

(上接B069版)

住所、办公地址	成都市高新区世纪大道96号	联系人	金磊
法定代表人	杨云	联系电话	(028) 86601126
电话	(028) 86601126	传真	(028) 86601126
网址	www.sbslstock.com	客服电话	4006600709

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心40F-507层	联系人	陈林
法定代表人	陈林	联系电话	(021) 68777222
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.sbslstock.com	客服电话	4008208888

住所、办公地址	广州市天河区珠江新城华夏路17楼	联系人	卢文文
法定代表人	王亚平	联系电话	(0902) 15161942
电话	(0902) 15161942	传真	(0902) 15161943
网址	www.xmzq.com	客服电话	(0902) 15161948

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号28楼	联系人	陈林
法定代表人	陈林	联系电话	(021) 68777222
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.sbslstock.com	客服电话	4008208888

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号28楼	联系人	陈林
法定代表人	陈林	联系电话	(021) 68777222
电话	(021) 68777222	传真	(021) 68777822
网址	www.sbslstock.com	客服电话	4008208888

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号新国都大厦B座10层	联系人	李倩
法定代表人	赵建斌	联系电话	(010) 169692491
电话	(010) 169692491	传真	(010) 169692791
网址	www.sbslstock.com	客服电话	400-889-5618

(二) 投资管理程序

1. 研究部门通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业 and 上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2. 在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、行业环境、证券市场走势等因素进行综合分析,根据基金合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金其他重要资产配置类别上的具体配置计划。

3. 投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和资产配置的方案或重大投资决议。

4. 基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资组合,构建投资组合。

5. 基金经理小组将投资组合下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行,保证决策和执行的分离。

6. 风险控制委员会根据市场及基金投资组合进行风险评估与监控,并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险分析报告,监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7. 基金经理小组将根据证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回转换导致的现金流变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。

8. 在确保基金资产净值持有人利益的前提下,基金经理有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

九、基金的投资业绩比较

嘉实增长混合:60%*日沪深300(大)指数收益率+40%*中债总指数收益率
嘉实稳健混合:60%*日沪深300(大)指数收益率+40%*中债总指数收益率
嘉实债券:中央国债登记结算公司的中债债券指数

十、基金的风险控制

1. 嘉实增长混合:本基金属于中低风险证券投资基金,本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.8至2.0之间。
2. 嘉实稳健混合:本基金属于中低风险证券投资基金,本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.8至2.0之间。
3. 嘉实债券:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金经理人邵卫在报告期内不存在虚假记载、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。
本基金在报告期内未发生任何违法违规行为,本基金的投资组合符合基金合同规定,于2015年7月15日恢复了本报告中的财务指标,净值表现和投资组合报告内容,保证报告客观不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日(“报告期末”),本报告所列数据未经审计。

1. 嘉实增长混合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,229,706,360.41	71.14
2	固定收益投资	680,036,620.00	21.70
3	货币市场投资	680,036,620.00	21.70
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	其他	-	-
合计		3,134,463,180.41	100.00

2) 报告期末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	制造业	727,368,006.26	24.19
C	建筑业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储和邮政业	15,029,590.02	0.50
F	批发和零售业	81,110,670.00	2.70
G	信息传输、软件和信息技术服务业	1,175,540,790.81	39.09
H	金融业	117,880,943.74	3.92
I	房地产业	29,620,572.27	0.97
J	租赁和商务服务业	39,514,481.00	0.36
K	科学研究和技术服务业	68,436,204.89	2.18
L	水利、环境和公共设施管理业	-	-
M	卫生、社会保障和公共服务业	-	-
N	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
O	其他	-	-
合计		2,229,706,360.41	71.14

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	002450	康得新	5,496,444	168,191,186.40	5.59
2	002439	启明星辰	4,745,082	162,756,312.00	5.41
3	300104	东瑞	2,999,800	155,289,648.00	5.16
4	300089	绿创科技	2,930,320	147,386,320.00	4.90
5	300004	成发科技	1,519,169	103,234,800.00	3.43
6	300078	金亚科技	2,369,940	102,231,531.00	3.40
7	300283	达华智能	1,821,328	94,709,592.00	3.15
8	300054	康龙股份	3,438,322	91,149,916.00	3.02
9	600570	恒生电子	783,364	87,775,336.20	2.93
10	600446	金证股份	562,366	73,207,582.38	2.42

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	国债投资	15,060,225.00	0.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	664,976,397.30	22.11
4	其中:政策性金融债	664,976,397.30	22.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		680,036,620.00	22.61

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十名债券投资明细

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	160202	16国债02	2,500,000	261,360,000.00	8.36
2	160403	16国开03	1,200,000	120,732,000.00	4.01
3	160411	16国开11	900,000	90,367,000.00	3.04
4	160203	16国债03	500,000	50,290,000.00	1.67
5	160201	16国债01	400,000	40,240,000.00	1.35

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	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	160202	16国债02	2,500,000	261,360,000.00	8.36
2	160403	16国开03	1,200,000	120,732,000.00	4.01
3	160411	16国开11	900,000	90,367,000.00	3.04
4	160203	16国债03	500,000	50,290,000.00	1.67
5	160201	16国债01	400,000	40,240,000.00	1.35

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	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存在保证金	1,047,476.65	0.03
2	国债逆回购	22,364,264.11	0.74
3	其他	-	-
合计		23,411,740.76	0.77

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

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存在保证金	1,047,476.65	0.03
2	国债逆回购	22,364,264.11	0.74
3	其他	-	-
合计		23,411,740.76	0.77

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。

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。

(1) 投资组合报告附注

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。

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。