嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月18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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证主要消费ETF
场内简称	主要消费
基金主代码	512600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月13日
报告期末基金份额总额	10,451,224.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时,或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证主要消费指数
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-224,128.15
2.本期利润	2,331,105.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.2196
4.期末基金资产净值	15,540,575.65
5.期末基金份额净值	1.4870

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

主要财务指标	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

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

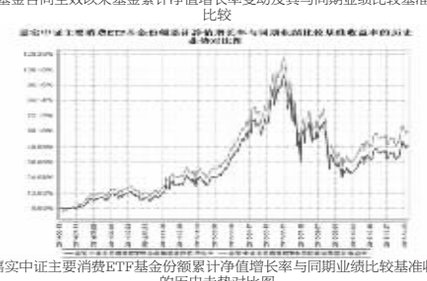

图:嘉实中证主要消费ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年6月13日至2015年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,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(十三(二)投资范围和(七)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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中创400ETF及其联接、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF及其联接、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证500ETF及其联接、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金经理	2014年6月13日	-	9年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc.)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任公司指数投资部基金经理助理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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、《嘉实中证主要消费交易型开放式指数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超过该证券当日成交量的5%的,合计2次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,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

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.08%,年度化拟合偏离度为1.32%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

本基金跟踪的标的指数为中证主要消费行业指数,是中证行业指数系列的组成部分。中证行业指数将中证800指数800只样本股按行业进行分类,再以各行业全部股票作为样本编制行业指数,能够反映沪深两个市场A股中不同行业公司股票的整体表现,为投资者提供行业投资及分析工具。中证行业系列指数的全市场覆盖度及个股集中度较优,具备较强的行业代表性及投资性。

本基金主要采取完全复制法及其它指数投资技术构建基金的股票投资组合,以达到有效跟踪标的指数的目的;并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行适时地调整。

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1.4870元;本报告期基金份额净值增长率为16.93%,业绩比较基准收益率为16.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证主要消费指数的被动投资管理产品,将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低本基金的跟踪误差,给投资者提供一个标准化的中证主要消费行业指数的投资工具。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至报告期末本基金连续20个工作日出现基金资产净值低于5,000万元。

§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	15,238,970.85	96.94
	其中:股票	15,238,970.85	96.94
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	467,848.90	2.98
7	其他资产	13,874.39	0.09
	合计	15,720,694.14	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,225,632.50	7.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,278,511.46	72.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,465,142.84	15.86
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	269,684.05	1.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,238,970.85	98.06

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600887	伊利股份	97,754	1,606,098.22	10.33
2	600519	贵州茅台	6,934	1,512,929.46	9.74
3	600518	康美药业	55,000	932,250.00	6.00
4	000858	五粮液	33,900	924,792.00	5.95
5	002304	洋河股份	10,720	734,748.80	4.73
6	000876	新希望	22,000	417,780.00	2.69
7	601607	上海医药	20,600	410,146.00	2.64
8	600315	上海家化	9,616	379,735.84	2.44
9	601933	永辉超市	36,300	366,630.00	2.36
10	000895	双汇发展	17,700	361,257.00	2.32

注:本基金采取完全复制法,完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合。

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1)2013年11月21日,上海家化发布《关于收到中国证监会<调查通知书>的公告》,证监会决定对公司立案稽查;2014年12月24日发布《关于收到上海证监局<行政处罚事先告知书>的公告》,公司决定行使陈述、申辩和要求听证的权利;2015年6月13日发布《关于收到上海证监局<行政处罚决定书>的公告》,中国证监会上海证监局正式对公司作出行政处罚决定。

本基金投资于"上海家化(600315)"的决策程序说明:本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,上海家化为标的指数的成份股,本基金投资于"上海家化"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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中,其他九名证券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	13,771.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	13,874.39

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	417,780.00	2.69	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	10,951,224.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	1,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	10,451,224.00

§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
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)中国证监会核准嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
(2)《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
(3)《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
(4)《嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》;
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(6)报告期内嘉实中证主要消费交易型开放式指数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
2016年1月21日

嘉实周期优选混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月18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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实周期优选混合
基金主代码	070027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月8日
报告期末基金份额总额	1,742,020,921.45份
投资目标	本基金优选周期行业股票,在严格控制投资风险的条件下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报收益。
投资策略	本基金将参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,在对宏观经济及产业景气周期的研判基础上,优选周期行业股票,寻找具备基本面健康、估值有优势、竞争优势强、管理水平高的合理投资标的,在严格控制投资风险的条件下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	100,735,575.14
2.本期利润	866,398,885.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.4389
4.期末基金资产净值	3,849,816,888.90
5.期末基金份额净值	2.210

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)所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
2011年12月8日至2015年12月31日	22.57%	2.03%	15.76%	1.59%	6.81%	0.44%

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:嘉实周期优选混合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
(2011年12月8日至2015年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,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(第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二)投资组合限制)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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭东谋	本基金、嘉实元和、嘉实稳健混合、嘉实迎向策略股票基金经理	2014年4月29日	-	11年	曾任招商证券研究员,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。

注:(1)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、《嘉实周期优选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超过该证券当日成交量的5%的,合计2次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,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

四季度经济仍未有起色,大宗商品价格和工业生产指数持续下行;政府在经济总量刺激方面依旧谨慎,货币环境持续宽松,高层提出供给测改革等顶层设计方案,目前看对经济的影响仍有待观察。短期看经济呈现L型底,复苏缓慢。本季度上证指数上涨16%,沪深300上涨17%,创业板上涨30%。

本组合一直以来秉承价值投资策略,选择相对低估的确定性增长行业,期望通过价值发现以及周期成长的结合获得长期最优回报。考虑到供给测改革的逐步推出,组合在四季度增加了迄资源板块的配置(主要是周期偏上游的行业,如有色、钢铁、石化等),继续保持对金融品,通信设备领域,铁路设备、电气设备以及现代农业等高端制造业等方向的主要配置,主题上紧跟国企改革,大数据时代,新能源汽车和能源互联网,农业现代化,军工以及信息宽带建设和信息安全等方向。从四季度表现看,组合跑赢了主板市场,在创业板上配置仍很少,本季度仍旧没有跑过创业板指数。

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2.210元;本报告期基金份额净值增长率为22.57%,业绩比较基准收益率为15.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年一季度,经过持续三个季度的大幅震荡,主板市场长期看已经具备较好的投资价值;未来板块和个股分化将是大势所趋,价值投资将成为市场的主导力量。配合十三五规划的推进,政府在消费型基建以及能源互联网等方向上有可能进一步加大财政刺激的力度,货币政策有望进一步宽松,经济层面上随着政策推进将逐步见底回升。全方位改革,包含国企改革的大范围启动可能在未来一段时间成为主导市场的核心因素,并持续发酵。在配置方向上,我们仍坚持过去几个季度的看法,谨慎看待创业板为代表的高估值品种,重点优选有核心竞争力的龙头企业,估值合理的,增长明确的,在全国具备核心竞争力或者在全球具备一定的定价权优势的行业品种,包括并不仅限于高铁装备,电力设备以及通信设备等,优质制造业将成为未来经济发展以及市场演绎的主旋律。

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	3,634,227,257.75	93.57
	其中:股票	3,634,227,257.75	93.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,049,809.60	0.13
	其中:债券	5,049,809.60	0.13
	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	239,759,238.16	6.17
8	其他资产	4,798,275.98	0.12
	合计	3,883,834,581.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	73,498,281.00	1.91
B	采矿业	104,998,614.00	2.73
C	制造业	2,652,816,551.13	68.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,330,000.00	0.66
F	批发和零售业	91,059,643.50	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	90,220,000.00	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,573,426.00	3.21
J	金融业	319,520,945.00	8.30
K	房地产业	107,569,797.12	2.79
L	租赁和商务服务业	45,640,000.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,634,227,257.75	94.40

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	000063	中兴通讯	18,000,000	335,340,000.00	8.71
2	002202	金风科技	11,997,810	273,430,089.90	7.10
3	600498	烽火通信	7,998,320	228,032,103.20	5.92
4	601766	中国中车	17,003,930	218,500,500.50	5.68
5	600089	特变电工	16,999,841	200,088,128.57	5.20
6	600030	中信证券	10,004,700	193,590,945.00	5.03
7	600143	金发科技	18,000,000	154,800,000.00	4.02
8	600517	置信电气	9,998,075	126,575,629.50	3.29
9	000039	中集集团	6,000,000	126,000,000.00	3.27
10	600036	招商银行	7,000,000	125,930,000.00	3.27

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,000,100.00	0.03
	其中:政策性金融债	1,000,100.00	0.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,049,709.60	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	5,049,809.60	0.13

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	110031	航信转债	31,190	4,049,709.60	0.11
2	018001	国开1301	10,000	1,000,100.00	0.03

注:报告期末本基金仅持有上述2只债券。

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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1)2015年11月27日,中信证券发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》,证监会决定对公司立案调查。

本基金投资于"中信证券(600030)"的决策程序说明:基于中信证券基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"中信证券"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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	2,795,930.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111,061.76
5	应收申购款	1,891,283.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	4,798,275.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	4,049,709.60	0.11

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

报告期期初基金份额总额	2,158,379,189.53
报告期期间基金总申购份额	164,306,629.45
减:报告期期间基金总赎回份额	580,664,897.53
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,742,020,921.45

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;基金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)中国证监会核准嘉实周期优选混合型证券投资基金募集的文件;
(2)《嘉实周期优选混合型证券投资基金基金合同》;
(3)《嘉实周期优选混合型证券投资基金托管协议》;
(4)《嘉实周期优选混合型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)报告期内嘉实周期优选混合型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
2016年1月21日

嘉实主题精选混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月18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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21日
报告期末基金份额总额	2,666,296,208.50份
投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用"主题投资策略",从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合,并优先考虑股票类资产的配置,剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%
风险收益特征	较高风险,较高收益。
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-79,200,157.77
2.本期利润	1,556,975,936.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.5771
4.期末基金资产净值	5,192,065,057.01
5.期末基金份额净值	1.947

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	41.70%	2.36%	15.66%	1.59%	26.04%	0.77%

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

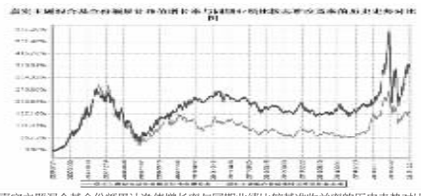

图:嘉实主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年7月21日至2015年12月31日)

注:按基金合同约定,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十四条((二)投资范围、(八)2.投资组合比例限制)约定:(1)资产配置范围为:股票资产30%~95%,债券0~70%,权证0~3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基