

## 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、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。

本报告期中未出现财务数据未经审计。

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:嘉实事件驱动股票

基金代码:001416

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:13,443,424,462.01份

投资目标:立足于不同行业不同的投资机会,将自上而下的行业趋势分析与个股选择相结

合,深入挖掘并充分理解行业内潜规则、行业模型及行业投资逻辑,通过行业配置和个股选择,力争获取超越基准的收益。

投资策略:本基金将通过深入研究不同行业的投资机会,把握具有竞争优势的企业的投资价值,力求实现投资者的长期稳定增值。

业绩比较基准:90%×沪深300指数+10%×业绩基准指数

风险收益特征:本基金为股票型基金,属于较高预期风险和较高预期收益的基金品种,基金净值

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 126,385,690.33

2.本期利润 1,996,462,737.42

3.加权平均基金份额本期利润 0.1416

4.期末基金资产净值 12,129,269,689.23

5.期末基金份额净值 0.092

注:1)本基金对权益类资产的本期利息收入、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,本报告期内已实现收益加上本期公允价值变动收益后,低于零时列示。

2)本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,其中费用计算方法详见本报告第十一部分“费用”之“(四)投资人负担的费用”。

3.2 基金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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 10.22% 1.40% 13.68% -3.46% 4.65% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实事件驱动股票型证券投资基金净值走势图

注:1)在基金合同生效日至2015年12月31日的历史走势对比图

注:本基金合同生效日在2015年6月9日至报告期末的1年内,按基金合同和招募说明书的约定,本基金合同生效日起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(十一)“二(二)投资限制”(四)“投资限制”的有关约定。

4.1 管理人报告

4.1.1 基金经理(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,嘉实回报、嘉实主题精选、嘉实稳健、嘉实增长、嘉实货币基金经理,固定收益部负责人 2015年6月9日 - 19年

本基金的基金经理,毕业于美国明尼苏达大学金融与中国市场学系,具有19年公募基金从业经验,曾任职于美国世纪投资管理公司、景顺长城基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司、鹏华基金管理有限公司、国泰基金管理有限公司、国海富兰克林基金管理有限公司、国泰君安证券股份有限公司,具有丰富的基金行业经验。

4.1.2 管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内,本基金严格按照基金合同及有关法律法规的规定进行投资操作,在严格控制风险的前提下,实现了本基金的投资目标,取得了良好的投资回报。

4.1.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司内部公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均建立了公平交易制度,并完善了内部控制流程,确保公平交易制度的有效执行。

4.1.4 投资组合偏离度的说明

报告期内,本基金严格按照基金合同及有关法律法规的规定进行投资操作,在严格控制风险的前提下,实现了本基金的投资目标,取得了良好的投资回报。

4.1.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

报告期内,我们认为市场仍然会保持震荡行情,个股分化明显。一方面,九月中旬以来,随着经济数据的公布,市场情绪有所好转,但整体来看,经济和企业盈利下滑的趋势相对改善,目前市场估值已经处于历史低位,但行业分化依然存在,且部分行业估值已经较低,但整体估值依然偏高,仍需关注行业龙头公司的投资机会。

4.1.6 管理人对本基金未来收益的预判

本基金未来收益将取决于宏观经济环境、证券市场表现、行业政策以及上市公司的经营情况,本基金将持续关注对本基金的风险收益特征,努力优化投资组合的风险收益比,力争取得好的投资效果,回报投资者。

4.2 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:1)本基金对权益类资产的本期利息收入、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,本报告期内已实现收益加上本期公允价值变动收益后,低于零时列示。

2)本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,其中费用计算方法详见本报告第十一部分“费用”之“(四)投资人负担的费用”。

3.2.1 基金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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 5.66% 0.32% 1.44% 0.02% 4.22% 0.30%

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:嘉实事件驱动股票型证券投资基金净值走势图

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)上述本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,其中费用计算方法详见本报告第十一部分“费用”之“(四)投资人负担的费用”。

3.2.3 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。

本报告期中的财务数据未经审计。

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:嘉实事件驱动股票

基金代码:070020

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年1月1日

报告期末基金份额总额:1,222,376,442.40份

投资目标:本基金在综合考虑资金安全、有效控制风险的前提下,力争持续稳定的获得尽可能多的收益。

投资策略:本基金在综合考虑资金安全、有效控制风险的前提下,力争持续稳定的获得尽可能多的收益。

业绩比较基准:本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金,低于股票型基金。

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,但不保证基金一定盈利。

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

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 37,561,126.73

2.本期利润 57,668,769.83

3.加权平均基金份额本期利润 0.0961

4.期末基金资产净值 1,331,640,960.56

5.期末基金份额净值 0.1081

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)上述本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,其中费用计算方法详见本报告第十一部分“费用”之“(四)投资人负担的费用”。

3.2.1 基金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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 5.66% 0.32% 1.44% 0.02% 4.22% 0.30%

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:嘉实事件驱动股票型证券投资基金净值走势图

(2015年9月1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投资组合比例符合基金合同“十一、基金的投资”(二)“投资范围”(六)“投资组合限制”的有关规定。

4.1 基金经理(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,嘉实回报、嘉实主题精选、嘉实稳健、嘉实增长、嘉实货币基金经理,固定收益部负责人 2015年6月9日 - 19年

本基金的基金经理,毕业于美国明尼苏达大学金融与中国市场学系,具有19年公募基金从业经验,曾任职于美国世纪投资管理公司、景顺长城基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司、鹏华基金管理有限公司、国泰基金管理有限公司、国海富兰克林基金管理有限公司、国泰君安证券股份有限公司,具有丰富的基金行业经验。

4.1.1 管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内,本基金严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司内部公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均建立了公平交易制度,并完善了内部控制流程,确保公平交易制度的有效执行。

4.1.2 投资组合偏离度的说明

报告期内,本基金严格按照基金合同及有关法律法规的规定进行投资操作,在严格控制风险的前提下,实现了本基金的投资目标,取得了良好的投资回报。

4.1.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司内部公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均建立了公平交易制度,并完善了内部控制流程,确保公平交易制度的有效执行。

4.1.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期初的仓位为39%,建仓工作在报告期初完成,到了报告期末的仓位为30%左右,整体仓位降低,但整体仓位依然偏高,仍需关注市场变化。

4.1.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

报告期内,我们认为市场仍然会保持震荡行情,个股分化明显。一方面,九月中旬以来,随着经济数据的公布,市场情绪有所好转,但整体来看,经济和企业盈利下滑的趋势相对改善,目前市场估值已经处于历史低位,但行业分化依然存在,且部分行业估值已经较低,但整体估值依然偏高,仍需关注行业龙头公司的投资机会。

4.1.6 管理人对本基金未来收益的预判

本基金未来收益将取决于宏观经济环境、证券市场表现、行业政策以及上市公司的经营情况,本基金将持续关注对本基金的风险收益特征,努力优化投资组合的风险收益比,力争取得好的投资效果,回报投资者。

4.2 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:1)本基金对权益类资产的本期利息收入、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,本报告期内已实现收益加上本期公允价值变动收益后,低于零时列示。

2)本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,其中费用计算方法详见本报告第十一部分“费用”之“(四)投资人负担的费用”。

3.2.1 基金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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去三个月 5.66% 0.32% 1.44% 0.02% 4.22% 0.30%

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:嘉实事件驱动股票型证券投资基金净值走势图

(2015年9月1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投资组合比例符合基金合同“十一、基金的投资”(二)“投资范围”(六)“投资组合限制”的有关规定。

4.1 基金经理(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,嘉实回报、嘉实主题精选、嘉实稳健、嘉实增长、嘉实货币基金经理,固定收益部负责人 2015年6月9日 - 19年

本基金的基金经理,毕业于美国明尼苏达大学金融与中国市场学系,具有19年公募基金从业经验,曾任职于美国世纪投资管理公司、景顺长城基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司、鹏华基金管理有限公司、国泰基金管理有限公司、国海富兰克林基金管理有限公司、国泰君安证券股份有限公司,具有丰富的基金行业经验。

4.1.1 管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内,本基金严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司内部公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均建立了公平交易制度,并完善了内部控制流程,确保公平交易制度的有效执行。

4.1.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期初的仓位为39%,建仓工作在报告期初完成,到了报告期末的仓位为30%左右,整体仓位降低,但整体仓位依然偏高,仍需关注市场变化。

4.1.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司内部公平交易制度,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均建立了公平交易制度,并完善了内部控制流程,确保公平交易制度的有效执行。

4.1.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期初的仓位为39%,建仓工作在报告期初完成,到了报告期末的仓位为30%左右,整体仓位降低,但整体仓位依然偏高,仍需关注市场变化。

4.1.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

报告期内,我们认为市场仍然会保持震荡行情,个股分化明显。一方面,九月中旬以来,随着经济数据的公布,市场情绪有所好转,但整体来看,经济和企业盈利下滑的趋势相对改善,目前市场估值已经处于历史低位,但行业分化依然存在,且部分行业估值已经较低,但整体估值依然偏高,仍需关注行业龙头公司的投资机会。