

嘉实优化红利混合型证券投资基金

[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。

根据基金管理人2015年8月3日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更基金名称的公

告》,嘉实优化红利混合型证券投资基金自2015年8月3日起更名为嘉实优化红利混合型证券投资基金。

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。投资人对基金的风险、收益在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招

募说明书。

本基金报告期的财务资料未经审计。

本基金报告期2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:嘉实优化红利混合

基金主代码:070032

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年6月28日

报告期末基金份额总额:210,155,632,636份

投资目标:本基金主要投资于具有高分红潜力的红利股票,在严格控制风险的前提下,超越标的指数的回报。

本基金主要投资于具有高分红潜力的红利股票,通过严格控制投资风格,在严格控制风险的前提下,超越

标的指数的回报,追求在风险调整后的收益上超越标的指数的收益。

投资策略:本基金主要投资于具有高分红潜力的红利股票,通过严格控制投资风格,在严格控制风险的

前提下,超越标的指数的回报,追求在风险调整后的收益上超越标的指数的收益。

业绩比较基准:中证红利指数收益率×6%+恒生指数收益率×6%

风险收益特征:本基金为股票型基金,风险与收益高于债券型基金,属较高风险,较高收益品种。

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

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.本期三四季度收益 -34,150,997.04

2.本期利润 -34,900,177.76

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2110

4.期末基金份额净值 188,060,044.24

5.期末基金资产净值 0.996

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)上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计费费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 -17.02% 3.16% -28.37% 3.51% 11.35% -0.36%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

单位:净值增长率% 同期业绩比较基准收益率% 2012年6月28日至2015年9月30日

图:嘉实优化红利混合型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图

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金基金合同生效日起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“第十二部分二、投资范围和四、投资限制”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间 证券从业年限 说明

崔巍 大本基金兼增长型基金经理 2015年3月12日 - 6年 2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾担任嘉实基金管理有限公司研究员,曾担任嘉实基金管理有限公司基金经理,现任嘉实基金管理有限公司基金经理。

注:(1)任本基金基金经理,离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的年限遵从行业协会《证券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合规性情况的说明

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实优化红利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《证券投资基金运作管理办法》,并获得信息披露、投资决策和实施投资决策方面享受平等的机会。

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内本基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运行动态

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.2 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《证券投资基金运作管理办法》,并获得信息披露、投资决策和实施投资决策方面享受平等的机会。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.4 报告期内本基金投资策略和运行动态

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.5 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《证券投资基金运作管理办法》,并获得信息披露、投资决策和实施投资决策方面享受平等的机会。

4.4.6 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.7 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.8 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.9 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.10 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.11 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.12 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.14 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.15 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.16 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.17 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.18 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.19 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.20 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.21 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.22 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.23 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.24 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.25 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.26 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.27 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.28 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.29 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.30 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.31 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.32 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.33 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.34 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.35 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.36 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.37 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.38 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.39 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金根据宏观经济形势及市场情况,结合对宏观经济的判断,并根据投资策略,适时调整技术改进,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。

4.4.40 公平交易制度的执行情况

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年成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4.41 公平交易制度的