嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金

【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:北京银行股份有限公司
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。

基金托管人北京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	嘉实宝A/B	
基金主代码	519808	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月11日	
报告期末基金份额总额	64,287,097,141.00份	
投资目标	在有效控制风险和保持较高流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	根据宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。 根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量等),决定组合中各类资产的投资比例。 根据各类资产的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别。	
业绩比较基准	人民币活期存款税后利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实宝A	嘉实宝B
下属分级基金的交易代码	519808	519809
报告期末下属分级基金的份额总额	47,770,280,404.00份	16,516,816,737.00份

§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)	
	嘉实宝A	嘉实宝B
1. 本期已实现收益	5,187,412.37	3,407,773.07
2. 本期利润	5,187,412.37	3,407,773.07
3. 期末基金资产净值	477,702,804.04	165,168,167.37

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)嘉实宝A与嘉实宝B适用不同的销售服务费率,嘉实宝A计提增值服务费。(3)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(4)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实宝A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6325%	0.0032%	0.0881%	0.0000%	0.5444%	0.0032%

嘉实宝B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7848%	0.0033%	0.0881%	0.0000%	0.6967%	0.0033%

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

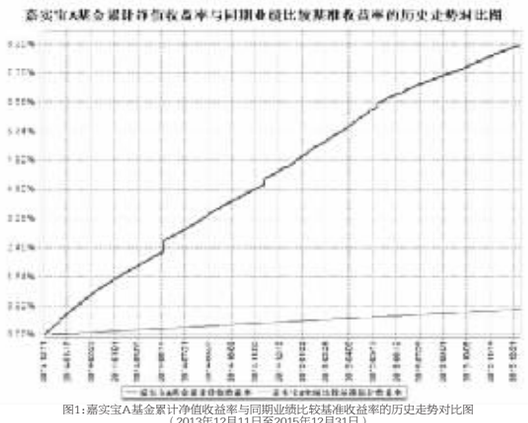

图1:嘉实宝A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月11日至2015年12月31日)

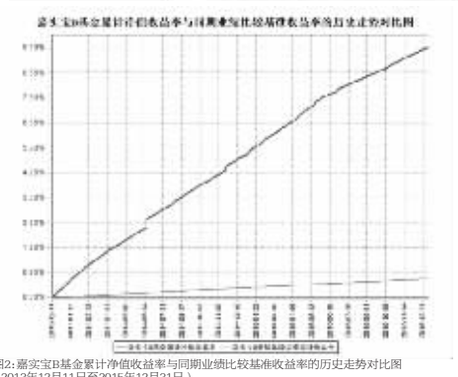

图2:嘉实宝B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月11日至2015年12月31日)

注: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

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
		任职日期	离任日期		
万晓西	本基金,嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实3个月理财债券、嘉实机构快钱货币基金经理,公司现金管理部总监	2013年12月11日	-	15年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部,南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理,2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任现金管理部总监。经济学硕士,中国国籍。
李金灿	本基金,嘉实超短债债券基金经理	2015年6月9日	-	6年	曾任Futex Trading Ltd期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司担任债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员,现任职于现金管理部。硕士研究生,CFA,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理万晓西任职日期是指本基金基金合同生效之日;基金经理李金灿任职日期是指公司作出决定后公告之日,离任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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金合同》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规定和约定,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公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、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,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,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公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.951元;本报告期基金份额净值增长率为24.43%,业绩比较基准收益率为12.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体经济的增长情况仍然乏力,高杠杆的格局没有改善,但股市两融的融资大幅控制。利好方面放松部分城市的限购,房地产的销量开始稳步回升,预期会对后续的房地产投资形成正面影响,同时发改委也推出了大量的基建项目来对冲房地产投资的阶段性压力;在政策上,一路一带、京津冀、自贸区等都给市场形成了较强的预期带动了相关的主题投资,同时债券利率水平大幅下降导致保险资金和理财资金逐步都有入市需求。

展望一季度,我们判断宏观经济政策以稳为主,后续的改革政策将逐步落地,流动性仍维持目前的宽松格局,并且实体经济的盈利水平受制于整体经济的疲弱仍然维持较低的水平,因此新增的流动性并没有向实体经济转移,减持压力和ipo的压力导致2016年市场流动性比2015年要差,操机选择中性仓位,在配置上略均衡化,对于行业配置,我们选择的方向主要包括:汽车、家电、地产,保险和其他估值较低分红较高的一线优质蓝筹股,二是,以互联网为崛起的新兴产业龙头为代表,三是,产能去化可能带来阶段性行业反子行业;此外关注今年新出的主题性投资机会。

4.6 报告期内基金持有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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,238,730,307.74	82.35
	其中:股票	6,238,730,307.74	82.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,045,000.00	0.66
	其中:债券	50,045,000.00	0.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,117,363,778.37	14.75
8	其他资产	169,614,505.24	2.24
	合计	7,575,753,591.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	246,072,585.40	3.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,840,043,390.33	51.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,347,015.84	1.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	274,542,547.46	3.70
G	交通运输、仓储和邮政业	179,796,793.32	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,307,206,810.92	17.63
J	金融业	590.80	0.00
K	房地产业	22,012,914.00	0.30
L	租赁和商务服务业	113,908,243.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	56,224,444.24	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	60,347,181.68	0.81
S	综合	42,227,790.75	0.57
	合计	6,238,730,307.74	84.13

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	002450	康得新	13,649,270	520,037,187.00	7.01
2	002516	旷达科技	23,580,925	339,565,320.00	4.58
3	300104	乐视网	4,191,129	246,438,385.20	3.32
4	002425	凯撒股份	8,272,159	239,809,889.41	3.23
5	002308	威创股份	9,462,414	233,248,505.10	3.15
6	300004	南风股份	8,732,853	232,206,561.27	3.13
7	300073	当升科技	5,772,334	224,139,729.22	3.02
8	002462	嘉事堂	4,273,601	216,329,682.62	2.92
9	300359	全通教育	2,497,343	215,071,179.16	2.90
10	002329	皇氏集团	6,894,284	192,350,523.60	2.59

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,045,000.00	0.67
	其中:政策性金融债	50,045,000.00	0.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	50,045,000.00	0.67

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五名债券投资明细

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	150301	15进出01	500,000	50,045,000.00	0.67

注:报告期末本基金仅持有上述1只债券。

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。

5.7 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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,139,943.38
2	应收证券清算款	161,090,935.91
3	应收股利	-
4	应收利息	1,946,329.60
5	应收申购款	1,437,296.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	169,614,505.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	246,438,385.20	3.32	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,015,766,923.95
报告期期间基金总申购份额	197,419,193.47
减:报告期期间基金总赎回份额	411,601,232.64
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,801,584,884.78

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金募集的文件;

(2)《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金合同》;

(3)《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金招募说明书》;

(4)《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016年1月21日

嘉实策略增长混合型证券投资基金

【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	嘉实策略混合
基金主代码	070011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月12日
报告期末基金份额总额	3,801,584,884.78份
投资目标	通过有效的策略组合,为基金持有人创造较高的中长期资产增值
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面进行综合分析,在具备足够多预期收益率良好的投资标的时,优先考虑股票类资产配置,剩余资产配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资采用自上而下和自下而上相结合的方法,主策略为积极成长策略,辅之以廉价证券策略和周期反转策略等;债券投资采取"自上而下"策略,以久期管理策略为主,辅以收益率曲线策略等。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	较高风险,较高收益。
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	63,747,941.74
2.本期利润	1,520,653,334.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.3896
4.期末基金资产净值	7,415,496,363.30
5.期末基金份额净值	1.951

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	24.43%	2.16%	12.84%	1.26%	11.59%	0.90%

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

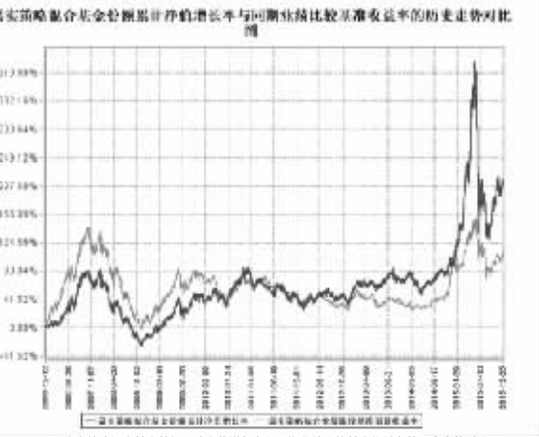

图:嘉实策略混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年12月12日至2015年12月31日)

注:按相关法规规定,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第十一部分(二、投资范围和六、(二)投资组合限制)的有关约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘美玲	本基金基金经理、嘉实企业变革股票、嘉实增长混合基金经理	2013年12月21日	-	11年	2004年6月加入嘉实基金,先后在研究部、投资部工作,并担任过研究部能源组组长、投资经理职务。具有基金从业资格。
丁杰人	本基金基金经理、嘉实全球互联网股票基金经理	2014年3月28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、基金经理,2013年11月加入嘉实基金管理有限公司,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期、离任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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实策略增长混合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规定和约定,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公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、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

本报告期内,整个市场波动巨大,同时分化明显加剧,其中沪深300指数、中证500指数、创业板综合指数分别取得16.5%、24.4%、39.1%的收益率;分行业看,计算机、基础化工、房地产表现居前,而交运、银行、钢铁行业表现靠后

回顾本组合的操作,在大类资产配置上,将组合的权益比例中等水平,在行业配置上,考虑到2015年成长性行业涨幅巨大,行业配置略有均衡化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.951元;本报告期基金份额净值增长率为24.43%,业绩比较基准收益率为12.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体经济的增长情况仍然乏力,高杠杆的格局没有改善,但股市两融的融资大幅控制。利好方面放松部分城市的限购,房地产的销量开始稳步回升,预期会对后续的房地产投资形成正面影响,同时发改委也推出了大量的基建项目来对冲房地产投资的阶段性压力;在政策上,一路一带、京津冀、自贸区等都给市场形成了较强的预期带动了相关的主题投资,同时债券利率水平大幅下降导致保险资金和理财资金逐步都有入市需求。

展望一季度,我们判断宏观经济政策以稳为主,后续的改革政策将逐步落地,流动性仍维持目前的宽松格局,并且实体经济的盈利水平受制于整体经济的疲弱仍然维持较低的水平,因此新增的流动性并没有向实体经济转移,减持压力和ipo的压力导致2016年市场流动性比2015年要差,操机选择中性仓位,在配置上略均衡化,对于行业配置,我们选择的方向主要包括:汽车、家电、地产,保险和其他估值较低分红较高的一线优质蓝筹股,二是,以互联网为崛起的新兴产业龙头为代表,三是,产能去化可能带来阶段性行业反子行业;此外关注今年新出的主题性投资机会。

4.6 报告期内基金持有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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,238,730,307.74	82.35
	其中:股票	6,238,730,307.74	82.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,045,000.00	0.66
	其中:债券	50,045,000.00	0.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,117,363,778.37	14.75
8	其他资产	169,614,505.24	2.24
	合计	7,575,753,591.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	246,072,585.40	3.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,840,043,390.33	51.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,347,015.84	1.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	274,542,547.46	3.70
G	交通运输、仓储和邮政业	179,796,793.32	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,307,206,810.92	17.63
J	金融业	590.80	0.00
K	房地产业	22,012,914.00	0.30
L	租赁和商务服务业	113,908,243.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	56,224,444.24	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	60,347,181.68	0.81
S	综合	42,227,790.75	0.57
	合计	6,238,730,307.74	84.13

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	002450	康得新	13,649,270	520,037,187.00	7.01
2	002516	旷达科技	23,580,925	339,565,320.00	4.58
3	300104	乐视网	4,191,129	246,438,385.20	3.32
4	002425	凯撒股份	8,272,159	239,809,889.41	3.23
5	002308	威创股份	9,462,414	233,248,505.10	3.15
6	300004	南风股份	8,732,853	232,206,561.27	3.13
7	300073	当升科技	5,772,334	224,139,729.22	3.02
8	002462	嘉事堂	4,273,601	216,329,682.62	2.92
9	300359	全通教育	2,497,343	215,071,179.16	2.90
10	002329	皇氏集团	6,894,284	192,350,523.60	2.59

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,045,000.00	0.67
	其中:政策性金融债	50,045,000.00	0.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	50,045,000.00	0.67

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五名债券投资明细

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	150301	15进出01	500,000	50,045,000.00	0.67

注:报告期末本基金仅持有上述1只债券。

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。

5.7 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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,139,943.38
2	应收证券清算款	161,090,935.91
3	应收股利	-
4	应收利息	1,946,329.60
5	应收申购款	1,437,296.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	169,614,505.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	246,438,385.20	3.32	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,015,766,923.95
报告期期间基金总申购份额	197,419,193.47
减:报告期期间基金总赎回份额	411,601,232.64
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,801,584,884.78

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实策略增长混合型证券投资基金募集的批复);

(2)《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实策略增长混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实策略增长混合型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实策略增长混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016年1月21日

嘉实超短债证券投资基金

【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	嘉实超短债债券
基金主代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月26日
报告期末基金份额总额	703,570,070.09份
投资目标	通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本金稳妥,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金投资策略是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略。一方面,将基金的大部分资产投资于货币市场工具,保持基金资产的高流动性,同时提供稳定的收益;另一方面,通过价值挖掘,将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具,为基金资产提供超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期储蓄存款的税后利率
风险收益特征	本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金,低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。
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

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	11,404,819.99
2.本期利润	-9,430,251.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0072
4.期末基金资产净值	725,157,076.10
5.期末基金份额净值	1.0307

注:(1)本期已