嘉实全球互联网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:招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。

基金托管人招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15日(基金合同生效日)起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实全球互联网股票
基金主代码	000988
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
报告期末基金份额总额	3,761,342,369.00份
投资目标	本基金主要投资互联网行业股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资全球互联网相关行业股票。对于境内投资,本基金采用中观驱动,精选个股的策略,从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期,充分考虑国内互联网企业处于成长初期,跨界和盈利模式创新丰富的特点,挖掘具有广阔成长空间,良好商业模式,独特竞争优势且估值合理的公司;对于境外投资,本基金采用中观驱动,合理对标的策略,从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期,结合各国互联网企业的发展空间情况,充分利用市场的广度和深度,挖掘具有广阔成长空间,良好商业模式,独特竞争优势且估值合理的公司。
业绩比较基准	40%×道琼斯互联网指数+45%×中证海外中国互联网指数+15%×中证全指互联网软件与服务指数
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时,本基金为行业基金,在享受全球互联网行业收益的同时,也必须承担单一行业带来的风险。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
境外资产托管人	英文名称:Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称:布朗兄弟哈里曼银行
下属分级基金的基金简称	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 / 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元
下属分级基金的交易代码	000988 / 000989/000990
报告期末下属分级基金的份额总额	3,683,149,757.23份 / 78,192,611.77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15日 - 2015年6月30日)	
	嘉实全球互联网股票-人民币	嘉实全球互联网股票-美元
1.本期已实现收益	6,822,449.04	-5,543,480.54
2.本期利润	-135,211,469.91	-74,350,528.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0386	-1.7058
4.期末基金资产净值	3,804,521,196.32	494,723,321.81
5.期末基金份额净值	1.033	1.035

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)嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额以人民币计价并进行申购获得人民币份额;嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额以美元计价并进行申购获得美元份额;(4)嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元的期末基金份额净值单位为美元。(5)本基金合同生效日为2015年4月15日,本报告期自2015年4月15日起至2015年6月30日止。

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

嘉实全球互联网股票-人民币

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	3.30%	2.86%	6.56%	1.31%	-3.26%	1.55%

嘉实全球互联网股票-美元

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	3.50%	2.87%	6.56%	1.31%	-3.06%	1.56%

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

图1:嘉实全球互联网股票-人民币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

(2015年4月15日至2015年6月30日)

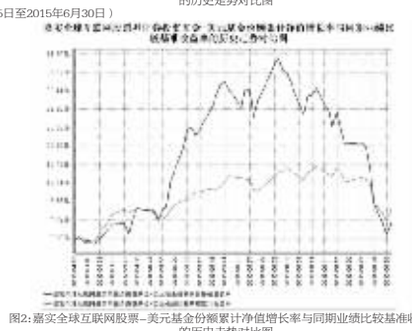

图2:嘉实全球互联网股票-美元基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年4月15日至2015年6月30日)

注1:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末未满1年。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,本报告期处于建仓期内。

注2:2015年5月15日,本基金管理人发布《关于新增嘉实全球互联网股票基金经理的公告》,增聘张丹华先生担任本基金基金经理职务,与基金经理丁杰人先生共同管理本基金。

§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		
丁杰人	本基金、嘉实策略混合基金经理	2015年4月15日	-	8年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员、基金经理,2013年11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。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	-	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员、博士,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的任职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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《嘉实全球互联网股票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

本基金于2015年4月15日正式成立开始运作,期初我们对全球互联网有两个预判,第一,从地域上,A股是今年具有系统性贝塔机会的市场,因此境内配置比例较高,而港股会受益深港通,中概股由于私有化预期也有一定机会;第二,从仓位上,国内互联网公司受到资金偏好、估值体系和反身性三方面因素影响,可能继续快速上行,因此仓位较高,在初期收到较好效果;

进入6月,国内市场风格发生了较大变化,前期快速上涨风险集中暴露,我们一方面系统性降低国内投资比例,增加海外稳健型中大互联网公司配置,另一方面国内投资向互联网龙头公司集中,但由于国内下跌速度较快和最低仓位的要求,净值依然出现较大回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实全球互联网股票-人民币基金份额净值为1.033元,本报告期基金份额净值增长率为3.30%;截至报告期末嘉实全球互联网股票-美元基金份额净值为1.035美元,本报告期基金份额净值增长率为3.50%;同期业绩比较基准收益率为6.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从三年左右的中期维度看,全球互联网公司的市值依然有2-3倍提升空间,通过互联网创造新的自由度,提升产业效率,向利于消费者方向分配价值链的趋势不会改变;

此轮A股互联网公司主要投资逻辑是跨盈利模式升级带来的估值和盈利双升,但是由于短期风险的集中暴露,投资者风险偏好已经出现大幅下降,伴随着估值体系的均衡化,年内全面泡沫化的可能性已经不大;我们将降低国内互联网公司投资比例,更严格标准选择能够兑现长期增长预期的龙头公司,线索上偏向互联网平台,产业互联网,网络安全等;

后续我们会系统性增加海外投资比例,一是加大海外龙头互联网公司的配置,在较低估值水平上,依靠不断货币化平台价值带来的确定性机会;二是把握中概股回归的套利机会,组合配置更加均衡,看好电商、移动广告、社交、垂直产业的机会。

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

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,293,116,018.81	64.17
	其中:普通股	2,937,222,430.26	57.23
	优先股	-	-
	存托凭证	355,893,588.55	6.93
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,835,237,000.58	35.76
8	其他资产	3,646,751.89	0.07
	合计	5,131,999,771.28	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	355,893,588.55	8.28
中国	2,457,754,332.30	57.17
中国香港	479,468,097.96	11.15
合计	3,293,116,018.81	76.60

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	877,465,591.29	20.41
医疗保健	99,026,125.10	2.30
工业	114,142,897.53	2.65
信息技术	2,202,481,404.89	51.23
合计	3,293,116,018.81	76.60

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	BEIJING BAOFENG TECH	暴风科技	300431	深圳证券交易所	中国	716,183	220,269,243.48	5.12
2	ANHUI WANTONG TECHNO	皖通科技	002331	深圳证券交易所	中国	6,980,199	205,078,246.62	4.77
3	LESHI INTERNET INFOR	乐视网	300104	深圳证券交易所	中国	3,000,036	155,281,863.36	3.61
4	NSFOCUS INFORMATION	绿盟科技	300369	深圳证券交易所	中国	2,715,412	138,486,012.00	3.22
5	SAILUN JINYU GROUP C	赛轮金宇	601058	上海证券交易所	中国	9,999,976	111,499,732.40	2.59
6	SHANGHAI GANGLIAN E-	上海钢联	300226	深圳证券交易所	中国	1,367,198	110,743,038.00	2.58
7	HANGZHOU SHUNWANG TE	顺网科技	300113	深圳证券交易所	中国	2,056,849	110,247,106.40	2.56
8	HANGZHOU SUNYARD SYS	信雅达	600571	上海证券交易所	中国	1,003,501	106,220,580.85	2.47
9	B-SOFT CO LTD-A	创业软件	300451	深圳证券交易所	中国	521,245	99,026,125.10	2.30
10	VENUSTECH GROUP INC-	启明星辰	002439	深圳证券交易所	中国	2,594,094	88,977,424.20	2.07

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

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十名基金投资明细

报告期末,本基金未持有基金。

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。

5.10.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	913,260.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	777,675.53
4	应收利息	265,496.21
5	应收申购款	1,690,319.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,646,751.89

5.10.4 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。

5.10.5 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(英文)	流通受限部分的公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300431	暴风科技	220,269,243.48	5.12	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币	嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元
基金合同生效日(2015年4月15日)基金份额总额	3,320,056,116.98	34,364,248.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,565,349,888.71	49,153,013.31
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,202,256,248.46	5,324,650.25
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	3,683,149,757.23	78,192,611.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准嘉实全球互联网股票型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实全球互联网股票型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实全球互联网股票型证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实全球互联网股票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

深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

【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	嘉实深证基本面120ETF
场内简称	深F120
基金主代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
报告期末基金份额总额	97,906,143.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面120指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,其有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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	91,404,505.57
2.本期利润	32,516,789.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.3041
4.期末基金资产净值	162,251,106.73
5.期末基金份额净值	1.6572

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	19.60%	2.50%	18.93%	2.57%	0.67%	-0.07%

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

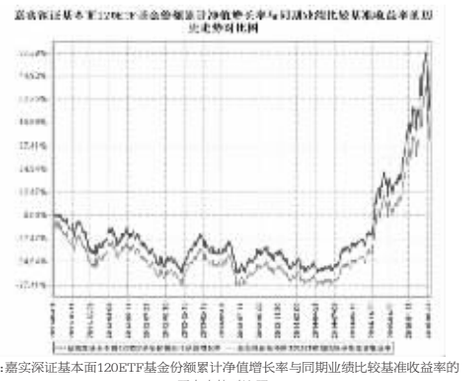

图:嘉实深证基本面120ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年8月1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"十五、基金的投资(二)投资范围和(八)2、基金投资组合比例限制"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
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金经理,公司指数投资部总监	2014年3月11日	-	17年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理,万家(天同)180指数基金经理。2004年7月加入嘉实基金,南开大学经济学硕士,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 管理人对报告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、《嘉实深证基本面120交易型开放式指数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,本基金日均跟踪误差为0.06%,年度化拟合偏离度为0.9%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

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1.6572元;本报告期基金份额净值增长率为19.60%,业绩比较基准收益率为18.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,将继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

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	160,590,529.52	98.29
	其中:股票	160,590,529.52	98.29
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	2,797,380.24	1.71
7	其他资产	1,938.22	0.00
	合计	163,389,847.98	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	5,092,246.06	3.14
C	制造业	100,000,474.92	61.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,143,798.78	2.55
E	建筑业	1,649,320.55	1.02
F	批发和零售业	5,630,645.31	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,635,330.54	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	510,391.00	0.31
J	金融业	14,094,440.01	8.69
K	房地产业	25,136,327.75	15.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,697,503.60	1.66
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,590,478.52	98.98

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	998,649	14,500,383.48	8.94
2	000651	格力电器	169,997	10,862,808.30	6.70
3	000333	美的集团	158,732	5,917,528.96	3.65
4	000858	五 粮 液	168,517	5,341,988.90	3.29
5	000001	平安银行	344,429	5,007,997.66	3.09
6	000709	河北钢铁	644,384	4,510,688.00	2.78
7	000338	潍柴动力	125,637	3,977,667.42	2.45
8	000157	中联重科	460,900	3,737,899.00	2.30
9	000568	泸州老窖	103,837	3,386,124.57	2.09
10	000778	新兴铸管	251,570	3,260,347.20	2.01

5.3.2 报告期末积极投资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

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

5.4 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。

5.5 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。

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	1,133.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	804.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,938.22

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000709	河北钢铁	4,510,688.00	2.78	重大事项停牌
2	000778	新兴铸管	3,260,347.20	2.01	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	142,906,143.00
报告期期间基金总申购份额	298,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	343,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	97,906,143.00

§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)中国证监会批准深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

(2)《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(3)《深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(4)《深证基本面120交易型开放式指数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)报告期内深证基本面120交易型开放式指数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

嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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	嘉实深证基本面120ETF联接
基金主代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
报告期末基金份额总额	96,480,095.97份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
业绩比较基准	深证基本面120指数*95% + 银行同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金为深证基本面120ETF的联接基金,其业绩表现与深证基本面120指数及深证基本面120ETF的表现密切相关,长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月1日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年9月27日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面120指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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	39,148,343.71
2.本期利润	26,719,908.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.2543
4.期末基金资产净值	160,027,344.63
5.期末基金份额净值	1.6587

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