

# 嘉实事件驱动股票型证券投资基金

## 【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

基金名称	嘉实事件驱动股票
基金代码	091416
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
报告期末基金份额总额	13,443,424,462.07份
投资目标	立足于中国特定的投资环境,将自上而下的宏观及行业投资策略与自下而上的个股精选策略相结合,在事件驱动的投资决策框架之内,在深入挖掘并充分理解事件驱动的经济增长、结构性改革及行业轮动所带来的结构性投资机会,通过精选、主动管理,追求超越市场平均回报的长期增值,力争实现投资者的长期稳定增值。
投资策略	事件性投资是主题性投资的股票上的具体表现形式。而相对与主题性投资所关注的是投资机会而言,事件性投资更加具体,与个股的关联度更加紧密。在事件驱动的投资决策框架内,事件性投资以更加科学、有效地跟踪事件中所带来的超额收益,以更深入、更前瞻的眼光挖掘事件驱动型投资机会,从事件驱动的投资逻辑和行市出发,力争实现投资者的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

主要财务指标	报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	126,389,690.93
2.本期利润	1,396,402,727.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.1416
4.期末基金资产净值	12,290,590.23
5.期末基金份额净值	0.902

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据。

### 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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	18.22%	1.40%	13.68%	1.24%	0.06%

#### 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的比较

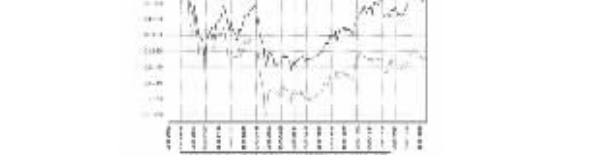


图:嘉实事件驱动股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年6月9日至2015年12月31日)  
注:本基金基金合同于2015年6月9日生效,截至报告期末未满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之日起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。

### 4.1 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
张自力	本基金、嘉实美国核心成长股票(LOF)基金经理、投资顾问兼首席投资官	2015年6月9日 - 19年	19年	理学硕士,毕业于美国加州大学伯克利分校,拥有硕士学位,具有18年公募基金从业经验。曾任美国Century Investments)美国固定收益、研究部基金经理,负责美国固定收益、资产组合下近一百亿美元资产管理,负责美国对冲基金对冲基金、2015年2月加入嘉实基金管理有限公司,投资美国股票。

注:(1)任职日期指基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含离任从业协会《证券投资基金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守《证券投资基金法》及其他相关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,未发生任何违法违规行为,也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

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的相关规定,严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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的相关规定,严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行,未发现异常交易行为。

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2016年一季度,我们认为市场仍将维持震荡格局,个股分化明显。一方面,九月中以来中央经济工作会议的定调,为市场提供了明确的指引,市场风险偏好有所回升。另一方面,市场整体估值已接近历史低位,估值提升空间不大。但一季度的时间窗口依然处于窗口期,上市公司业绩有望超预期,个股机会依然不少。资产价格波动仍有一定的增量资金希望能够在股票市场中,因此,本基金在操作策略上偏向于个股精选。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
无。

### 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	10,526,101,196.52	86.47
2	其中:股票	10,526,101,196.52	86.47
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	1,457,372,546.48	11.97
10	其中:应收股利、应收利息、应收申购款等	189,949,163.97	1.56
11	合计	12,173,473,743.00	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,899,640.00	0.06
B	采矿业	80,436,564.69	0.66
C	制造业	6,763,349,044.66	55.68
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	386,303,367.30	3.27
E	建筑业	118,100,256.56	0.96
F	批发和零售业	284,020,028.14	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	226,056,591.96	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,474,972,389.16	12.16
J	金融业	296,342,121.00	2.04
K	房地产业	187,067,544.65	1.54
L	租赁和商务服务业	94,060,177.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	104,585,420.09	0.86
O	教育、体育和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,231,544.46	0.06
R	文化、体育和娱乐业	112,967,680.25	0.93
S	综合	-	-
合计	-	10,526,101,196.52	86.78

### 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	300086	纳创维	7,181,411	179,838,267.60	1.48
2	200022	天华能源	7,082,334	172,081,341.60	1.42
3	300136	信维通信	5,159,183	152,463,789.55	1.26
4	300088	高新兴	6,221,072	130,580,301.28	1.08
5	300319	麦捷科技	3,323,417	119,643,012.00	0.99
6	000661	长春高新	966,964	116,470,813.80	0.96
7	300017	网宿科技	1,033,768	116,006,742.52	0.96
8	002875	银禧科技	2,061,173	115,446,289.73	0.95
9	002281	光迅科技	1,773,442	114,972,244.86	0.95
10	000699	东方路桥	1,528,506	100,236,756.00	0.83

### 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五名债券投资明细

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。

### 5.6 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。

### 5.7 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

报告期末,本基金未持有权证。

### 5.8 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。

### 5.9 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。

### 5.10 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.11 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.12 基金资产构成

截至本报告期末,本基金资产构成如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.13 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.14 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.15 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.16 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.17 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.18 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.19 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.20 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.21 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.22 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.23 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.24 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.25 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.26 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.27 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.28 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.29 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.30 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.31 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下:

1. 银行存款: 454,236.53  
2. 交易性金融资产: 86,241,951.05  
3. 应收股利: 33,394,679.32  
4. 应收利息: 1,993,849.05  
5. 其他应收款: 33,394,679.32  
6. 其他流动资产: 1,993,849.05  
7. 待摊费用: -  
8. 其他: 121,084,706.00  
合计: 121,084,706.00

### 5.32 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金资产组合如下: