

嘉实企业变革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法律责任。
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	嘉实企业变革股票
基金代码	001030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年02月12日
报告期末基金份额总额	2,188,082,001.95份
投资目标	本基金主要投资于企业变革主题相关的股票,深入挖掘上市公司发生企业变革并能成为或者将成为投资机遇,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于企业变革主题相关的股票,深入挖掘上市公司发生企业变革并能成为或者将成为投资机遇,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证红利指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高风险和预期收益较高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、债券型基金和货币市场基金。
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

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日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-40,420,261.32
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

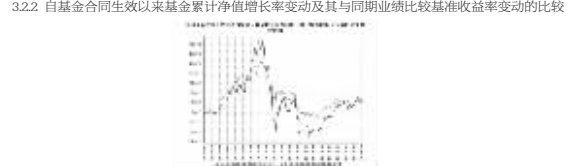
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	30.37%	1.53%	13.68%	1.34%	16.69%	0.49%



注:本基金基金合同生效日2015年2月12日至报告期末尚未满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

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
刘明涛	本基金副基金管理人兼基金经理	2015年2月12日	11年	2004年6月加入嘉实基金,先后任研究部副经理、权益投资部副经理、权益投资部副经理、权益投资部副经理、权益投资部副经理。
杜锐	本基金基金经理	2015年2月28日	7年	2008年1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。

注:(1)基金经理刘明涛的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理杜锐的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实企业变革股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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5%的,合计2次,均为旗下被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易。
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
A股市场在四季度进入股灾后的修复期,组合整体盈利效果显现,市场情绪修复,风险偏好有所上升,整个四季度市场呈现超跌上行特征。在产业类别上,市场因成为了市场最突出的特征,中小市值和创业板股票在反弹中表现抢眼,众多主题持续轮动,二胎、军工、VR、信息安全、传媒ID等主题精彩纷呈。从三季度末开始,本基金保持仓位在较高水平,结合市场热点,在军工、传媒、新材料和计算机等行业进行了重点的加仓,取得了一定的收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.086元;本报告期基金份额净值增长率为30.37%,业绩比较基准收益率为13.68%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
从全球角度来看,由于技术周期仍未启动,主要经济体的增长乏力,货币的贬值风险和流动性释放成为常态,资产收益持续下降。中国股市大周期见底,也使得替代资产的收益逐步收缩,大量的流动性替代投资渠道的缺乏使股票市场依然成为重投资选择渠道。另一方面,中国股市在中期仍将处在转型调整期,传统的投资策略的适用性在下降。虽然A股市场估值依然不能说是便宜,但是当投资者情绪逐步修复,且上述两点原因作用下,股市市场自然会出现结构性机会。考虑到中小市值股票在过去几年的大幅超额收益情况,我们认为以2016年A股的结构性机会机会将会进一步被挖掘,优质的个股的变化的更加清晰,本基金将适度提高股票持仓集中度,加大对投资的基本面扎实程度,在策略上重点配置成长主线;一是通过提高基金资产配置的成长类投资机会;二是行业景气度高,业绩有超预期可能的重点细分行业和个股,力争为投资者取得更好的业绩。
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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(4)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

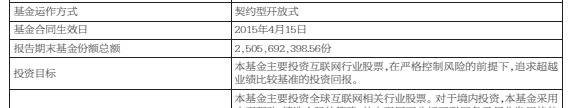
书。

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	嘉实全球互联网股票
基金主代码	000988



注:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末尚未满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(六)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
丁杰人	本基金基金经理	2015年4月15日	9年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员,基金管理部,2015年11月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员,基金经理。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实全球互联网股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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
报告期内,市场整体呈现震荡上行特征,风险偏好有所提升,科技行业表现抢眼,科技行业是领涨板块,海外市场方面,前期受经济数据提振汇率走强,人民币汇率升值对中国类资产也有明显提振。
基于对后市反弹的预期,我们于年初提高了仓位,结构上偏重成长类和估值合理的品种,把握了VR、IP、半导体等主题机会;海外市场方面,大力配置了美股科技类成长股和蓝筹股等,在中概股私有化套利上也获得了明显超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0145元;本报告期基金份额净值增长率为32.28%;截至报告期末本基金份额净值增长率为32.28%,业绩比较基准收益率为24.77%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内四季度,随着美国加息落地,市场风险偏好可能进一步下降,同时伴随着互联网产业面临快速整合和融资收紧,龙头企业能够集中更多资源,我们投资也会以科技、纯美股方面,除了云计算、电商、社、大零售等行业外,我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值企业投资。
报告期内本基金持有人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	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.11%	1.23%	24.77%	1.45%	4.64%	0.08%

注:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末尚未满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(六)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
丁杰人	本基金基金经理	2015年4月15日	9年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员,基金管理部,2015年11月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员,基金经理。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实全球互联网股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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
报告期内,市场整体呈现震荡上行特征,风险偏好有所提升,科技行业表现抢眼,科技行业是领涨板块,海外市场方面,前期受经济数据提振汇率走强,人民币汇率升值对中国类资产也有明显提振。
基于对后市反弹的预期,我们于年初提高了仓位,结构上偏重成长类和估值合理的品种,把握了VR、IP、半导体等主题机会;海外市场方面,大力配置了美股科技类成长股和蓝筹股等,在中概股私有化套利上也获得了明显超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0145元;本报告期基金份额净值增长率为32.28%;截至报告期末本基金份额净值增长率为32.28%,业绩比较基准收益率为24.77%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内四季度,随着美国加息落地,市场风险偏好可能进一步下降,同时伴随着互联网产业面临快速整合和融资收紧,龙头企业能够集中更多资源,我们投资也会以科技、纯美股方面,除了云计算、电商、社、大零售等行业外,我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值企业投资。
报告期内本基金持有人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	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	32.28%	1.50%	24.77%	1.45%	7.31%	0.10%

注:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末尚未满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(六)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
丁杰人	本基金基金经理	2015年4月15日	9年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员,基金管理部,2015年11月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员,基金经理。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实全球互联网股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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
报告期内,市场整体呈现震荡上行特征,风险偏好有所提升,科技行业表现抢眼,科技行业是领涨板块,海外市场方面,前期受经济数据提振汇率走强,人民币汇率升值对中国类资产也有明显提振。
基于对后市反弹的预期,我们于年初提高了仓位,结构上偏重成长类和估值合理的品种,把握了VR、IP、半导体等主题机会;海外市场方面,大力配置了美股科技类成长股和蓝筹股等,在中概股私有化套利上也获得了明显超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0145元;本报告期基金份额净值增长率为32.28%;截至报告期末本基金份额净值增长率为32.28%,业绩比较基准收益率为24.77%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内四季度,随着美国加息落地,市场风险偏好可能进一步下降,同时伴随着互联网产业面临快速整合和融资收紧,龙头企业能够集中更多资源,我们投资也会以科技、纯美股方面,除了云计算、电商、社、大零售等行业外,我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值企业投资。
报告期内本基金持有人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	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	32.28%	1.50%	24.77%	1.45%	7.31%	0.10%

注:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末尚未满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(六)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
丁杰人	本基金基金经理	2015年4月15日	9年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员,基金管理部,2015年11月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员,基金经理。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实全球互联网股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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
报告期内,市场整体呈现震荡上行特征,风险偏好有所提升,科技行业表现抢眼,科技行业是领涨板块,海外市场方面,前期受经济数据提振汇率走强,人民币汇率升值对中国类资产也有明显提振。
基于对后市反弹的预期,我们于年初提高了仓位,结构上偏重成长类和估值合理的品种,把握了VR、IP、半导体等主题机会;海外市场方面,大力配置了美股科技类成长股和蓝筹股等,在中概股私有化套利上也获得了明显超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0145元;本报告期基金份额净值增长率为32.28%;截至报告期末本基金份额净值增长率为32.28%,业绩比较基准收益率为24.77%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内四季度,随着美国加息落地,市场风险偏好可能进一步下降,同时伴随着互联网产业面临快速整合和融资收紧,龙头企业能够集中更多资源,我们投资也会以科技、纯美股方面,除了云计算、电商、社、大零售等行业外,我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值企业投资。
报告期内本基金持有人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	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	32.28%	1.50%	24.77%	1.45%	7.31%	0.10%

注:本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末尚未满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(六)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
丁杰人	本基金基金经理	2015年4月15日	9年	曾任光大证券研究所行业研究员,银河基金管理有限公司研究员,基金管理部,2015年11月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员。
张丹华	本基金基金经理	2015年5月15日	4年	2011年6月加入嘉实基金管理有限公司,任研究员,基金经理。

注:(1)基金经理丁杰人的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张丹华的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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明
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》及其配套法规、《嘉实全球互联网股票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,各投资组合投资管理流程独立决策,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;通过完善交易执行流程、公平交易系统的公平交易执行机制,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
报告期内,市场整体呈现震荡上行特征,风险偏好有所提升,科技行业表现抢眼,科技行业是领涨板块,海外市场方面,前期受经济数据提振汇率走强,人民币汇率升值对中国类资产也有明显提振。
基于对后市反弹的预期,我们于年初提高了仓位,结构上偏重成长类和估值合理的品种,把握了VR、IP、半导体等主题机会;海外市场方面,大力配置了美股科技类成长股和蓝筹股等,在中概股私有化套利上也获得了明显超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0145元;本报告期基金份额净值增长率为32.28%;截至报告期末本基金份额净值增长率为32.28%,业绩比较基准收益率为24.77%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内四季度,随着美国加息落地,市场风险偏好可能进一步下降,同时伴随着互联网产业面临快速整合和融资收紧,龙头企业能够集中更多资源,我们投资也会以科技、纯美股方面,除了云计算、电商、社、大零售等行业外,我们也会适当增加产业层面能够验证的中小市值企业投资。
报告期内本基金持有人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	单位:人民币元
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	680,835,794.31
2.本期利润	680,835,794.31
3.本期基金份额净值增长率	3.244,393.08%
4.本期基金份额净值增长率	1.05%

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;不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益水平要低于所列数字;(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益