

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

基金管理人的董事会及基金管理人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的规定，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。投资人投资有风险，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7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基本信息		主要投资品种	
基金名称		嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金	
基金代码		000370	
基金运作方式		契约型开放式	
基金合同生效日		2014年12月10日	
报告期末基金份额总额		995,022,160.76份	
投资目标		本基金在严格控制投资风险的条件下，充分挖掘和利用市场中存在的投资机会，追求长期稳健的投资收益。	
投资策略		本基金将从宏观经济政策、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，通过股票、债券、货币市场工具、期权、期货等各类资产类别的投资比例，并根据宏观及微观环境的变化适时调整投资比例，从而达到最佳的风险收益比。	
业绩比较基准		一年期银行定期存款利率(税后)+1%	
风险收益特征		本基金为混合型证券投资基金，其收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金，属中较高风险、较高收益的品种。	
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

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -310,181,467.08

2.本期利润 -354,764,963.98

3.加权平均基金份额本期利润 -0.4041

4.期末基金份额净值 1,232,418,771.74

5.期末基金资产净值 1,425

(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不列所示。)

3.2 基金净值表现

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 (%) 标准差(%) 业绩比较基准收益率 (%) 盈利率差 (%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 -21.27% 2.38% 0.72% 0.001% -21.99% 2.37%

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

嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金近三月走势图

图：嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金近三月走势图

注：本基金基金合同生效日2014年12月10日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，

报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.报告期末基金总资产 2,200,140,336.01

本基金选择消费行业股票，在严格执行投资风险的条件下，力争获得超越业绩基准的回报。

投资策略

本基金选择消费行业股票，在严格执行投资风险的条件下，力争获得超越业绩基准的回报。

业绩比较基准

中证消费主题指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金选择消费行业股票，属于较高风险、较高收益的品种。

基金管理人

嘉实基金管理有限公司

基金托管人

中国建设银行股份有限公司

5.2 基金产品概况

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 1,827,422,342.89

5.期末基金份额净额 0.328

(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不列所示。)

3.2.3 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期净值增长率 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.1 报告期末基金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(%) 业绩比较基准收益率(%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 -22.03% 3.33% -23.96% 3.18% 1.12% 0.15%

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

嘉实新消费股票型证券投资基金近三月走势图

图：嘉实新消费股票型证券投资基金近三月走势图

注：本基金基金合同生效日2015年7月2日起至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，

报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

5.1.1 报告期内基金总份额持有者分布情况

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.2 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

嘉实新消费股票型证券投资基金近三月走势图

图：嘉实新消费股票型证券投资基金近三月走势图

注：本基金基金合同生效日2015年7月2日起至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，

报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

5.1.2 报告期内基金资产组合情况

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.报告期末基金总资产 2,200,140,336.01

本基金选择消费行业股票，在严格执行投资风险的条件下，力争获得超越业绩基准的回报。

投资策略

本基金选择消费行业股票，在严格执行投资风险的条件下，力争获得超越业绩基准的回报。

业绩比较基准

中证消费主题指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金选择消费行业股票，属于较高风险、较高收益的品种。

基金管理人

嘉实基金管理有限公司

基金托管人

中国建设银行股份有限公司

5.2.3 基金产品概况

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.4 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期净值增长率 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.5 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.6 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.7 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.8 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2732

4.期末基金份额净值 0.328

5.2.9 基金净值表现

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期已实现收益 -433,518,504.82

2.本期利润 -627,229,562.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0