

嘉实策略增长混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

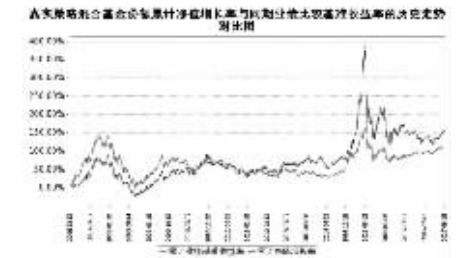


图1:嘉实策略增长混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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一部分(二)投资范围和六、(二)投资组合限制的有关规定。

§ 4 管理人报告				
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
谢泽林	本基金、嘉实策略增长混合发起式基金经理	2016年9月30日	8年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员一职,现任权益投资部高级研究员,具有基金从业资格。

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 管理人对外报告期内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,各投资组合按照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1次,为旗下组合被动跟踪

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

国内3季度经济增长相对平稳,固定资产投资温和略有回落,消费增速总体平稳,工业增加值增速平稳。国内CPI仍在2%以下温和运行,但PPI略有上升,3季度大宗商品先大幅上涨后有所回落,经济结构分化仍在继续,包括消费的全面升级,制造业的高端升级,经济结构性变化,给国内的优秀企业带来越来越多的发展机会。A股在3季度呈现震荡向上行情,沪深300指数上涨4.63%,中证500指数上涨7.58%。从板块表现来看,3季度有色金属、钢铁板块涨幅居前,主要受益于大宗商品的上涨,而传媒、公用事业板块跌幅居前。

报告期内本基金的配置重点在估值合理的成长股,包括网络安全、大数据、储能、安防、乳制品、新材料等领域的行业龙头,以及部分低估值高分红的价值股,部分受益于供给侧改革的周期股等。3季度的净值增长相对于上半年的落后业绩带来较为明显的改善。本基金将继续以业绩持续增长、估值合理偏低的前成长企业为配置主线,以期在短期和中长期能持续给持有人带来良好投资回报。

4.5 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1.302元,本报告期基金份额净值增长率为7.34%,业绩比较基准收益率为3.52%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,046,271,031.71	92.61
2	其中:股票	4,046,271,031.71	92.61
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	302,190,188.45	6.92
8	其他资产	20,485,996.90	0.47
9	合计	4,368,947,217.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,430,571,061.39	53.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	97,027,050.00	2.14
F	批发和零售业	26,365.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	303,268,070.91	6.89
J	金融业	60,326,659.70	1.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,911,940.80	0.11
M	科学研究和技术服务业	135,352,628.96	2.98
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,560,518.99	2.44
R	文化、体育和娱乐业	102,554,378.10	2.26
S	综合	-	-
合计		3,244,676,963.25	71.54

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	002439	启明星辰	14,347,509	317,653,845.26	7.30
2	600729	佛山照明	22,147,783	224,901,854.91	5.26
3	300365	海康威视	12,126,587	222,024,075.41	5.10
4	603955	华耀科技	6,695,019	214,242,734.43	4.94
5	600987	伊泰煤炭	9,595,300	181,370,750.00	4.17
6	300054	康美药业	11,572,934	176,052,778.00	4.04
7	300169	东方国信	11,571,923	174,041,872.32	4.00
8	000951	格力电器	4,462,714	169,136,860.60	3.88
9	002343	汉缆股份	3,537,569	136,939,295.99	3.14
10	300342	天银机电	6,818,606	135,104,107.92	3.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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

无。

§ 6 开放式基金申购赎回情况

6.1 申购赎回情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,244,676,963.25	70.52
2	其中:股票	3,244,676,963.25	70.52
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	351,798,166.40	7.65
8	其他资产	36,024,437.35	0.78
9	合计	4,601,243,977.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	676,720,931.72	69.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	12,193,006.00	0.97
F	批发和零售业	26,365.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,263,628.03	8.54
J	金融业	23,337,571.00	1.86
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,404,000.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	2,594,737.62	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	50,755,160.00	4.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,530,299.99	2.83
R	文化、体育和娱乐业	38,947,947.00	3.03
S	综合	-	-
合计		1,145,365,088.14	91.23

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	002614	奥普光电	6,900,000	121,026,000.00	9.64
2	601799	广生股份	2,308,595	115,037,288.85	9.16
3	002439	启明星辰	4,844,000	107,246,160.00	8.54
4	000658	五粮液	1,700,000	97,376,000.00	7.76
5	600176	中国船舶	6,829,100	78,261,486.00	6.23
6	603579	华明装备	1,252,896	73,916,504.00	5.89
7	002236	中国中车	2,984,737	62,445,319.59	4.97
8	603688	高银金融	3,313,000	50,755,160.00	4.04
9	600741	华谊集团	2,154,400	48,596,230.00	3.87
10	600887	伊泰煤炭	1,661,000	48,587,750.00	3.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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

无。

§ 7 基金管理人报告

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

(1)中国证监会准予嘉实成长增强灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实成长增强灵活配置混合型证券投资基金合同》;

(3)《嘉实成长增强灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实成长增强灵活配置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)报告期内嘉实成长增强灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门内大街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:查询时间为每工作日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

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	13,951,800.00	0.30
B	采矿业	53,002,070.00	1.22
C	制造业	2,595,055,364.84	99.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,494,600.00	0.10
E	建筑业	3,661.26	0.00
F	批发和零售业	68,680,526.04	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	47,329,709.19	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	699,413,703.78	16.06
J	金融业	160,320,678.11	3.68
K	房地产业	204,448,367.16	4.70
L	租赁和商务服务业	1,091,859.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,941.24	0.00
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	199,919,736.99	4.58
S	综合	-	-
合计		4,046,271,031.71	92.93

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	002439	启明星辰	14,347,509	317,653,845.26	7.30
2	600729	佛山照明	22,147,783	224,901,854.91	5.26
3	300365	海康威视	12,126,587	222,024,075.41	5.10
4	603955	华耀科技	6,695,019	214,242,734.43	4.94
5	600987	伊泰煤炭	9,595,300	181,370,750.00	4.17
6	300054	康美药业	11,572,934	176,052,778.00	4.04
7	300169	东方国信	11,571,923	174,041,872.32	4.00
8	000951	格力电器	4,462,714	169,136,860.60	3.88
9	002343	汉缆股份	3,537,569	136,939,295.99	3.14
10	300342	天银机电	6,818,606	135,104,107.92	3.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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

无。

§ 8 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

北京市建国门内大街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:查询时间为每工作日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

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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,430,571,061.39	53.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	97,027,050.00	2.14
F	批发和零售业	26,365.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	303,268,070.91	6.89
J	金融业	60,326,659.70	1.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,911,940.80	0.11
M	科学研究和技术服务业	135,352,628.96	2.98
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,560,518.99	2.44
R	文化、体育和娱乐业	102,554,378.10	2.26
S	综合	-	-
合计		3,244,676,963.25	71.54

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	002614	奥普光电	21,383,990	375,075,194.60	8.27