

# 嘉实价值优势混合型证券投资基金

## 2015 年年度报告摘要

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

送出日期：2016 年 3 月 29 日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

根据基金管理人 2015 年 8 月 3 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，嘉实价值优势股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实价值优势混合型证券投资基金。

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及其更新。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金名称       | 嘉实价值优势混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 嘉实价值优势混合        |
| 基金主代码      | 070019          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2010年6月7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      |
| 报告期末基金份额总额 | 390,491,040.50份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 运用价值投资方法,精选在基本上具备核心竞争力、且市场估值水平具备相对优势的企业投资,并持续优化投资组合中风险与收益的匹配程度,力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。  |
| 投资策略   | 本基金以价值投资理念为核心,根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判,决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策;其次在个股选择上,通过深入研究寻找优质企业,运用估值方法估算其内在投资价值,并根据国内市场的特殊性及其波动性,综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素,发现具备投资价值的个股。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数*95% + 上证国债指数*5%。  |
| 风险收益特征 | 较高风险、较高预期收益   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人             | 基金托管人                |
|---------|------|-------------------|----------------------|
| 名称      |      | 嘉实基金管理有限公司        | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 胡勇钦               | 王永民                  |
|         | 联系电话 | (010) 65215588    | (010) 66594896       |
|         | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-600-8800      | 95566                |
| 传真      |      | (010) 65182266    | (010) 66594942       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                 |
|---------------------|---------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn            |
| 基金年度报告备置地点          | 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 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年         | 2014 年           | 2013 年           |
|---------------|----------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 682,743,561.31 | 176,319,334.44   | 586,004,510.64   |
| 本期利润          | 578,724,156.87 | 165,258,103.51   | 647,550,465.35   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.8568         | 0.0960           | 0.2434           |
| 本期加权平均净值利润率   | 51.59%         | 8.53%            | 22.87%           |
| 本期基金份额净值增长率   | 32.87%         | 11.79%           | 24.35%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末        | 2014 年末          | 2013 年末          |
| 期末可供分配利润      | 278,985,192.50 | 276,348,390.52   | 231,092,487.31   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.7144         | 0.2425           | 0.0996           |
| 期末基金资产净值      | 669,476,233.00 | 1,469,905,314.18 | 2,679,279,613.76 |
| 期末基金份额净值      | 1.714          | 1.290            | 1.154            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末        | 2014 年末          | 2013 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 76.59%         | 32.91%           | 18.90%           |

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）所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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 23.58%   | 1.85%       | 15.76%     | 1.59%         | 7.82%  | 0.26% |
| 过去六个月 | -9.69%   | 2.96%       | -15.51%    | 2.54%         | 5.82%  | 0.42% |
| 过去一年  | 32.87%   | 2.63%       | 5.99%      | 2.36%         | 26.88% | 0.27% |

|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年           | 84.70% | 1.82% | 46.78% | 1.70% | 37.92% | 0.12% |
| 过去五年           | 49.15% | 1.58% | 20.33% | 1.53% | 28.82% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 76.59% | 1.54% | 36.43% | 1.52% | 40.16% | 0.02% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×95%+上证国债指数×5%。

沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的 A 股市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

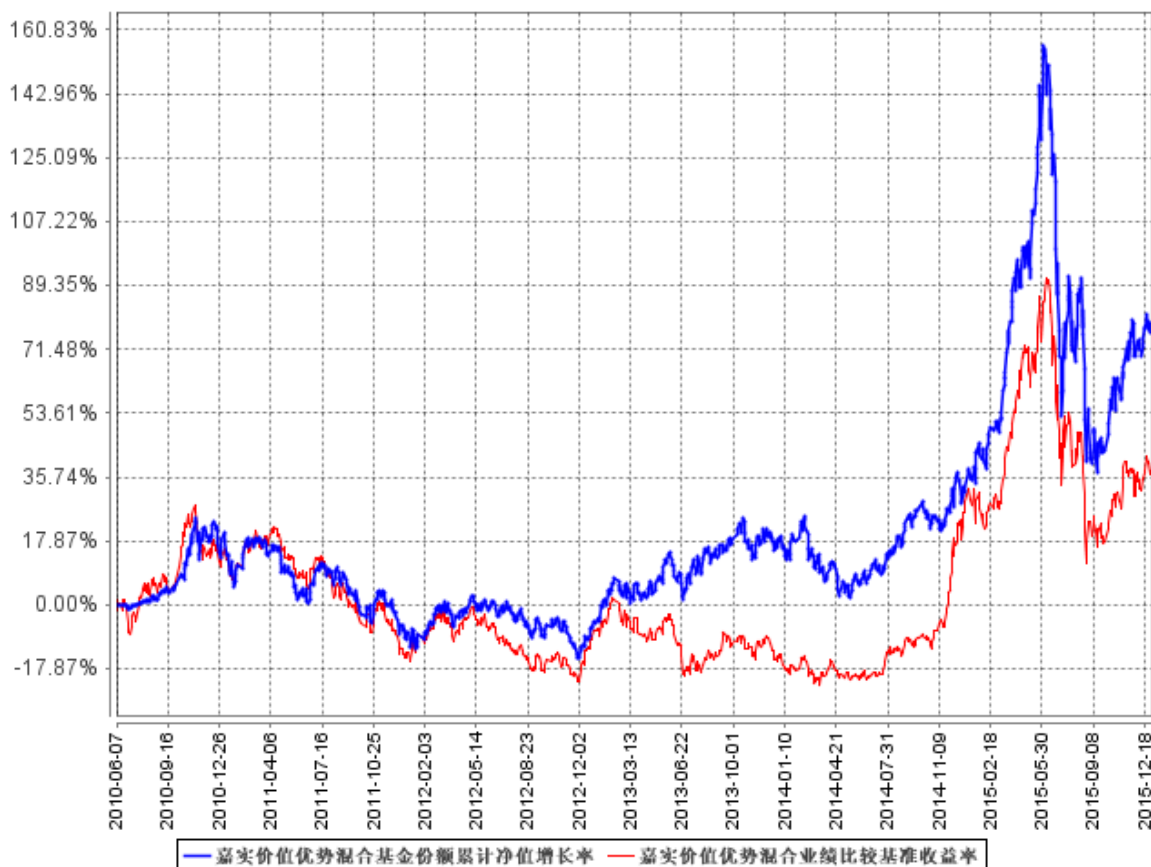
$$\text{Return}(t) = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{上证国债指数}(t) / \text{上证国债指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

#### 嘉实价值优势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



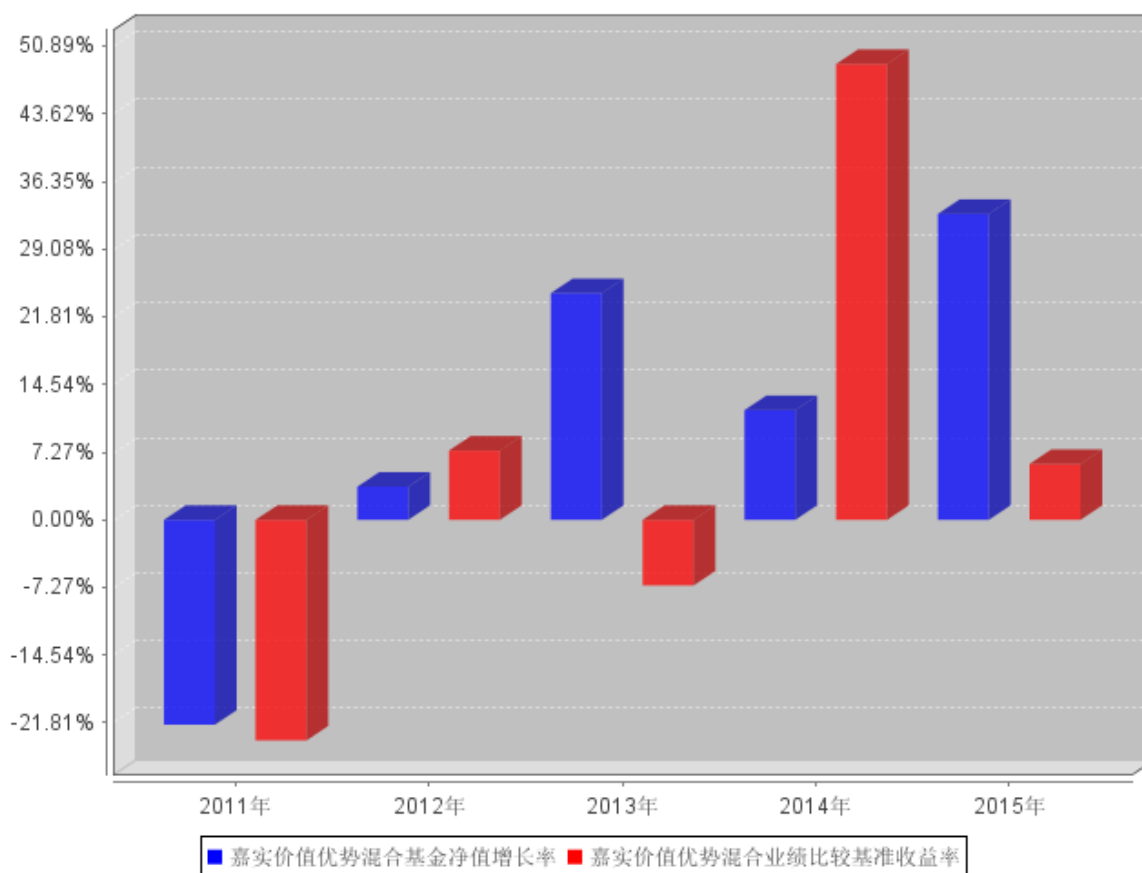
图：嘉实价值优势混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年6月7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（十四（二）投资范围和（七）2、基金投资组合比例限制）的有关约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实价值优势混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资

资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--------------------|------------------|------|--------|--|
|     |                    | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 翟琳琳 | 本基金基金经理、嘉实稳健混合基金经理 | 2014 年 11 月 26 日 | -    | 10 年   | 2005 年 7 月加入嘉实基金，先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。 |

注：（1）任职日期、离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合规守信情况的说明

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、《嘉实价值优势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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，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》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。



### 4.3.3 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 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 15 年，整体市场的风险偏好大幅波动，上半年在改革预期和杠杆资金的驱动下风险偏好显著提升，三季度在市场连续去杠杆风险偏好快速下降，四季度在美国加息的靴子落地、人民币加入 SDR 和降息带动市场利率不断下行等因素的刺激下逐步恢复，同时鼓励大股东和管理层增持，限制股指期货规模等政策等表明了管理层对市场的呵护，市场出现了相当幅度的反弹，尤其是在三季度下跌幅度较大的创业板和中小盘的反弹力度较大，而低估值的地产股、商业和消费股在保险资金不断增持的情况下，也取得了不错的收益。

本报告期内，尽管全年市场实现了较高的收益，但从季度走势看，收益波动显著加大，一二季度在市场在流动性推动和改革预期的支持下大幅上涨，三季度市场在资金去杠杆和经济增长压力增大的背景下大幅度下跌，四季度市场在政府的持续的稳定政策和流动性的支持下风险偏好有所提升，实现了一定的反弹。

回顾本组合的操作，在大类资产配置上，本组合的权益比例在一二季度保持在 85%左右的较高水平，三季度适当下调了权益比例，四季度适当上调了权益比例，但维持在 80%-85%的中高比例；在行业配置上，对全年看好的集成电路、环保、医药、传媒保持了较高的配置，阶段性增持了互联网和军工行业。

### 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 1.714 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.87%，业绩比较基准收益率为 5.99%。

## 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 16 年，由于 3 月以前是数据的真空期，且在连续出台的稳增长政策的支持下，经济继续大幅度下滑的风险降低；货币政策上，由于美国已进入加息周期，预计 16 年整体货币政策虽仍保持宽松，但降息的频率和幅度将远低于 15 年，从股市的供需结构上看，IPO 的加速、大股东减持禁令的解除、定向增发力度的加大使得整体的股票的供给显著加大，而资金除保险资金和海外资金仍有加仓的空间，整体居民端和杠杆资金大幅增加的可能性不大，而经过四季度的反弹整体市

场的估值又回到较高的水平，因此我们判断整体市场的机会将弱于 15 年，结构性机会是主要的方向。

因此 16 年在保持原有优质成长股和价值股的配置的基础上，适当增加估值安全且受益于稳增长政策的品种，我们选择的方向主要包括：一是受益于政策支持且景气度较高的集成电路和高端装备行业；二是，业绩稳定增长且估值合理的医药、环保和传媒行业；三是，受益于潜在供给端改革的水泥和部分化工行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十九（三）收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实价值优势混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

嘉实价值优势混合型证券投资基金 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师许康玮、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 20298 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实价值优势混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 54,108,668.56           | 41,536,438.88            |
| 结算备付金      |         | 1,202,290.49            | 3,981,058.72             |
| 存出保证金      |         | 518,048.55              | 681,783.08               |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 612,996,480.01          | 1,441,886,219.81         |
| 其中：股票投资    |         | 572,801,480.01          | 1,341,847,219.81         |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 40,195,000.00           | 100,039,000.00           |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                       | -                        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 6,786,702.24               | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 1,173,513.36               | 2,491,983.52                |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 24,794.46                  | 259,795.86                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 676,810,497.67             | 1,490,837,279.87            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2014年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 3,395,505.16               | 7,796,833.64                |
| 应付赎回款           |            | 1,761,976.08               | 8,695,476.13                |
| 应付管理人报酬         |            | 858,182.42                 | 1,949,760.90                |
| 应付托管费           |            | 143,030.43                 | 324,960.14                  |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 774,793.15                 | 1,759,999.19                |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 400,777.43                 | 404,935.69                  |
| 负债合计            |            | 7,334,264.67               | 20,931,965.69               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 390,491,040.50             | 1,139,537,232.16            |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 278,985,192.50             | 330,368,082.02              |
| 所有者权益合计         |            | 669,476,233.00             | 1,469,905,314.18            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 676,810,497.67             | 1,490,837,279.87            |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.714 元，基金份额总额 390,491,040.50 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实价值优势混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目  | 附注号 | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至<br>2014年12月31日 |
|------|-----|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入 |     | 609,293,773.83                  | 212,687,901.26                       |

|               |          |                 |                |
|---------------|----------|-----------------|----------------|
| 1. 利息收入       |          | 3,442,039.41    | 5,800,163.90   |
| 其中：存款利息收入     | 7.4.7.11 | 561,936.43      | 1,034,588.68   |
| 债券利息收入        |          | 2,880,102.98    | 4,755,583.55   |
| 资产支持证券利息收入    |          | -               | -              |
| 买入返售金融资产收入    |          | -               | 9,991.67       |
| 其他利息收入        |          | -               | -              |
| 2. 投资收益       |          | 709,012,303.81  | 216,550,704.47 |
| 其中：股票投资收益     | 7.4.7.12 | 703,295,349.61  | 197,108,571.20 |
| 基金投资收益        |          | -               | -              |
| 债券投资收益        | 7.4.7.13 | -15,350.00      | 312,980.00     |
| 资产支持证券投资收益    |          | -               | -              |
| 贵金属投资收益       |          | -               | -              |
| 衍生工具收益        | 7.4.7.14 | -               | -              |
| 股利收益          | 7.4.7.15 | 5,732,304.20    | 19,129,153.27  |
| 3. 公允价值变动收益   | 7.4.7.16 | -104,019,404.44 | -11,061,230.93 |
| 4. 汇兑收益       |          | -               | -              |
| 5. 其他收入       | 7.4.7.17 | 858,835.05      | 1,398,263.82   |
| <b>减：二、费用</b> |          | 30,569,616.96   | 47,429,797.75  |
| 1. 管理人报酬      |          | 16,894,089.11   | 29,235,420.29  |
| 2. 托管费        |          | 2,815,681.61    | 4,872,570.02   |
| 3. 销售服务费      |          | -               | -              |
| 4. 交易费用       | 7.4.7.18 | 10,398,240.76   | 12,679,442.69  |
| 5. 利息支出       |          | -               | 178,261.35     |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |          | -               | 178,261.35     |
| 6. 其他费用       | 7.4.7.19 | 461,605.48      | 464,103.40     |
| <b>三、利润总额</b> |          | 578,724,156.87  | 165,258,103.51 |
| 减：所得税费用       |          | -               | -              |
| <b>四、净利润</b>  |          | 578,724,156.87  | 165,258,103.51 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实价值优势混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                |                  |
|-----------------|--|----------------|------------------|
|                 | 实收基金                                   | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,139,537,232.16                       | 330,368,082.02 | 1,469,905,314.18 |

|                           |                                  |                 |                   |
|---------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -                                | 578,724,156.87  | 578,724,156.87    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -749,046,191.66                  | -630,107,046.39 | -1,379,153,238.05 |
| 其中：1. 基金申购款               | 273,120,074.11                   | 233,684,148.28  | 506,804,222.39    |
| 2. 基金赎回款                  | -1,022,166,265.77                | -863,791,194.67 | -1,885,957,460.44 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -                                | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）           | 390,491,040.50                   | 278,985,192.50  | 669,476,233.00    |
| 项目                        | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |                 |                   |
|                           | 实收基金                             | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）           | 2,321,330,661.73                 | 357,948,952.03  | 2,679,279,613.76  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -                                | 165,258,103.51  | 165,258,103.51    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -1,181,793,429.57                | -192,838,973.52 | -1,374,632,403.09 |
| 其中：1. 基金申购款               | 260,231,502.11                   | 33,549,502.59   | 293,781,004.70    |
| 2. 基金赎回款                  | -1,442,024,931.68                | -226,388,476.11 | -1,668,413,407.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -                                | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）           | 1,139,537,232.16                 | 330,368,082.02  | 1,469,905,314.18  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
赵学军

\_\_\_\_\_  
王红

\_\_\_\_\_  
常旭

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 会计本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致

### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.3 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系               |
|--------------------|-----------------------|
| 嘉实基金管理有限公司         | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金代销机构          |
| 中诚信托有限责任公司         | 基金管理人的股东              |
| 立信投资有限责任公司         | 基金管理人的股东              |
| 德意志资产管理(亚洲)有限公司    | 基金管理人的股东              |

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日), 本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31<br>日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 16,894,089.11                             | 29,235,420.29                                  |
| 其中: 支付销售机构的客   | 2,798,769.99                              | 4,675,707.48                                   |

|      |  |  |
|------|--|--|
| 户维护费 |  |  |
|------|--|--|

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,815,681.61                     | 4,872,570.02                     |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                               |        |               |       |      |               |           |
|----------------------------------|--------|---------------|-------|------|---------------|-----------|
| 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |        |               |       |      |               |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称                   | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| 中国银行                             | -      | 10,376,214.93 | -     | -    | -             | -         |
| 上年度可比期间                          |        |               |       |      |               |           |
| 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |        |               |       |      |               |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称                   | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| 中国银行                             | -      | -             | -     | -    | 60,760,000.00 | 58,720.62 |

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），基金管理人未运用自有资金投资本基金。



## 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

## 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |            |
|-------|--|------------|---|------------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额  | 当期利息收入     |
| 中国银行  | 54,108,668.56                          | 489,732.64 | 41,536,438.88                               | 958,812.81 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

## 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

## 7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

## 7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有流通受限的股票。

## 7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位:张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注   |
|--------|------|------------------|----------------|--------|--------|--------|--------------|-----------|-----------|------|
| 123001 | 蓝标转债 | 2015 年 12 月 23 日 | 2016 年 1 月 8 日 | 未上市    | 100.00 | 100.00 | 230          | 23,000.00 | 23,000.00 | 网下申购 |

## 7.4.5.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

## 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期             | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------------|------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 000028 | 国药   | 2015 年 10 月 21 日 | 重大事  | 69.68  | -    | -      | 800,000 | 30,518,587.94 | 55,744,000.00 | -  |

|        |      |             |            |       |            |       |           |               |               |   |
|--------|------|-------------|------------|-------|------------|-------|-----------|---------------|---------------|---|
|        | 一致   |             | 项停牌        |       |            |       |           |               |               |   |
| 000876 | 新希望  | 2015年8月17日  | 重大事<br>项停牌 | 17.61 | 2016年3月2日  | 17.09 | 706,795   | 13,671,989.60 | 12,446,659.95 | - |
| 002020 | 京新药业 | 2015年12月29日 | 重大事<br>项停牌 | 33.55 | 2016年1月20日 | 30.20 | 1,350,068 | 26,153,642.39 | 45,294,781.40 | - |
| 002049 | 同方国芯 | 2015年12月11日 | 重大事<br>项停牌 | 63.22 | 2016年3月11日 | 54.14 | 565,561   | 23,501,967.47 | 35,754,766.42 | - |
| 300054 | 鼎龙股份 | 2015年11月23日 | 重大事<br>项停牌 | 24.66 | 2016年3月14日 | 22.19 | 409,400   | 8,285,762.38  | 10,095,804.00 | - |
| 600584 | 长电科技 | 2015年11月30日 | 重大事<br>项停牌 | 22.02 | -          | -     | 487,600   | 10,253,477.65 | 10,736,952.00 | - |

### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 572,801,480.01 | 84.63            |
|    | 其中：股票             | 572,801,480.01 | 84.63            |
| 2  | 固定收益投资            | 40,195,000.00  | 5.94             |
|    | 其中：债券             | 40,195,000.00  | 5.94             |
|    | 资产支持证券            | -              | -                |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -                |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -                |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -                |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -                |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 55,310,959.05  | 8.17             |
| 7  | 其他各项资产            | 8,503,058.61   | 1.26             |
|    | 合计                | 676,810,497.67 | 100.00           |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 20,775,936.86  | 3.10         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 366,533,825.69 | 54.75        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 192.80         | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 3,162,078.00   | 0.47         |
| F  | 批发和零售业           | 68,857,600.00  | 10.29        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 16,914,132.00  | 2.53         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 3,235,890.00   | 0.48         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 49,148,507.25  | 7.34         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 29,926,333.08  | 4.47         |
| 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        | 14,246,984.33  | 2.13         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 572,801,480.01 | 85.56        |

## 8.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000028 | 国药一致 | 800,000   | 55,744,000.00 | 8.33         |
| 2  | 002400 | 省广股份 | 1,954,215 | 49,148,507.25 | 7.34         |
| 3  | 002020 | 京新药业 | 1,350,068 | 45,294,781.40 | 6.77         |
| 4  | 002049 | 同方国芯 | 565,561   | 35,754,766.42 | 5.34         |
| 5  | 600835 | 上海机电 | 1,163,515 | 35,266,139.65 | 5.27         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 6  | 601992 | 金隅股份 | 3,536,886 | 33,140,621.82 | 4.95 |
| 7  | 000826 | 启迪桑德 | 755,334   | 29,926,333.08 | 4.47 |
| 8  | 000786 | 北新建材 | 2,107,416 | 25,078,250.40 | 3.75 |
| 9  | 000401 | 冀东水泥 | 1,647,848 | 17,961,543.20 | 2.68 |
| 10 | 002338 | 奥普光电 | 234,400   | 16,930,712.00 | 2.53 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 600585 | 海螺水泥 | 104,954,114.93 | 7.14           |
| 2  | 601021 | 春秋航空 | 75,056,211.09  | 5.11           |
| 3  | 000826 | 启迪桑德 | 72,134,742.90  | 4.91           |
| 4  | 002400 | 省广股份 | 64,988,402.62  | 4.42           |
| 5  | 600835 | 上海机电 | 60,427,795.38  | 4.11           |
| 6  | 600525 | 长园集团 | 55,150,951.25  | 3.75           |
| 7  | 000998 | 隆平高科 | 50,594,287.65  | 3.44           |
| 8  | 601992 | 金隅股份 | 50,254,941.19  | 3.42           |
| 9  | 000786 | 北新建材 | 50,149,585.19  | 3.41           |
| 10 | 000758 | 中色股份 | 47,125,428.90  | 3.21           |
| 11 | 300066 | 三川股份 | 43,995,234.21  | 2.99           |
| 12 | 600477 | 杭萧钢构 | 43,708,447.05  | 2.97           |
| 13 | 000002 | 万科A  | 39,667,004.06  | 2.70           |
| 14 | 002612 | 朗姿股份 | 38,854,298.29  | 2.64           |
| 15 | 000673 | 当代东方 | 38,740,252.09  | 2.64           |
| 16 | 600271 | 航天信息 | 37,944,042.25  | 2.58           |
| 17 | 300334 | 津膜科技 | 37,409,223.80  | 2.55           |
| 18 | 300450 | 先导智能 | 36,769,525.48  | 2.50           |
| 19 | 002458 | 益生股份 | 35,918,406.77  | 2.44           |
| 20 | 300006 | 莱美药业 | 34,900,002.33  | 2.37           |
| 21 | 300228 | 富瑞特装 | 34,841,590.88  | 2.37           |
| 22 | 600690 | 青岛海尔 | 34,088,765.07  | 2.32           |
| 23 | 000488 | 晨鸣纸业 | 31,354,136.98  | 2.13           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 24 | 002202 | 金风科技 | 31,127,737.69 | 2.12 |
| 25 | 002041 | 登海种业 | 30,594,551.73 | 2.08 |
| 26 | 000401 | 冀东水泥 | 30,189,633.91 | 2.05 |
| 27 | 300199 | 翰宇药业 | 29,443,991.58 | 2.00 |

### 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|----------------|-----------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车   | 118,138,973.68 | 8.04            |
| 2  | 601021 | 春秋航空   | 105,313,296.76 | 7.16            |
| 3  | 002285 | 世联行    | 91,918,543.70  | 6.25            |
| 4  | 600585 | 海螺水泥   | 90,025,661.46  | 6.12            |
| 5  | 600081 | 东风科技   | 85,759,518.74  | 5.83            |
| 6  | 600660 | 福耀玻璃   | 83,920,967.41  | 5.71            |
| 7  | 000963 | 华东医药   | 79,460,287.35  | 5.41            |
| 8  | 000758 | 中色股份   | 79,077,858.19  | 5.38            |
| 9  | 000401 | 冀东水泥   | 76,361,531.08  | 5.19            |
| 10 | 000961 | 中南建设   | 71,243,448.75  | 4.85            |
| 11 | 300199 | 翰宇药业   | 71,083,929.10  | 4.84            |
| 12 | 002400 | 省广股份   | 67,355,006.55  | 4.58            |
| 13 | 600525 | 长园集团   | 65,982,601.57  | 4.49            |
| 14 | 600271 | 航天信息   | 63,830,681.66  | 4.34            |
| 15 | 601888 | 中国国旅   | 62,052,672.65  | 4.22            |
| 16 | 000028 | 国药一致   | 59,322,139.11  | 4.04            |
| 17 | 000975 | 银泰资源   | 59,070,316.73  | 4.02            |
| 18 | 002081 | 金螳螂    | 58,010,042.82  | 3.95            |
| 19 | 601933 | 永辉超市   | 57,633,768.33  | 3.92            |
| 20 | 600270 | 外运发展   | 56,604,527.95  | 3.85            |
| 21 | 601601 | 中国太保   | 55,325,621.01  | 3.76            |
| 22 | 601199 | 江南水务   | 51,923,239.55  | 3.53            |
| 23 | 600217 | *ST 秦岭 | 50,405,918.23  | 3.43            |
| 24 | 600340 | 华夏幸福   | 48,594,984.34  | 3.31            |
| 25 | 600168 | 武汉控股   | 46,071,767.20  | 3.13            |
| 26 | 600690 | 青岛海尔   | 45,662,196.30  | 3.11            |
| 27 | 600477 | 杭萧钢构   | 44,037,166.77  | 3.00            |
| 28 | 601992 | 金隅股份   | 43,515,814.54  | 2.96            |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 29 | 300066 | 三川股份   | 43,053,040.98 | 2.93 |
| 30 | 000826 | 启迪桑德   | 41,331,715.40 | 2.81 |
| 31 | 600835 | 上海机电   | 40,474,092.52 | 2.75 |
| 32 | 300006 | 莱美药业   | 40,382,124.29 | 2.75 |
| 33 | 600584 | 长电科技   | 39,687,205.19 | 2.70 |
| 34 | 000002 | 万科A    | 39,360,492.85 | 2.68 |
| 35 | 002192 | *ST 融捷 | 38,669,816.18 | 2.63 |
| 36 | 000059 | *ST 华锦 | 38,172,413.67 | 2.60 |
| 37 | 000488 | 晨鸣纸业   | 38,117,616.01 | 2.59 |
| 38 | 000673 | 当代东方   | 35,763,441.58 | 2.43 |
| 39 | 002612 | 朗姿股份   | 35,605,504.37 | 2.42 |
| 40 | 601012 | 隆基股份   | 33,627,120.07 | 2.29 |
| 41 | 300274 | 阳光电源   | 32,980,884.08 | 2.24 |
| 42 | 600358 | 国旅联合   | 31,760,594.67 | 2.16 |
| 43 | 300133 | 华策影视   | 31,379,313.66 | 2.13 |
| 44 | 300228 | 富瑞特装   | 30,982,584.77 | 2.11 |
| 45 | 600050 | 中国联通   | 30,577,976.86 | 2.08 |
| 46 | 002041 | 登海种业   | 30,413,265.11 | 2.07 |

#### 8.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,031,830,397.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,400,445,332.60 |

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 40,172,000.00 | 6.00         |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,172,000.00 | 6.00         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 23,000.00     | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |

|   |    |               |      |
|---|----|---------------|------|
| 9 | 其他 | -             | -    |
|   | 合计 | 40,195,000.00 | 6.00 |

### 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 150206 | 15 国开 06 | 400,000 | 40,172,000.00 | 6.00         |
| 2  | 123001 | 蓝标转债     | 230     | 23,000.00     | 0.00         |

注：报告期末本基金仅持有上述 2 只债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 518,048.55   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,786,702.24 |
| 3  | 应收股利    | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 1,173,513.36 |
| 5 | 应收申购款 | 24,794.46    |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
|   | 合计    | 8,503,058.61 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1  | 000028 | 国药一致 | 55,744,000.00 | 8.33          | 重大事项停牌   |
| 2  | 002020 | 京新药业 | 45,294,781.40 | 6.77          | 重大事项停牌   |
| 3  | 002049 | 同方国芯 | 35,754,766.42 | 5.34          | 重大事项停牌   |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |                |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 16,663       | 23,434.62     | 32,467,933.52 | 8.31%      | 358,023,106.98 | 91.69%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 486,765.95 | 0.12%    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 10~50              |



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010年6月7日）基金份额总额 | 3,931,737,508.29 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 1,139,537,232.16 |
| 本报告期基金总申购份额              | 273,120,074.11   |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 1,022,166,265.77 |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -                |
| 本报告期末基金份额总额              | 390,491,040.50   |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015年5月8日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 6 年提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注     |
|--------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|--------|
|              |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |        |
| 广发证券股份有限公司   | 5      | 962,353,612.37 | 12.95%       | 673,654.15 | 12.95%     | -      |
| 海通证券股份有限公司   | 2      | 937,920,658.47 | 12.62%       | 656,550.35 | 12.62%     | -      |
| 申万宏源证券有限公司   | 2      | 602,103,356.75 | 8.10%        | 421,474.06 | 8.10%      | -      |
| 中国国际金融有限公司   | 2      | 594,724,201.14 | 8.00%        | 416,311.31 | 8.00%      | -      |
| 民生证券股份有限公司   | 2      | 511,158,683.88 | 6.88%        | 357,811.57 | 6.88%      | -      |
| 宏信证券有限责任公司   | 2      | 409,933,803.19 | 5.52%        | 286,956.78 | 5.52%      | 新增 1 个 |
| 东方证券股份有限公司   | 4      | 376,080,372.32 | 5.06%        | 263,256.26 | 5.06%      | 新增 2 个 |
| 安信证券股份有限公司   | 3      | 373,269,404.67 | 5.02%        | 261,288.55 | 5.02%      | -      |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2      | 360,232,973.01 | 4.85%        | 252,164.24 | 4.85%      | -      |
| 兴业证券股份有限公司   | 3      | 318,532,255.45 | 4.29%        | 222,972.57 | 4.29%      | -      |
| 东北证券股份有限公司   | 2      | 277,158,304.91 | 3.73%        | 194,012.60 | 3.73%      | -      |
| 长江证券股份有限公司   | 1      | 270,502,488.44 | 3.64%        | 189,354.61 | 3.64%      | -      |

|                  |   |                |       |            |       |        |
|------------------|---|----------------|-------|------------|-------|--------|
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 2 | 252,691,957.68 | 3.40% | 176,884.82 | 3.40% | -      |
| 方正证券股份<br>有限公司   | 3 | 228,833,383.77 | 3.08% | 160,183.36 | 3.08% | -      |
| 瑞银证券有限<br>责任公司   | 1 | 213,472,517.21 | 2.87% | 149,430.74 | 2.87% | -      |
| 国信证券股份<br>有限公司   | 1 | 210,105,750.90 | 2.83% | 147,074.04 | 2.83% | -      |
| 中信证券股份<br>有限公司   | 3 | 143,512,211.78 | 1.93% | 100,460.02 | 1.93% | -      |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | 2 | 121,738,488.25 | 1.64% | 85,217.63  | 1.64% | -      |
| 华创证券有限<br>责任公司   | 2 | 105,272,950.80 | 1.42% | 73,691.08  | 1.42% | -      |
| 光大证券股份<br>有限公司   | 1 | 65,703,470.19  | 0.88% | 45,992.42  | 0.88% | -      |
| 中国民族证券<br>有限责任公司 | 1 | 45,574,070.48  | 0.61% | 31,901.84  | 0.61% | -      |
| 中国中投证券<br>有限责任公司 | 2 | 29,227,534.81  | 0.39% | 20,459.27  | 0.39% | -      |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 4 | 22,126,624.76  | 0.30% | 15,488.89  | 0.30% | -      |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 渤海证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 东吴证券有限<br>责任公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 广州证券股份<br>有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 国金证券股份<br>有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 国元证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 华宝证券有限<br>责任公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 华福证券有限<br>责任公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 华融证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -     | -          | -     | -      |
| 华泰证券股份           | 4 | -              | -     | -          | -     | 新增 1 个 |

|                        |   |   |   |   |   |   |
|------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 有限公司                   |   |   |   |   |   |   |
| 华西证券有限<br>责任公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限<br>责任公司         | 4 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券有限<br>公司           | 1 | - | - | - | - | - |
| 天源证券经纪<br>有限公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券有限<br>责任公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券有<br>限责任公司        | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券股份<br>有限公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券有限<br>责任公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限<br>责任公司         | 3 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份<br>有限公司         | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券有限<br>责任公司         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券（浙<br>江）有限责任公<br>司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券股份<br>有限公司         | 1 | - | - | - | - | - |

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订

协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中航证券有限公司退租上海交易单元 1 个。

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 E-mail:service@jsfund.cn。

**嘉实基金管理有限公司**  
2016 年 3 月 29 日