

嘉实增长开放式证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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10月27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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资人应当在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金为股票型证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金组成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。

基金合同生效后，如因不可抗力导致基金无法继续经营，将根据基金合同约定的程序进行基金财产清算。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	1,562,631,477.58	63.41
	其中：股票	1,562,631,477.58	63.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	609,581,744.00	24.86
	其中：债券	609,581,744.00	24.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	269,600,726.42	11.01
8	其他资产	17,569,400.79	0.72
9	合计	2,449,733,349.68	100.00

5.2 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 林农、渔业	10,897,554.00	0.34	
B 制造业	18,945,026.28	0.22	
C 制造业	480,398,374.74	59.08	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,472,989.03	3.38	
E 建筑业	16,651,599.61	2.05	
F 批发和零售业	52,983,966.11	6.62	
G 交通运输、仓储和邮政业	26,704,582.33	3.29	
H 餐饮和住宿业	1,663,462.00	0.20	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	41,686,736.45	5.13	
J 金融业	7,690,903.79	0.93	
K 房地产业	56,007,910.00	6.78	
L 租赁和商务服务业	26,033,674.61	3.20	
M 科学研究、技术服务业	6,007,621.00	0.75	
N 其他专业公共设施管理业	5,408,494.80	0.67	
O 国际服务、修理和其他服务业	-	0.00	
P 教育	2,711,317.70	0.33	
Q 文化、体育和娱乐业	13,959,846.00	1.72	
R 综合	12,567,726.18	1.64	
合计	806,602,894.00	99.10	

5.2.2 报告期末按照行业分类的股票投资组合

基金简称	嘉实中证500ETF
场内简称	500ETF
基金代码	159902
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	298,216,336.06份
投资目标	投资于有较高流动性的中小企业上市公司，以换取未来资本增值的机会，并寻求股票市场的长期稳定收益。
投资策略	本基金主要通过股票被动投资策略，即通过指数化投资方法，跟踪并复制中证500指数，从而达到与该指数相似的收益水平。
业绩比较基准	60%×上证综指+40%×深证成指+4%×货币市场基金收益
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金之一，风险收益特征与股票型基金相仿，但不保证基金一定盈利。
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

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期利润	364,913,319.18
2.本期利润	-672,069,547.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0011
4.期末基金资产净值	2,439,026,547.34
5.期末基金份额净值	0.8462

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，计价费用影响实际收益水平将低于所列示数字。

3.2 基金净值增长率

3.2.1 本报告期基金净值增长率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)
过去三个月	-0.02%	-0.23%	-3.18%	-0.21%

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

较

图：嘉实增长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

注：(1)本基金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，计价费用影响实际收益水平将低于所列示数字。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期利润	364,913,319.18
2.本期利润	-672,069,547.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0011
4.期末基金资产净值	2,439,026,547.34
5.期末基金份额净值	0.8462

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，计价费用影响实际收益水平将低于所列示数字。

3.4 基金净值增长率

3.4.1 本报告期基金净值增长率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)
过去三个月	-0.02%	-0.23%	-3.18%	-0.21%

3.4.2 自基金合同生效以来基金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

较

图：嘉实增长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

注：(1)本基金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，计价费用影响实际收益水平将低于所列示数字。

3.5 基金管理人报告

4.1 基金经理(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
董理	基金经理	2010年7月9日 -	6年	2008年加入嘉实基金管理有限公司研究部，曾任行业研究员；2010年7月加入嘉实基金管理有限公司，曾任量化投资部基金经理助理，现任基金经理。
邵健	本基金基金经理	2010年7月9日 - 2015年7月8日	17年	2001年就职于国泰君安证券研究所，历任行业研究员、助理分析师、高级分析师；2007年加入嘉实基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理，现任基金经理。

注：(1)任日期即为基金经理基金合同生效之日；(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》的规定；(3)基金管理人对基金经理小组的定义：基金管理人根据公司内部制度，对基金经理实行分类管理，基金经理小组的认定由基金经理小组成员共同商定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内，本基金整体表现良好，实现了较高的超额收益，超额收益主要来源于股票市场的结构性机会，同时受益于股票市场的估值修复。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人公平交易制度运作规范，未发现明显异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在报告期内，市场风格切换明显，股票市场的结构性机会显著，本基金通过积极的仓位调整，把握了市场的主要机会，取得了良好的投资回报。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内，市场风格切换明显，股票市场的结构性机会显著，本基金通过积极的仓位调整，把握了市场的主要机会，取得了良好的投资回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	1,562,631,477.58	63.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	609,581,744.00	24.86
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计		