嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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7月13日(基金合同生效日)起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新机遇混合发起式
基金主代码	001620
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月13日
报告期末基金份额总额	40,010,000,000.00份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、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,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300*50%+中债总指数*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,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	中国工商银行股份有限公司

§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7月13日(基金合同生效日)-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	84,017,911.80
2.本期利润	-3,036,851,538.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0759
4.期末基金资产净值	36,973,148,461.93
5.期末基金份额净值	0.924

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)本基金合同生效日为2015年7月13日,本报告期自2015年7月13日起至2015年9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

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	-7.60%	1.66%	-10.27%	1.53%	2.67%	0.13%

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

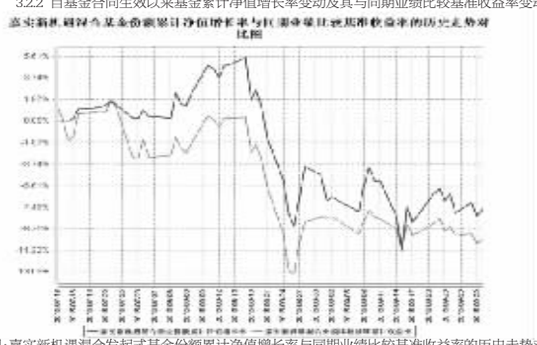

图:嘉实新机遇混合发起式基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年7月13日至2015年9月30日)

注1:本基金基金合同生效日2015年7月13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起6个月内为建仓期,本报告期处于建仓期内。

注2:2015年9月10日,本基金管理人发布《关于新增嘉实新机遇混合发起式基金经理的公告》,增聘谢泽林先生担任本基金基金经理职务,与基金经理王茜女士共同管理本基金。

§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		
王茜	本基金、嘉实多元债券、嘉实多利分级债券基金经理、公司固定收益部总监。	2015年7月13日	-	13年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理,中信证券固定收益部,长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008年11月加盟嘉实基金。工商管理硕士,具有基金从业资格,中国国籍。
谢泽林	本基金基金经理	2015年9月10日	-	6年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部,曾任行业研究员一职。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理王茜的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理谢泽林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 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、《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式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,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。本基金秉持价值投资、入弃我取的理念,兼顾股价的安全边际和中长期的增长空间,逐步买入优质的价值股和优质的成长股,以期获得较好的中长期投资回报。

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0.924元,本报告期基金份额净值增长率为-7.60%,业绩比较基准收益率为-10.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年初以来A股市场跌宕起伏,经历了3-6月份的非理性上涨,又经历了6-8月份的非理性下跌,其中一个重要原因是,大量杠杆资金的入市和平仓,加大了A股市场的成交量、波动幅度,严重扰乱了资本市场的正常定价功能。A股的日成交金额今年5月份高点达到2.36万亿,9月底已降至4000亿左右,可以判断杠杆资金已逐步撤出A股市场,市场可以逐步恢复相对正常的定价能力。

本基金成立于2015年7月13日,3季度本基金利用市场非理性下跌的机会逐步建仓,投资的方向主要是被市场错杀的、估值相对合理或低估的优质上市公司。从经济基本面来看,传统产业的需求疲软,甚至面临阶段性下滑的困难,迫切需要转型升级,但转型升级之路并不平坦。新兴产业是未来A股能够诞生新一批成长股的希望,但短期看估值并不便宜,需要时间来消化。展望4季度的A股市场,我们预计仍会以震荡为主,我们将遵循严格的选股标准,继续利用短期的非理性下跌机会,买入优质上市企业,包括优质的价值股和优质的成长股,以期获得较好的中长期投资回报。

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 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	21,842,189,647.63	48.56
	其中:股票	21,842,189,647.63	48.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,000,000.00	22.23
	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	13,053,732,861.47	29.02
8	其他资产	80,661,401.41	0.18
	合计	44,976,583,910.51	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	农、林、牧、渔业	228,402,293.34	0.62
B	采矿业	159,047,795.19	0.43
C	制造业	13,866,982,326.34	37.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,133,305,613.64	3.07
E	建筑业	368,636,123.71	1.00
F	批发和零售业	615,828,063.79	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,204,590,874.20	3.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,497,205,675.50	4.05
J	金融业	1,129,675,377.96	3.06
K	房地产业	418,163,184.64	1.13
L	租赁和商务服务业	358,972,337.25	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	221,640,598.42	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	58,072,416.16	0.16
R	文化、体育和娱乐业	573,766,172.38	1.55
S	综合	7,900,795.11	0.02
	合计	21,842,189,647.63	59.08

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

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	601166	兴业银行	52,869,987	769,787,010.72	2.08
2	600887	伊利股份	30,266,502	465,498,800.76	1.26
3	000651	格力电器	27,238,480	440,718,606.40	1.19
4	600519	贵州茅台	2,073,396	394,587,992.76	1.07
5	600795	国电电力	77,142,000	310,882,260.00	0.84
6	000333	美的集团	11,414,070	287,976,986.10	0.78
7	600115	东方航空	38,114,895	277,857,584.55	0.75
8	600011	华能国际	31,728,369	274,450,391.85	0.74
9	600518	康美药业	19,934,398	269,513,060.96	0.73
10	600271	航天信息	4,946,654	265,585,853.26	0.72

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	5,381,584.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,619,934.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	72,659,881.96
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	80,661,401.41

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
报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年7月13日)基金份额总额	40,010,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	40,010,000,000.00

§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
单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.02

注:报告期内(2015年7月13日(基金合同生效日)至2015年9月30日),基金管理人于本基金发售期内认购本基金基金份额总额10,000,000.00份,认购费1,000.00元。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	认购	2015年7月13日	10,001,000.00	10,000,000.00	-
合计			10,001,000.00	10,000,000.00	

注:根据《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》中对认购费率的规定,当认购金额大于等于500万元时,认购费用按单笔1000元收取。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.02	10,000,000.00	0.02	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.02	10,000,000.00	0.02	3年

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(1)中国证监会核准嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件;
(2)《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》;
(3)《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》;
(4)《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式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)报告期内嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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10月27日

嘉实稳健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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,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构成,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。每只基金均为契约型开放式,适用一个基金合同和招募说明书。

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

基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	3,732,736,493.37份
投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置,通过基本面分析挖掘行业优势企业,获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票40%-75%、债券20%-55%、现金5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮200(大盘)指数收益率+40%*中债总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金,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0.5至0.8之间。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-18,985,509.85
2.本期利润	-992,898,704.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2620
4.期末基金资产净值	3,693,208,965.85
5.期末基金份额净值	0.989

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	-20.63%	3.07%	-21.54%	2.68%	0.91%	0.39%

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:嘉实稳健混合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
(2003年7月9日至2015年9月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起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三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

§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		
郭东谋	本基金基金经理、嘉实周期优选股票基金、嘉实元和、嘉实逆向策略股票基金经理	2014年11月26日	-	11年	曾任机械证券研究员,2007年9月加入嘉实基金管理有限公司任研究部研究员、基金经理助理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。
翟琳琳	本基金基金经理、嘉实价值优势混合基金经理、嘉实新收益混合基金经理	2015年2月17日	-	10年	2006年7月加入嘉实基金,先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。
张淼	本基金基金经理、嘉实先进制造股票基金经理	2015年2月17日	-	10年	曾就职于东方基金管理有限公司研究部,2007年9月加入嘉实基金管理有限公司,先后担任研究员、研究部副总监和基金经理助理职务。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)任职日期、离任日期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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨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》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%,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

6月下旬,由于资金进入速度放缓、季度末银行回笼资金使得市场上资金开始紧张以及IPO供给增加、严查场外配资等一系列事件的促发下,市场开始了急速下跌,股灾、灾后修复、二次踩踏的一系列大的波动在3季度出现,尤其是到季度后期,所有悲观的预期,如经济衰退论、人民币大幅贬值等等最坏的预期在短期内集中爆发,导致市场迅速降至2850,沪深两市的成交量更是急剧萎缩,市场人气低迷到极点。

本基金在期初增加了交通运输、医疗服务等防御性行业配置,但泥沙俱下的情况下依然受到了重创,期间减持了高估值的个股,增加了内在价值被低估的个股,在板块方面,上个季度中提到的具有稳定现金流预期的如水泥以及国企改革相关的板块配置都有所增加,3季度市场起伏很大,基金净值也大幅波动,给投资者带来损失,再次表示歉意。

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0.989元,本报告期基金份额净值增长率为-20.63%,业绩比较基准收益率为-21.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一个季度,我们判断市场会进入修复期。一方面从投资者预期的角度,前面谈到所有悲观的预期已经反映,比如对经济、对汇率,以及对配资的清理所带来的影响等等。另一方面,政府已经出台一系列的微刺激政策,如在房地产、汽车等行业的刺激,刺激政策将会在未来一段时间看到效果,纵向相比经济继续下滑的概率降低,横向相比,我们看到美国加息在不断推后,全球各国经济都比较低迷,中国经济增速虽然下降,但相比其他国家来讲并不低,汇率大幅贬值的预期短期内消除。从流动性的角度来看,严查配资所带来的巨幅冲击已过,货币政策方面由于CPI、PPI都在低位,因此宽松的货币政策环境依然存在。

因此从仓位的角度,会相对乐观一些,市场终究会进入精选个股阶段,对于上市公司业绩的确定性要求会大幅提升。改革与创新的逻辑仍然存在,在这个大框架下去寻找板块中的优质公司。我们选择的方向主要包括:一是具备稳定现金流预期的资产,如水务运营、水泥;二是,行业景气度和市场集中度仍然提升的龙头企业,如传媒、先进装备制造等行业;三是,阶段性行业景气度显著提升的行业,如新能源设备等;四是具备制度红利的国企改革品种。

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	2,347,697,407.17	63.26
	其中:股票	2,347,697,407.17	63.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	960,861,000.00	25.89
	其中:债券	960,861,000.00	25.89
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
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	356,884,807.09	9.62
8	其他资产	46,863,573.22	1.24
	合计	3,711,306,787.48	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	农、林、牧、渔业	85,382,482.76	2.31
B	采矿业	779.02	0.00
C	制造业	1,343,398,940.24	36.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,520,587.30	2.37
E	建筑业	184,080,786.65	4.98
F	批发和零售业	289,845,142.95	7.85
G	交通运输、仓储和邮政业	17,256,639.90	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,831,104.10	0.65
J	金融业	20,880,706.53	0.57
K	房地产业	51,226,042.10	1.39
L	租赁和商务服务业	118,876,726.76	3.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	104,367,846.96	2.83
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	21,029,621.90	0.57
S	综合	-	-
	合计	2,347,697,407.17	63.57

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

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	000028	国药一致	3,240,741	182,842,607.22	4.95
2	600477	杭萧钢构	18,159,055	166,881,715.45	4.52
3	002400	省广股份	6,510,226	118,876,726.76	3.22
4	601992	金隅股份	12,929,207	98,779,141.48	2.67
5	002020	京新药业	3,584,997	96,002,420.50	2.57
6	000826	桑德环境	2,598,207	87,559,575.90	2.37
7	000963	华东医药	1,164,889	81,367,496.65	2.20
8	600835	上海机电	3,264,255	75,991,856.40	2.06
9	002283	天润曲轴	4,795,719	73,134,714.75	1.98
10	000876	新希望	5,061,833	69,094,020.45	1.87

5.4 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	国家债券	251,525,000.00	6.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	709,336,000.00	19.21
	其中:政策性金融债	709,336,000.00	19.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	960,861,000.00	26.02

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

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	120009	12附息国债09	2,500,000	251,525,000.00	6.81
2	150403	15农发03	2,500,000	251,050,000.00	6.80
3	110208	11国开08	1,000,000	104,950,000.00	2.84
4	110235	11国开35	500,000	51,395,000.00	1.39
5	110216	11国开16	500,000	51,185,000.00	1.39

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	4,945,443.55
2	应收证券清算款	24,270,828.00
3	应收股利	-
4	应收利息	16,386,331.89
5	应收申购款	260,969.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	45,863,573.22

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

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	000876	新希望	69,094,020.45	1.87	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,979,923,799.60
报告期期间基金总申购份额	79,291,353.45
减:报告期期间基金总赎回份额	326,478,659.68
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,732,736,493.37

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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)中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件;
(2)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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》;
(3)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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招募说明书》;
(4)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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)报告期内嘉实稳健开放式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10月27日

嘉实先进制造股票型证券投资基金

【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	嘉实先进制造股票
基金主代码	001039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月24日
报告期末基金份额总额	3,709,963,959.23份
投资目标	本基金为股票型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,把握中国制造业产业升级过程中的投资机会,