

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、监事及本基金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:嘉实企业变革股票

基金主代码:001036

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年2月12日

报告期基金的份额总额:2,088,082,001.09份

投资目标:本基金主要投资于在新兴产业领域内,深入挖掘上市公司发展的潜力,实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金在经济运行“自上而下”和“自下而上”相结合的方法精选个股,深入研究企业经营情况,选择具有持续盈利能力、成长性高、估值合理的股票进行投资。因此,本基金的投资将主要依托于基本面的分析,对股票进行深入的分析,以获得中长期较高的投资回报。

业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*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。

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 -40,426,268.62

2本期利润 680,836,794.31

3加权平均基金份额本期利润 0.2966

4期末基金份额净值 3,244,363,065.61

5期末可供分配基金份额利润 1.0000

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)和股利分配用的余额,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,计入费用后实际收益水平要低于不计费用。

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(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%)

① -0.37% ② 1.80% ③ 1.36% ④ 1.34% ⑤ 16.69% ⑥ 0.49%

过去三个月 30.37% 18.00% 13.06% 13.4% 16.69% 0.49%

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

图:嘉实企业变革股票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图对比如图(2015年12月31日)(2015年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2015年12月12日至报告期末未满一年。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(十四)投资限制)的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

刘英玲 嘉实策略增长混合基金经理 2015年12月12日 - 11年 在任期间,本基金未参与国债期货交易。

杜毅 本基金基金经理 2015年12月28日 - 7年 2006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、研究总监、基金经理助理、研究总监、基金经理。

注:(1)基金经理刘英玲的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理杜毅的任职日期是拟公司决定后公告之日;(2)本基金的从业资格见《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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本基金,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 公平交易制度执行的情况

报告期内,本基金严格执行《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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本基金,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,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,基金管理人严格按照证监会《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、投资建议和实施投资决策方面享有平等的机会;通过完善交易制度和交易系统,严格执行交易控制、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22个,均为旗下组合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 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.1 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.2 报告期内本基金投资组合运作分析

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球角度看,由于技术进步,相关行业的增长潜力,货币的竞争贬值和流动性释放成为常态,资金收益率持续下降,中国市场在大周期见顶,也使可替代资产的收益率逐步走低,大量的流动性和较低的估值使得资金流向新兴行业,从而导致资金配置比例的变化。另一方面,中国经济在大周期内仍处在转型升级阶段,传统投资回报率的降低导致资金流向新兴产业,如新能源、新材料、计算机等行业的投资机会,同时在上述原因作用下,股市市值依然会向结构性机会集中,如军工、TMT、医药、信息安全、传媒等主题精彩纷呈。

从三季度开始,本基金继续保持仓位较高水平,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布局,取得了一定的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动说明

4.6.1 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动情况

4.6.2 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.3 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动说明

4.6.4 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.5 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.6 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.7 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.8 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.9 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.10 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.11 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.12 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.13 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.14 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.15 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.16 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.17 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.18 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.19 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.20 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.21 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.22 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.23 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.24 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.25 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.26 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.27 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.28 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.29 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.30 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.31 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.32 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.33 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.34 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.35 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.36 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.37 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.38 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.39 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.40 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.41 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.42 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.43 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.44 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.45 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.46 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.47 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.48 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.49 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.50 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.51 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.52 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.53 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.54 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.55 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.56 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.57 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.58 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.59 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.60 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.61 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.62 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.63 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.64 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.65 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.66 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.67 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.68 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.69 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.70 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.71 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.72 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.73 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.74 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.75 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因

4.6.76 报告期内基金持有人数或人均基金净值变动原因