,244 12.62%

2 采矿业 - -

3 制造业 1,762,064,143,52 25.66%

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 48,028,261,46 0.70%

6 批发零售业 1,249,709,846,68 18.19%

7 交通运输、仓储和邮政业 563,163,084,937 8.20%

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 436,946,598,09 6.36%

10 金融业 995,581 0.00%

11 房地产业 387,244,027,20 5.64%

12 租赁和商务服务业 614,434,106,16 8.95%

13 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 - -

15 居民服务、修理和其他服务业 - -

16 教育 - -

17 卫生和社会工作 - -

18 文化、体育和娱乐业 568,156,067,00 8.28%

19 综合 - -

合计 6,496,359,473,930 94.60%

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 866,610,414,244 12.62%

2 采矿业 - -

3 制造业 1,762,064,143,52 25.66%

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 48,028,261,46 0.70%

6 批发零售业 1,249,709,846,68 18.19%

7 交通运输、仓储和邮政业 563,163,084,937 8.20%

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 436,946,598,09 6.36%

10 金融业 995,581 0.00%

11 房地产业 387,244,027,20 5.64%

12 租赁和商务服务业 614,434,106,16 8.95%

13 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 - -

15 居民服务、修理和其他服务业 - -

16 教育 - -

17 卫生和社会工作 - -

18 文化、体育和娱乐业 568,156,067,00 8.28%

19 综合 - -

合计 6,496,359,473,930 94.60%

注:1)本报告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将低于所列数字。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 866,610,414,244 12.62%

2 采矿业 - -

3 制造业 1,762,064,143,52 25.66%

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 48,028,261,46 0.70%

6 批发零售业 1,249,709,846,68 18.19%

7 交通运输、仓储和邮政业 563,163,084,937 8.20%

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 436,946,598,09 6.36%

10 金融业 995,581 0.00%

11 房地产业 387,244,027,20 5.64%

12 租赁和商务服务业 614,434,106,16 8.95%

13 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 - -

15 居民服务、修理和其他服务业 - -

16 教育 - -

17 卫生和社会工作 - -

18 文化、体育和娱乐业 568,156,067,00 8.28%

19 综合 - -

合计 6,496,359,473,930 94.60%

注:1)本报告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将低于所列数字。

5.4 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间 证券从业年限 说明

陈少平 本基金基金经理兼新发基金组合基金经理 2015年4月10日 - 12年 曾任海投投资咨询有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司基金经理，2014年9月加入嘉实基金管理有限公司，担任基金经理助理，2015年4月10日担任本基金基金经理。

张弢 本基金基金经理 2010年6月8日 2015年4月10日 11年 曾任兴