

B060信息披露Disclosure

嘉实稳健开放式证券投资基金

【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法律责任。

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。投资者有风险,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。每只基金均为独立的开放式,适用一个基金合同和招募说明书。

§ 2 基金产品概况

基金名称	基金代码
嘉实稳健基金	070003
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	3,686,463,126.69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,以获取资本增值和长期稳定收益为目的,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	在有效控制风险的前提下进行资产配置,通过本基金内部资产配置委员会,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%-65%,现金5%-20%。
业绩比较基准	60%沪深300(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,长期预期风险水平略高于债券型基金。
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

单位:人民币元

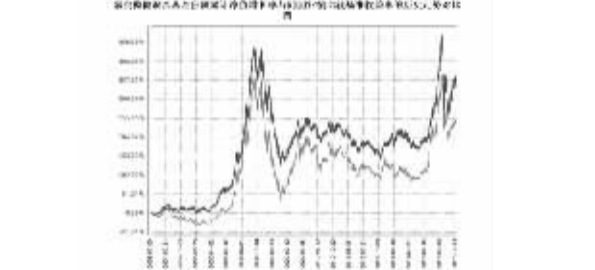
主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	97,747,002.42
2.本期利润	831,272,561.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.2264
4.期末基金资产净值	4,362,720,570.06
5.期末基金份额净值	1.214

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	22.29%	11.27%	11.62%	11.23%	10.67%	0.07%

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



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,建仓期满后本基金的各项投资比例应符合基金合同(四)投资组合比例(四)基金投资组合比例的限制。(1)投资组合比例,债券的投资不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家上市公司股票,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上市公司证券,不得超过该证券的10%;(4)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;(5)本基金投资于同一原始权益人的各类资产,不得超过本基金资产净值的10%;(6)法律法规及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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郭东斌	本基金基金经理、嘉实理财通系列基金基金经理	2014年11月26日	-	11年	曾任招商证券研究员,2007年加入嘉实基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理。
邵琳琳	本基金基金经理、嘉实理财通系列基金基金经理	2015年8月17日	-	10年	2005年7月加入嘉实基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理。
张磊	本基金基金经理、嘉实理财通系列基金基金经理	2015年12月17日	-	10年	曾就职于东方基金管理有限责任公司,2007年加入嘉实基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理。

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 管理人对于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守了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.3 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,严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《嘉实理财通系列基金基金合同》及《嘉实稳健证券投资基金基金合同》,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

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	63,070,569.09	1.46
B	采矿业	97,747,002.42	0.00
C	制造业	1,502,436,094.07	34.62
D	电力、热力、燃气及生产供应业	1,392,774.00	0.00
E	建筑业	229,382,847.38	5.27
F	批发和零售业	294,503,032.12	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	23,619,862.20	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,162,622.20	1.45
J	金融业	109,277,765.76	2.51
K	房地产业	11,743,212.48	0.26
L	租赁和商务服务业	206,062,231.81	4.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	102,940,961.34	2.36
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	126,103,493.00	2.90
S	综合	-	-
合计		2,893,038,001.70	66.48

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

代码	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	226,814,832.88	5.19
2	600477	机不可失	14,520,424	178,724,215.20	4.10
3	000033	荣昌医药	2,058,142	168,605,318.32	3.88
4	000409	顺广股份	6,510,228	160,772,163.00	3.70
5	600202	招商局	3,584,997	120,776,649.36	2.78
6	000026	同益通	2,508,207	102,940,961.34	2.36
7	600526	上海银行	3,284,256	98,399,669.66	2.27
8	601092	金隅股份	10,535,907	98,702,708.59	2.27
9	000076	新希望	5,061,833	89,138,679.13	2.05
10	000349	同力股份	1,325,073	83,644,676.06	1.92

5.4 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债券投资明细

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	000000	国债一债	226,814,832.88	5.19
2	000477	机不可失	178,724,215.20	4.10
3	000033	荣昌医药	168,605,318.32	3.88
4	000409	顺广股份	160,772,163.00	3.70
5	600202	招商局	120,776,649.36	2.78
6	000026	同益通	102,940,961.34	2.36
7	600526	上海银行	98,399,669.66	2.27
8	601092	金隅股份	98,702,708.59	2.27
9	000076	新希望	89,138,679.13	2.05
10	000349	同力股份	83,644,676.06	1.92

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十名债券投资明细

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国债附息09	2,500,000	267,778,000.00	6.02
2	150403	15沪债03	2,500,000	265,500,000.00	5.96
3	110208	11国债附息8	1,000,000	107,020,000.00	2.48
4	110206	11国债附息6	500,000	52,036,000.00	1.20
5	110216	11国债附息16	500,000	51,768,000.00	1.19

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

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国债附息09	2,500,000	267,778,000.00	6.02
2	150403	15沪债03	2,500,000	265,500,000.00	5.96
3	110208	11国债附息8	1,000,000	107,020,000.00	2.48
4	110206	11国债附息6	500,000	52,036,000.00	1.20
5	110216	11国债附息16	500,000	51,768,000.00	1.19

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权证投资明细

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	226,814,832.88	5.19	流通股受限制情况
2	000028	招商局	120,776,649.36	2.78	流通股受限制情况
3	000076	新希望	89,138,679.13	2.05	流通股受限制情况
4	000349	同力股份	83,644,676.06	1.92	流通股受限制情况
5	合计			56,143,230.36	

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.