# 嘉实机构快线货币市场基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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 | 嘉实机构快线货币 |
| 场内简称 | 嘉实快线(嘉实机构快线H类份额场内简称) |
| 基金主代码 | 000917 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 25,221,908,727.68份 |
| 投资目标 | 在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金将根据分析市场资金面变化及投资者交易行为变化,结合宏观和微观研究制定投资策略,谋求在满足安全性、流动性需要的基础上,实现较高的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率 |
| 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉实机构快线货币A | 嘉实机构快线货币B | 嘉实机构快线货币C | 嘉实机构快线货币H |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - | - | 嘉实快线 |
| 下属分级基金的交易代码 | 000917 | 000918 | 000919 | 511960 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 21,442,937,918.86份 | 178,648,895.55份 | 3,590,321,229.88份 | 10,000,683.39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) | | | 报告期(2015年12月31日) |
|---|---|---|---|---|
| | 嘉实机构快线货币A | 嘉实机构快线货币B | 嘉实机构快线货币C | 嘉实快线 |
| 1.本期已实现收益 | 12,405,022.73 | 6,361,014.70 | 24,190,020.00 | 68,338.58 |
| 2. 本期利润 | 12,405,022.73 | 6,361,014.70 | 24,190,020.00 | 68,338.58 |
| 3. 期末基金资产净值 | 21,442,937,918.86 | 178,648,895.55 | 3,590,321,229.88 | 1,000,068,338.58 |

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)嘉实快线基金本报告期为2015年12月31日;(3)嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C和嘉实快线适用不同的管理费率和销售费率。(4)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(5)自2015年12月31日起,本基金收益分配从按月结转份额调整为"每日分配、按日支付"。

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

嘉实机构快线货币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 | 0.6345% | 0.0012% | 0.0881% | 0.0000% | 0.5464% | 0.0012% |

嘉实机构快线货币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 | 0.6439% | 0.0012% | 0.0881% | 0.0000% | 0.5558% | 0.0012% |

嘉实机构快线货币C

| 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 | 0.6527% | 0.0012% | 0.0881% | 0.0000% | 0.5646% | 0.0012% |

嘉实快线

| 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 | 0.0068% | 0.0000% | 0.0016% | 0.0000% | 0.0058% | 0.0000% |

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

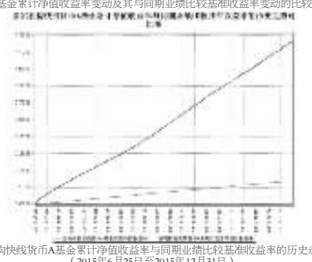

图1:嘉实机构快线货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月25日至2015年12月31日)

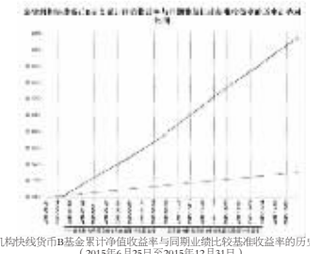

图2:嘉实机构快线货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月25日至2015年12月31日)

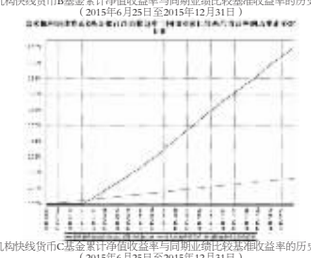

图3:嘉实机构快线货币C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月25日至2015年12月31日)

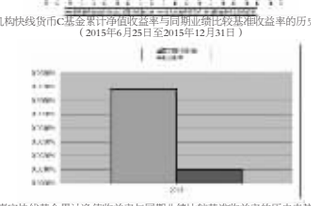

图4:嘉实快线基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2015年6月25日至报告期末未满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

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、嘉实宝A/B、嘉实活钱包货币、嘉实3个月理财债券、嘉实活期宝货币基金经理、公司现金管理部总监 | 2015年6月25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。 |
| 张文玥 | 本基金、嘉实安心货币、嘉实理财宝7天债券、嘉实14个月理财债券、嘉实3个月理财债券基金经理 | 2015年7月14日 | - | 7年 | 曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理,2014年4月加入嘉实基金管理有限公司现金管理部,硕士,具有基金从业资格。 |

注:(1)基金经理万晓西的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张文玥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、《嘉实机构快线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,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

本基金作为大型基金,坚持在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置、选择安全边际较高和流动性较好的个股,力争实现基金资产的长期稳健增值。报告期内,市场呈现3季度大跌之后的上涨行情,本基金保持中等仓位,在原有配置蓝筹股的基础上,适当增加成长性个股的配置比例,不断优化大类资产配置、增加组合的整体进攻性,取得良好效果。

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1.063元;本报告期基金份额净值增长率为15.04%,业绩比较基准收益率为9.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年中国经济增长整体预计较为平稳,并呈现结构性分化,传统产业面临需求疲软甚至部分行业面临负增长,而新兴产业保持较强的生命力和快速增长,新消费、新材料、新技术将会不断涌现,成为拉动经济的新增长点,云服务、虚拟现实、医疗科技、智能汽车等领域发展空间广阔。A股市场的估值两极分化也达到较为严重的状态,新兴产业经过三年的持续上涨,积累了不小的泡沫,需求一定程度的估值去泡沫才具备投资吸引力。传统产业虽然PE估值较低,但也面临业绩增长的不确定性。2016年是需要严格选股的一年。本基金将坚持严格控制风险的前提,不断优化大类资产配置、优化个股配置结构,力争实现基金资产的长期稳健增值。

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 | 固定收益投资 | 3,923,537,674.85 | 14.41 |
| | 其中:债券 | 3,923,537,674.85 | 14.41 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,766,944,599.91 | 13.84 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 19,127,172,935.88 | 70.27 |
| 4 | 其他资产 | 401,546,788.96 | 1.48 |
| | 合计 | 27,219,201,999.60 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 6.97 |
| | 其中:买断式回购融资 | - |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 29 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 76 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 29 |

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 90天以内 | 79.64 | 3.82 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 2.98 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.38 | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 5.53 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 12.26 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 1.91 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 102.31 | 3.82 |

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 | 摊余成本(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 | 1,031,825,784.25 | 3.94 |
| | 其中:政策性金融债 | 1,031,825,784.25 | 3.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 2,333,789,472.22 | 8.90 |
| 6 | 中期票据 | 60,353,664.39 | 0.23 |
| 7 | 同业存单 | 497,568,753.99 | 1.90 |
| 8 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 3,923,537,674.85 | 14.97 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 99,926,146.92 | 0.38 |

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150202 | 15国开02 | 2,300,000 | 230,217,939.63 | 0.88 |
| 2 | 011537008 | 15中建材SCP008 | 2,200,000 | 220,202,278.81 | 0.84 |
| 3 | 150416 | 15农发16 | 2,000,000 | 200,427,559.62 | 0.76 |
| 4 | 150211 | 15国开11 | 2,000,000 | 200,373,357.86 | 0.76 |
| 5 | 011599500 | 15中油控SCP004 | 1,700,000 | 169,992,012.09 | 0.65 |
| 6 | 150206 | 15国开06 | 1,600,000 | 160,639,441.95 | 0.61 |
| 7 | 011599215 | 15新兴能源SCP001 | 1,300,000 | 130,754,790.68 | 0.50 |
| 8 | 011586008 | 15光华控SCP008 | 1,200,000 | 120,136,382.77 | 0.46 |
| 9 | 041548026 | 15国电集CP002 | 1,100,000 | 110,603,368.07 | 0.42 |
| 10 | 011519006 | 15国电SCP006 | 1,100,000 | 110,115,063.29 | 0.42 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0784% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0074% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0328% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 64,410,685.57 |
| 4 | 应收申购款 | 337,056,103.39 |
| 5 | 其他应收款 | 80,000.00 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| | 合计 | 401,546,788.96 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 嘉实机构快线货币A | 嘉实机构快线货币B | 嘉实机构快线货币C | 嘉实快线 |
|---|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 309,270,017.18 | 470,149,099.01 | 3,155,544,356.61 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 31,412,254,735.31 | 6,427,041,771.56 | 5,391,550,607.36 | 10,000,683.39 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 10,278,586,833.63 | 6,718,541,975.02 | 4,956,773,734.09 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 21,442,937,918.86 | 178,648,895.55 | 3,590,321,229.88 | 10,000,683.39 |

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投份额及转换入份额,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交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 红利再投资 | 2015年12月15日 | 1,467.90 | - | - |
| 2 | 红利再投资 | 2015年11月16日 | 1,634.04 | - | - |
| 3 | 红利再投资 | 2015年10月15日 | 84,394.56 | - | - |
| 合计 | | | 87,496.50 | - | |

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准嘉实机构快线货币市场基金募集的文件;

(2)《嘉实机构快线货币市场基金基金合同》;

(3)《嘉实机构快线货币市场基金招募说明书》;

(4)《嘉实机构快线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)报告期内嘉实机构快线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

# 嘉实事件驱动股票型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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 | 嘉实事件驱动股票 |
| 基金主代码 | 001416 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 13,443,424,462.07份 |
| 投资目标 | 立足于中国特定的投资环境,将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内,在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会,通过筛选、监测事件信息扩散对资产价格的影响模式,选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资,力争实现投资者的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 事件性投资是主题性投资在标的股票上的具体表现形式,而相对于主题性投资相对宽泛的投资概念而言,事件性投资更加具体,与标的股票的联系更加紧密,在事件分析的投资决策框架内,事件性投资可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益,以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性,从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性,确保了超额收益的断流式稳定增长。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*80%+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,属于较高预期风险和预期收益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—2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 6,899,640.00 |
| 2.本期利润 | 1,995,462,737.42 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1416 |
| 4.期末基金资产净值 | 12,129,259,589.23 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.902 |

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 | 18.22% | 1.40% | 13.68% | 1.34% | 4.54% | 0.06% |

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

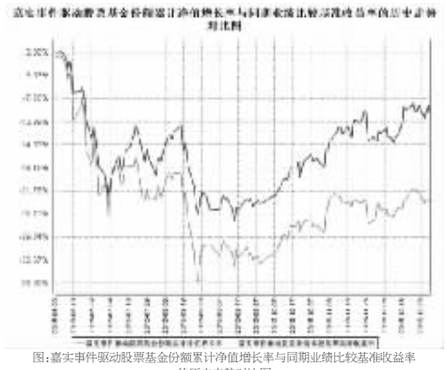

图:嘉实事件驱动股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月9日至2015年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2015年6月9日至报告期末未满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

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 | | |
| 张自力 | 本基金、嘉实美国成长股票(QDII)基金经理、定量投资部负责人 | 2015年6月9日 | - | 19年 | 理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学,具有18年公募基金从业经验,曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理、研究部总监暨基金经理,负责投资管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司,投资决策委员会成员,定量投资部负责人。 |

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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、《嘉实事件驱动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

在本报告期内,嘉实事件驱动基金完成了基金的建仓工作。本基金在报告期初的仓位为39%,建仓期截止至12月上旬,经过审慎稳健的组合构造与时机选择,在此12月初顺利完成了基金建仓,达到了法律与合同规定的仓位水平。由于本基金为股票型基金,在未来的投资运作中,将严格依照相关法规对股票型基金的要求,保持足够的仓位运作。

本季度,市场热情高涨。国庆期间全球主要市场反弹强劲,市场风险偏好回升。国内楼市、车市成交积极,旅游等产业数据也保持强势。十月底的双降更加坚定了场外资金入市的信心。虽然对经济放缓以及企业盈利下滑的担忧仍在,但各大指数均大幅反弹。上证综指上涨15.93%,创业板综指上涨39.11%。

本基金依照投资策略,广泛布局了多类事件,包括:并购重组、业绩超预期、股权激励、高管增持、定向增发、国企改革等。通过丰富的事件类型,更加全面的捕捉市场的潜在投资机会,通过不同事件彼此之间的互补,实现了超额收益来源的多样性,也保证了组合的稳健。行业上,主要配置电子、机械、电气设备。四季度本组合股票部分大幅跑赢基金基准。本基金在报告期整体平均仓位为60%的情况下,取得了18.22%的收益。

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0.902元;本报告期基金份额净值增长率为18.22%,业绩比较基准收益率为13.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,我们认为市场仍然会维持震荡行情,个股分化明显。一方面,九月中旬以来中小题材股的反弹幅度已经相当可观,而整体经济和企业盈利的下滑趋势却无改善迹象。目前创业板估值已经超过60倍,估值提升空间不大。但一季度大部分时间宏观数据和上市公司业绩均处于空窗期,利空因素也并不多。资产荒导致场外仍有一定的增量资金希望布局在股票市场。因此,本基金在操作策略上倾向谨慎化仓位,精选个股。

我们认为一季度的市场将更加重视上市企业的实际盈利,因此将继续根据事件驱动策略,持续关注确定性强的业绩超市场预期,同时有大股东增持、员工持股、定向增发以及并购重组等事件催化的个股。如果股指期货延续目前大幅贴水的状态,我们将继续执行持有股指期货多头的策略代替部分现货。我们将继续专注于事件驱动的投资框架,尽力优化投资组合的风险收益比,力争取得好的投资效果,回报投资者。

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 | 10,526,101,186.52 | 86.47 |
| | 其中:股票 | 10,526,101,186.52 | 86.47 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 1,457,372,546.48 | 11.97 |
| 8 | 其他资产 | 189,949,163.97 | 1.56 |
| | 合计 | 12,173,422,896.97 | 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 | 6,899,640.00 | 0.06 |
| B | 采矿业 | 80,435,564.80 | 0.66 |
| C | 制造业 | 6,753,249,944.66 | 55.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 396,303,367.30 | 3.27 |
| E | 建筑业 | 518,900,295.56 | 4.28 |
| F | 批发和零售业 | 288,520,025.14 | 2.38 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 254,095,591.96 | 2.09 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,474,872,269.65 | 12.16 |
| J | 金融业 | 246,942,121.00 | 2.04 |
| K | 房地产业 | 187,057,544.65 | 1.54 |
| L | 租赁和商务服务业 | 94,050,177.00 | 0.78 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 104,585,420.09 | 0.86 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 7,231,544.46 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 112,957,680.25 | 0.93 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 10,526,101,186.52 | 86.78 |

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 | 300296 | 利亚德 | 7,181,411 | 179,535,275.00 | 1.48 |
| 2 | 300332 | 天壕环境 | 7,052,514 | 172,081,341.60 | 1.42 |
| 3 | 300136 | 信维通信 | 5,159,181 | 152,453,798.55 | 1.26 |
| 4 | 300098 | 高新兴 | 6,221,072 | 130,580,301.28 | 1.08 |
| 5 | 300319 | 麦捷科技 | 3,323,417 | 119,643,012.00 | 0.99 |
| 6 | 000661 | 长春高新 | 966,964 | 116,470,813.80 | 0.96 |
| 7 | 300017 | 网宿科技 | 1,933,768 | 116,006,742.32 | 0.96 |
| 8 | 002675 | 东诚药业 | 2,061,173 | 115,446,299.73 | 0.95 |
| 9 | 002281 | 光迅科技 | 1,773,442 | 114,972,244.86 | 0.95 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,926,500 | 100,235,795.00 | 0.83 |

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

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 | 187,197,724.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,359,118.68 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 503,490.60 |
| 5 | 应收申购款 | 888,829.82 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 189,949,163.97 |

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

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 14,716,234,561.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 118,799,259.73 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,391,609,358.67 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 13,443,424,462.07 |

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

报告期期间,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)中国证监会核准嘉实事件驱动股票型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实事件驱动股票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

# 嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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