

## 嘉实新收益灵活配置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止。

## § 2 基金产品概况

基金简称		嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金
基金代码		000061
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2014年12月1日
报告期末基金份额总额		1,151,191,470.00份
投资目标		本基金将在严格控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力求长期稳健的绝对收益。
投资策略		本基金将从宏观经济政策、基本面和资金面等几个维度进行综合分析，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金股票、债券、现金仓位比例，根据宏观经济形势和市场环境的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准		一年期银行存款利率(税后)+1%
风险收益特征		本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于货币型基金，低于股票型基金。
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.本期实现收益	-	131,269,188.43
2.本期利润	-	362,878,712.66
3.加权平均基金份额本期利润	-	0.3620
4.期末基金份额净值	-	2,083,338,144.00
5.期末基金净值	-	1,810

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 本基金报告期内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(%)	净值增长率标准差(%)	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	27.02%	1.76%	0.64%	0.01%	26.39%	1.75%

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

嘉实新收益混合基金份额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12月1日至2015年12月31)

注:基金管理人和招募说明书中约定,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(十二)(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限	证券从业年限	说明
陈少平	本基金基金经理 嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年1月13日	-	12年
翟琳琳	本基金基金经理 嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年12月10日	-	10年

注:(1)基金经理翟琳琳的任职日期是指本基金合同生效之日起,基金经理陈少平的任期即指公司作出决定公告之日,即2015年1月13日起; (2)证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定; (3)2016年1月14日,本基金管理人发布《关于变更新收益混合型基金经管变更的公告》,翟琳琳女士不再担任本基金基金经理,由陈少平女士接替管理本基金。

4.2 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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,公平对待对待管理的所有投资组合。

4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.4 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.6 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.7 公平交易专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.8 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.9 公平交易专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.10 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.11 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.12 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.14 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.15 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.16 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.17 公平交易专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.18 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.19 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.20 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。

4.21 公平交易专项说明

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.22 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新收益灵活配置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。

4.23 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金实现了良好的投资回报。

展望16年一季度,随着新一轮的年初,年初流动性预计还将持续改善。但目前经济复苏的迹象仍比较微弱。全年经济逐步底部震荡的可能性大,但是未来经济上行趋势仍不明确。

在流动性驱动的驱动下,预计市场将继续保持之前的风格,未来市场潜在的风险主要来源于供给端的支撑,随着注册制开放后,新股供给可能提,如果届时市场流动性支撑不够,市场将有大幅震荡的风险。同时未来的流动性也需要观察是否能够延续宽松的背景。