

嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

2014 第三季度报告

2014年9月30日

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:2014年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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。

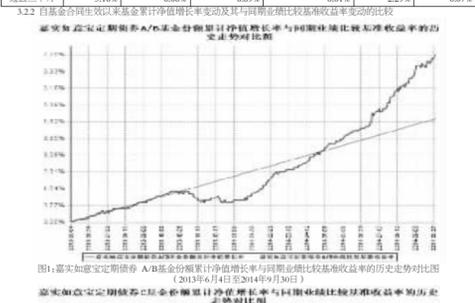
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告期内(2014年7月1日起至2014年9月30日止)。

1.2 基金产品概况	
基金名称	嘉实如意宝定期债券
基金代码	000113
基金运作方式	定期开放方式
基金合同生效日	2013年5月28日
报告期末基金份额总额	151,758,953.83份
投资目标	本基金追求本金稳定和稳定收益,在此基础上力争获取超额收益。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,通过资产配置和个券选择,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
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
下属两级基金的基金简称	嘉实如意宝定期债券A/B
下属两级基金的交易代码	000113 000115
报告期末下属两级基金的份额总额	104,578,353.83份 47,180,600.02份

1.3 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
1.本期已实现收益	6,538,569.51	2,805,879.72	
2.本期利润	5,367,251.12	2,282,216.46	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267	0.0257	
4.期末基金份额净值	112,630,104.43	50,573,410.93	
5.期末基金资产净值	1,077	1,077	



1.4 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实纯债基金经理	2013年6月14日	10年	经济学博士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2005年开始从事投资管理相关工作,先后担任债券研究员、基金经理助理、基金经理、基金经理助理、基金经理等职务。

1.5 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		



1.6 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张琦	本基金、嘉实策略配置定期基金、嘉实研究阿尔法股票基金基金经理	2013年5月28日	9年	硕士研究生,2005年7月加入嘉实基金,历任行业研究员、金融地产研究员、基金经理助理,2011年3月至2013年5月担任嘉实策略配置定期基金基金经理,中国国籍。

1.7 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实如意宝定期债券A/B	嘉实如意宝定期债券C
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		



嘉实美国成长股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

2014年9月30日

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:2014年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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。

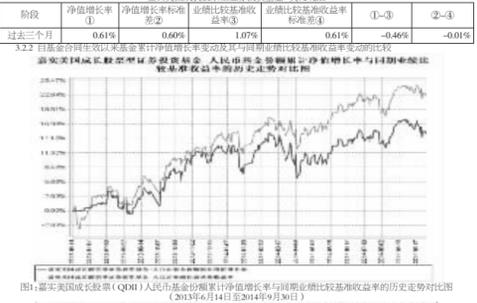
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告期内(2014年7月1日起至2014年9月30日止)。

1.2 基金产品概况	
基金名称	嘉实美国成长股票(QDII)
基金代码	000043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	46,346,592.08份
投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票,在股票选择及组合构建方面均运用量化(投资方法)并结合风险管理手段,力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金采用非传统的量化投资策略,本基金依托内部自主研发的量化模型,通过多因子Alpha模型、风险调整模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化技术,最大限度提高投资组合的长期复合收益率,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%*罗素1000成长指数收益率+5%*银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长型股票,属于主动投资的股票型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券基金和混合型基金,高于国内股票基金中的低风险预期风险,较高预期收益的投资品种。
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
境外资产托管人	嘉实基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人,本基金的境外资产由基金管理人中国银行股份有限公司托管。
下属两级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币
下属两级基金的交易代码	000043 000044
报告期末下属两级基金的份额总额	41,480,256.65份 4,866,335.43份

1.3 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元
1.本期已实现收益	1,240,097.24	810,438.58	
2.本期利润	397,284.26	201,027.49	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0041	
4.期末基金份额净值	47,684,500.21	34,332,043.61	
5.期末基金资产净值	1,150	1,147	



1.4 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张力	本基金基金经理、定量投资策略负责人	2013年6月14日	18年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校中国科学技术大学,具有18年证券投资经验,曾任银河投资管理公司(American Century Investments)高级量化策略师,研究国际股票基金、量化策略、资产配置、对冲基金、对冲基金的多项大奖基金和量化对冲基金。2012年加入嘉实基金管理有限公司,任定量投资策略负责人,负责基金投资组合、投资策略及量化模型、定量投资策略负责人。

1.5 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元
1.本期已实现收益	1,240,097.24	810,438.58	
2.本期利润	397,284.26	201,027.49	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0041	
4.期末基金份额净值	47,684,500.21	34,332,043.61	
5.期末基金资产净值	1,150	1,147	

1.6 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张力	本基金基金经理、定量投资策略负责人	2013年6月14日	18年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校中国科学技术大学,具有18年证券投资经验,曾任银河投资管理公司(American Century Investments)高级量化策略师,研究国际股票基金、量化策略、资产配置、对冲基金、对冲基金的多项大奖基金和量化对冲基金。2012年加入嘉实基金管理有限公司,任定量投资策略负责人,负责基金投资组合、投资策略及量化模型、定量投资策略负责人。

1.7 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元
1.本期已实现收益	1,240,097.24	810,438.58	
2.本期利润	397,284.26	201,027.49	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0041	
4.期末基金份额净值	47,684,500.21	34,332,043.61	
5.期末基金资产净值	1,150	1,147	



1.8 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张琦	本基金、嘉实策略配置定期基金、嘉实研究阿尔法股票基金基金经理	2013年5月28日	9年	硕士研究生,2005年7月加入嘉实基金,历任行业研究员、金融地产研究员、基金经理助理,2011年3月至2013年5月担任嘉实策略配置定期基金基金经理,中国国籍。

嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

2014年9月30日

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:2014年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告期内(2014年7月1日起至2014年9月30日止)。

1.2 基金产品概况	
基金名称	嘉实研究阿尔法股票
基金代码	000082
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
报告期末基金份额总额	140,163,809.80份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在保持较稳定的投资组合和风险控制的前提下,以追求基金资产的长期增值为目的,通过资产配置和个券选择,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	MSCI中国股指期货收益率+95%*银行活期存款利率 税后+5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金及货币型基金。
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

1.3 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实研究阿尔法股票	嘉实研究阿尔法股票
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		

基金管理人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告期内(2014年7月1日起至2014年9月30日止)。

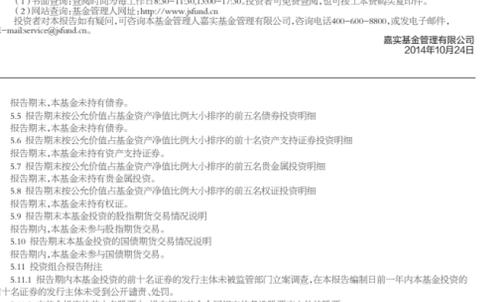
1.4 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张琦	本基金、嘉实策略配置定期基金、嘉实研究阿尔法股票基金基金经理	2013年5月28日	9年	硕士研究生,2005年7月加入嘉实基金,历任行业研究员、金融地产研究员、基金经理助理,2011年3月至2013年5月担任嘉实策略配置定期基金基金经理,中国国籍。

1.5 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实研究阿尔法股票	嘉实研究阿尔法股票
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		



1.6 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张琦	本基金、嘉实策略配置定期基金、嘉实研究阿尔法股票基金基金经理	2013年5月28日	9年	硕士研究生,2005年7月加入嘉实基金,历任行业研究员、金融地产研究员、基金经理助理,2011年3月至2013年5月担任嘉实策略配置定期基金基金经理,中国国籍。

1.7 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实研究阿尔法股票	嘉实研究阿尔法股票
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		



1.8 基金管理人				
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
张琦	本基金、嘉实策略配置定期基金、嘉实研究阿尔法股票基金基金经理	2013年5月28日	9年	硕士研究生,2005年7月加入嘉实基金,历任行业研究员、金融地产研究员、基金经理助理,2011年3月至2013年5月担任嘉实策略配置定期基金基金经理,中国国籍。

1.9 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	嘉实研究阿尔法股票	嘉实研究阿尔法股票
1.本期已实现收益	4,999,404.42		
2.本期利润	21,589,863.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302		
4.期末基金份额净值	158,183,325.61		
5.期末基金资产净值	1,129		

