

# 嘉实优化红利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》，嘉实优化红利股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实优化红利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	嘉实优化红利混合型证券投资基金
基金简称	嘉实优化红利混合
基金主代码	070032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26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	396,593,602.21份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。同时，以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、较高收益的品种。

### 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
---------------------	---

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	23,705,057.58	4,333,274.32	2,493,725.76
本期利润	44,309,486.04	5,086,327.37	2,303,597.35
加权平均基金份额本期利润	0.3257	0.1552	0.0452
本期加权平均净值利润率	29.09%	15.50%	4.43%
本期基金份额净值增长率	81.03%	21.29%	-1.18%
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	-42,304,478.34	3,158,282.19	117,090.61
期末可供分配基金份额利润	-0.1067	0.1943	0.0022
期末基金资产净值	446,889,972.71	19,819,398.37	53,242,194.48
期末基金份额净值	1.127	1.219	1.005
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	120.67%	21.90%	0.50%

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	25.92%	1.49%	20.79%	1.65%	5.13%	-0.16%
过去六个月	4.49%	2.50%	-13.48%	2.78%	17.97%	-0.28%
过去一年	81.03%	2.27%	26.25%	2.51%	54.78%	-0.24%
过去三年	116.99%	1.61%	70.36%	1.78%	46.63%	-0.17%
自基金合同生效起至今	120.67%	1.54%	79.83%	1.69%	40.84%	-0.15%

注：本基金业绩比较基准为：中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，指数加权方式同沪深 300 指数，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势。

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：

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

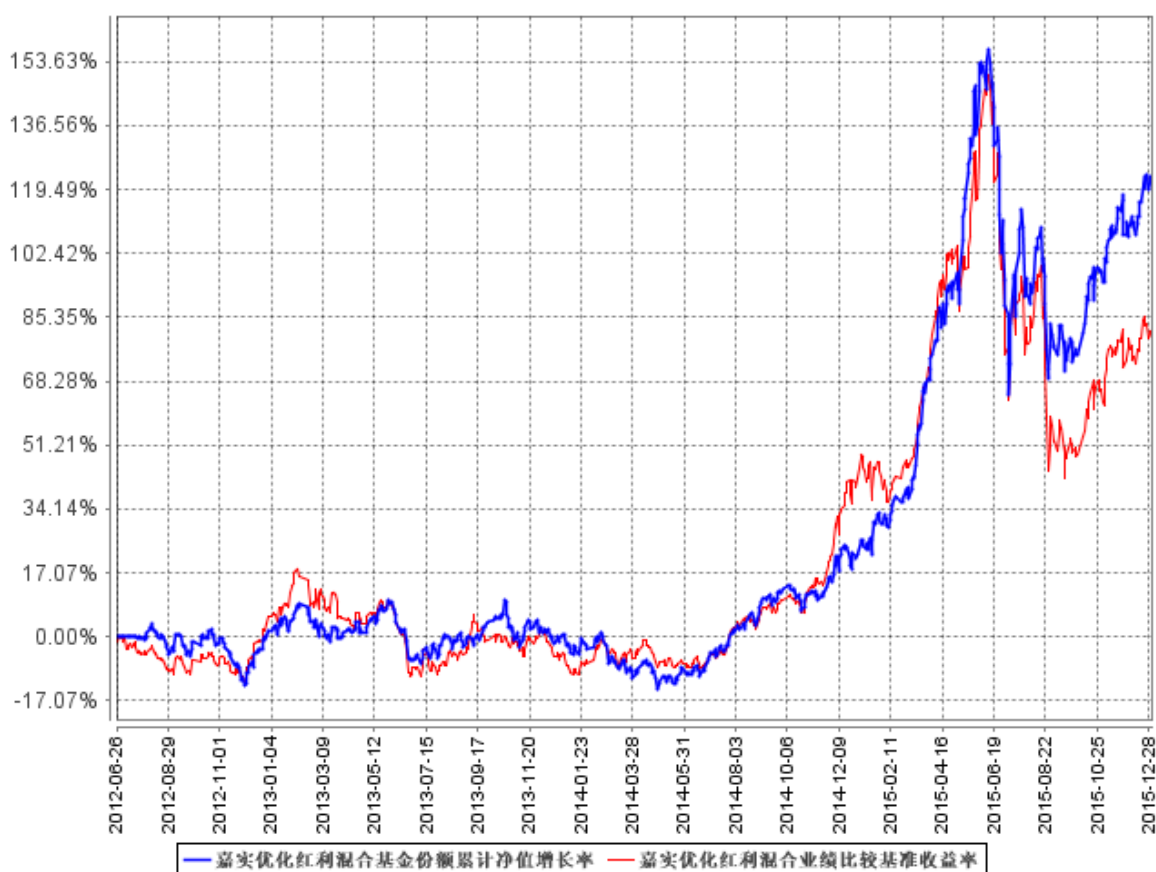
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{中证红利指数收益率}(t)+5\% \times \text{上证国债指数收益率}(t)$$

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

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

#### 嘉实优化红利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：嘉实优化红利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  
(2012 年 6 月 26 日至 2015 年 12 月 31 日)

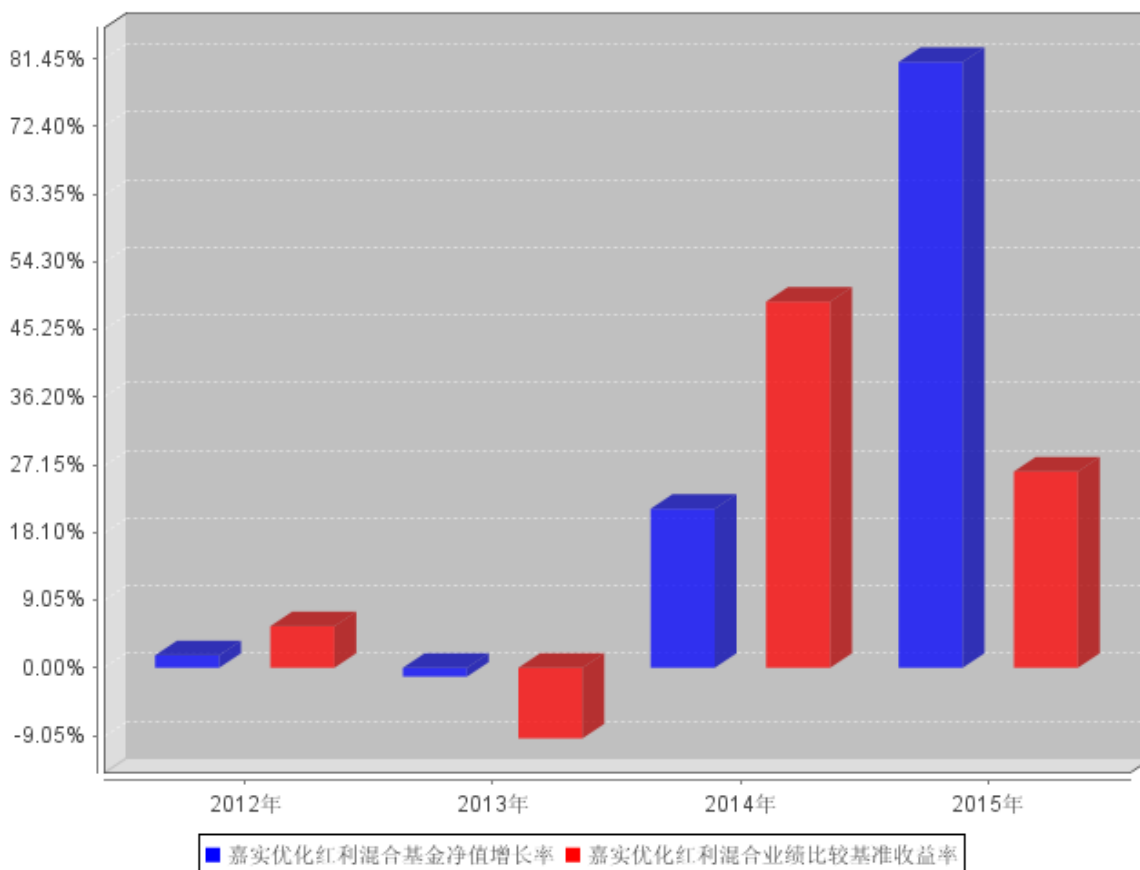
注 1：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分 二、投资范围和 四、投资限制”的有

关约定。

注 2：2015 年 3 月 12 日，本基金管理人发布《关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告》，翟琳琳女士不再担任本基金基金经理，聘请董理先生担任本基金基金经理职务。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

嘉实优化红利混合自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 26 日，2012 年度的相关数据根据当年实际存续期（2012 年 6 月 26 日至 2012 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	8.5340	47,786,942.78	18,869,422.88	66,656,365.66	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	8.5340	47,786,942.78	18,869,422.88	66,656,365.66	

## § 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		
董理	本基金、嘉实增长混合、嘉实创新成长混合基金经理	2015年3月12日	-	7年	2008年加入嘉实基金管理有限公司研究部，曾任股票分析师一职。具有基金从业资格，中国国籍。
翟琳琳	本基金基金经理、嘉实稳健混合、嘉实价值优势股票基金经理	2014年2月7日	2015年3月12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、《嘉实优化红利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

2015 年市场随着流动性的拐点出现了巨幅调整。上半年在增量资金的推动下，市场经历了几近疯狂的上涨，而后在以清理配资出发的去杠杆过程中，流动性压力使得市场经历了非理性下跌。这之后在资产荒的背景下，存量资金博弈带动了市场最后三个月的反弹。全年来看，本基金获得了 81.03% 的收益，大幅战胜市场，在回调过程中通过个股层面的风险控制有效控制了波动，基本实现了既定的目标。

回顾本组合的操作，年初以来考虑到流动性的宽裕尤其是持续的增量资金涌入，组合保持了较高的仓位，在选股层面也更为侧重成长空间和行业属性，积极参与主题投资。在 6 月份随着流动性增速的下滑，个股的持续暴涨，自下而上组合无法找到合适的投资标的，老品种由于远远超过了其合理价值而卖出，因此仓位被动下降，从而在六月下旬之后的市场调整中有效的降低了组合的回撤幅度。随着 9 月市场利空的充分释放，考虑到资金在资产荒背景下无处可去，市场处于存量博弈阶段。组合重新买入了那些下跌到合理区间的优质成长股。但总体上对于市场流动性的



压力我们认为并未充分释放，因此在成长股选择上也着重考虑了其安全边际，在选股标准上也较高，整个组合的仓位并没有非常高，在反弹中依靠精选个股跟上了市场的上涨。

#### 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 1.127 元；本报告期基金份额净值增长率为 81.03%，业绩比较基准收益率为 26.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场处于流动性风险释放的阶段。持续多年的资金向股市的单向流动，积累了较大的流动性风险，2015 年 7-8 月的下跌并未能将风险充分释放。随着股市收益率的下行，投资人的资产配置推动流动性风险逐渐释放，股市在 2016 年面临估值的压力。但我们应清醒的认识到，与 2008 年不同，这一轮的牛市在结构上并不均衡，因此在流动性转弱时股市的压力也是结构性的，高估值的题材股、定价过高的伪成长股面临着巨大的压力。同时优质的成长股却仍然有赚取绝对收益的机会。

今年是十三五的开局年，政策对于基本面的影响至关重要，在投资角度我们要顺应趋势，尤其是寻找今年政策着力点与之前几年不同的地方，这些方向是最容易产生预期差的。同时，符合消费转型趋势的行业面临着需求的持续增长，也会产生很好的成长型投资机会。2016 年是自下而上选股的一年，市场的分化，甚至是行业内的分化都会非常剧烈。在市场的调整中要兴奋起来，今年是可以为投资人贡献高质量回报的一年，也是作为公募基金管理者体现自身价值的一年。

#### 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

(1) 本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 20 日发布《嘉实优化红利股票型证券投资基金 2014 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.749 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于报告期内实施了 2 次利润分配，符合本基金基金合同（十九（二）收益分配原则）的约定，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(3) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为 44,309,486.04 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为 -42,304,478.34 元、3.1.2 “期末可供分配基金份额利润” -0.1067 元，以及本基金基金合同（十五（三）基金收益分配原则）所示，本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 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”）在嘉实优化红利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

嘉实优化红利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 20313 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：嘉实优化红利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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	128,649,297.43	3,022,145.83
结算备付金		1,024,913.74	911,485.38
存出保证金		220,037.14	16,457.03
交易性金融资产	7.4.7.2	314,416,650.04	16,287,112.90
其中：股票投资		314,416,650.04	16,287,112.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		2,340,842.97	-
应收利息	7.4.7.5	22,183.07	903.60
应收股利		-	-
应收申购款		3,949,967.96	83,267.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		450,623,892.35	20,321,372.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付赎回款		2,432,242.69	67,571.21
应付管理人报酬		450,369.25	28,722.85
应付托管费		75,061.58	4,787.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	407,039.87	50,783.99
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	369,206.25	350,108.62
负债合计		3,733,919.64	501,973.81
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	396,593,602.21	16,254,823.17
未分配利润	7.4.7.10	50,296,370.50	3,564,575.20
所有者权益合计		446,889,972.71	19,819,398.37
负债和所有者权益总计		450,623,892.35	20,321,372.18

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 396,593,602.21 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实优化红利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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		50,364,235.71	6,349,496.53
1. 利息收入		317,823.56	145,593.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	317,823.56	30,381.77
债券利息收入		-	32,208.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	83,002.85
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		28,860,308.09	5,360,251.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	28,202,332.92	5,102,665.43

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	6,178.00
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	657,975.17	251,407.81
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	20,604,428.46	753,053.05
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	581,675.60	90,598.63
<b>减：二、费用</b>		6,054,749.67	1,263,169.16
1. 管理人报酬		2,235,151.92	492,808.50
2. 托管费		372,525.35	82,134.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,048,078.65	313,003.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	398,993.75	375,222.42
<b>三、利润总额</b>		44,309,486.04	5,086,327.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		44,309,486.04	5,086,327.37

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实优化红利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 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）	16,254,823.17	3,564,575.20	19,819,398.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,309,486.04	44,309,486.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	380,338,779.04	69,078,674.92	449,417,453.96
其中：1. 基金申购款	785,015,932.44	137,462,103.10	922,478,035.54
2. 基金赎回款	-404,677,153.40	-68,383,428.18	-473,060,581.58
四、本期向基金份额持有	-	-66,656,365.66	-66,656,365.66

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）	396,593,602.21	50,296,370.50	446,889,972.71
项目	上年度可比期间 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）	52,990,590.62	251,603.86	53,242,194.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,086,327.37	5,086,327.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-36,735,767.45	-1,773,356.03	-38,509,123.48
其中：1. 基金申购款	47,256,013.28	4,641,580.24	51,897,593.52
2. 基金赎回款	-83,991,780.73	-6,414,936.27	-90,406,717.00
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）	16,254,823.17	3,564,575.20	19,819,398.37

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 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,235,151.92	492,808.50
其中：支付销售机构的客户维护费	401,386.60	127,294.27

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	372,525.35	82,134.74

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

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），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	128,649,297.43	293,954.02	3,022,145.83	23,365.90

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

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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	国药一致	2015年10月21日	重大事项停牌	69.68	-	-	40,000	2,993,594.65	2,787,200.00	-
000876	新希望	2015年8月17日	重大事项停牌	17.61	2016年3月2日	17.09	350,000	6,572,981.07	6,163,500.00	-
002049	同方国芯	2015年12月11日	重大事项停牌	63.22	2016年3月11日	54.14	160,000	10,162,642.80	10,115,200.00	-
002696	百洋股份	2015年12月2日	重大事项停牌	26.36	-	-	449,933	10,806,081.22	11,860,233.88	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项停牌	71.46	-	-	49,910	2,553,656.10	3,566,568.60	-

### 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(%)
1	权益投资	314,416,650.04	69.77
	其中:股票	314,416,650.04	69.77
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	129,674,211.17	28.78
7	其他各项资产	6,533,031.14	1.45
	合计	450,623,892.35	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	45,618,483.88	10.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	134,402,052.28	30.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,208,000.00	1.17
E	建筑业	35,948,250.60	8.04
F	批发和零售业	42,620,231.80	9.54
G	交通运输、仓储和邮政业	11,874,774.42	2.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,692,800.00	1.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,074,119.00	1.58
L	租赁和商务服务业	12,575,000.00	2.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	13,402,938.06	3.00
S	综合	-	-
	合计	314,416,650.04	70.36

## 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	000963	华东医药	438,955	35,976,751.80	8.05
2	600477	杭萧钢构	2,922,622	35,948,250.60	8.04
3	000998	隆平高科	1,421,400	33,758,250.00	7.55
4	300362	天保重装	233,317	14,167,008.24	3.17

5	000488	晨鸣纸业	1,515,800	13,520,936.00	3.03
6	300133	华策影视	449,914	13,402,938.06	3.00
7	600687	刚泰控股	550,000	12,969,000.00	2.90
8	002563	森马服饰	1,019,964	12,647,553.60	2.83
9	002400	省广股份	500,000	12,575,000.00	2.81
10	603167	渤海轮渡	956,101	11,874,774.42	2.66

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	000998	隆平高科	59,209,846.72	298.75
2	300133	华策影视	46,836,489.33	236.32
3	600477	杭萧钢构	39,461,848.58	199.11
4	000963	华东医药	33,723,859.29	170.16
5	002086	东方海洋	33,509,046.58	169.07
6	000333	美的集团	31,837,892.65	160.64
7	600037	歌华有线	29,517,593.10	148.93
8	600687	刚泰控股	28,426,333.58	143.43
9	600570	恒生电子	27,522,599.30	138.87
10	002285	世联行	26,014,975.51	131.26
11	601398	工商银行	20,706,555.54	104.48
12	300376	易事特	20,342,580.35	102.64
13	601021	春秋航空	19,667,880.55	99.24
14	600856	中天能源	19,283,067.10	97.29
15	002563	森马服饰	19,226,625.75	97.01
16	002101	广东鸿图	18,882,569.96	95.27
17	002696	百洋股份	18,522,186.01	93.45
18	000651	格力电器	18,149,193.99	91.57
19	601288	农业银行	17,148,402.00	86.52
20	002400	省广股份	16,901,359.16	85.28
21	002241	歌尔声学	16,900,870.80	85.27

22	601166	兴业银行	16,356,069.28	82.53
23	601888	中国国旅	15,367,053.48	77.54
24	000488	晨鸣纸业	15,060,398.04	75.99
25	002715	登云股份	15,043,280.16	75.90
26	300362	天保重装	13,253,098.31	66.87
27	300325	德威新材	12,697,988.39	64.07
28	300012	华测检测	12,610,795.69	63.63
29	601058	赛轮金宇	12,591,334.00	63.53
30	002445	中南重工	12,395,431.72	62.54
31	600055	华润万东	12,348,020.00	62.30
32	600511	国药股份	12,109,738.70	61.10
33	603167	渤海轮渡	11,987,181.59	60.48
34	000028	国药一致	11,748,135.58	59.28
35	300274	阳光电源	11,689,250.56	58.98
36	000820	金城股份	11,546,788.06	58.26
37	002612	朗姿股份	10,806,420.60	54.52
38	603001	奥康国际	10,790,743.62	54.45
39	600585	海螺水泥	10,778,456.68	54.38
40	600867	通化东宝	10,633,415.66	53.65
41	002192	*ST 融捷	10,567,230.00	53.32
42	002049	同方国芯	10,162,642.80	51.28
43	002494	华斯股份	10,111,400.17	51.02
44	600000	浦发银行	9,765,553.18	49.27
45	600029	南方航空	9,621,099.00	48.54
46	601939	建设银行	9,552,899.00	48.20
47	600885	宏发股份	9,256,220.23	46.70
48	002041	登海种业	8,997,553.96	45.40
49	600261	阳光照明	8,876,226.33	44.79
50	002467	二六三	8,578,608.98	43.28
51	601318	中国平安	8,378,126.08	42.27
52	300271	华宇软件	8,202,060.58	41.38
53	002048	宁波华翔	8,170,975.93	41.23
54	000882	华联股份	8,028,829.24	40.51
55	002672	东江环保	7,951,769.69	40.12
56	002020	京新药业	7,789,152.01	39.30
57	300056	三维丝	7,714,102.00	38.92

58	601169	北京银行	7,473,391.80	37.71
59	600993	马应龙	7,314,683.75	36.91
60	300385	雪浪环境	7,200,986.80	36.33
61	000501	鄂武商A	7,136,806.14	36.01
62	601601	中国太保	7,063,474.00	35.64
63	000876	新希望	6,987,551.07	35.26
64	300163	先锋新材	6,775,033.00	34.18
65	601328	交通银行	6,511,045.65	32.85
66	000669	金鸿能源	6,382,249.02	32.20
67	300124	汇川技术	6,366,138.91	32.12
68	300005	探路者	6,233,346.99	31.45
69	000002	万科A	6,220,314.99	31.38
70	600594	益佰制药	6,194,430.58	31.25
71	603588	高能环境	6,068,487.00	30.62
72	600547	山东黄金	6,008,113.10	30.31
73	000401	冀东水泥	5,860,752.12	29.57
74	600446	金证股份	5,816,207.20	29.35
75	600804	鹏博士	5,642,710.93	28.47
76	002206	海利得	5,640,161.33	28.46
77	601555	东吴证券	5,440,391.00	27.45
78	601788	光大证券	5,415,249.00	27.32
79	002311	海大集团	5,414,458.16	27.32
80	600708	光明地产	5,319,749.00	26.84
81	600566	济川药业	5,030,007.52	25.38
82	600048	保利地产	5,015,439.00	25.31
83	600435	北方导航	4,952,625.00	24.99
84	600050	中国联通	4,928,800.00	24.87
85	600325	华发股份	4,857,548.20	24.51
86	600079	人福医药	4,802,535.56	24.23
87	000673	当代东方	4,759,005.58	24.01
88	600527	江南高纤	4,749,731.00	23.97
89	000540	中天城投	4,733,918.42	23.89
90	000158	常山股份	4,623,500.00	23.33
91	600651	飞乐音响	4,611,664.50	23.27
92	000961	中南建设	4,591,717.00	23.17
93	002654	万润科技	4,587,613.00	23.15

94	000938	紫光股份	4,587,236.00	23.15
95	300418	昆仑万维	4,499,140.00	22.70
96	600115	东方航空	4,392,860.20	22.16
97	002373	千方科技	4,339,535.24	21.90
98	300176	鸿特精密	4,270,339.61	21.55
99	002469	三维工程	4,265,478.20	21.52
100	000001	平安银行	4,260,207.16	21.50
101	002566	益盛药业	4,240,947.52	21.40
102	002702	海欣食品	4,170,708.84	21.04
103	601628	中国人寿	4,111,588.15	20.75
104	000858	五粮液	4,021,746.00	20.29
105	603718	海利生物	3,898,390.00	19.67
106	000710	天兴仪表	3,676,125.99	18.55
107	600116	三峡水利	3,664,001.00	18.49
108	600036	招商银行	3,638,650.46	18.36
109	600057	象屿股份	3,634,276.76	18.34
110	002614	蒙发利	3,471,593.15	17.52
111	600667	太极实业	3,418,859.00	17.25
112	000599	青岛双星	3,395,092.61	17.13
113	601818	光大银行	3,387,123.00	17.09
114	600720	祁连山	3,282,982.08	16.56
115	600030	中信证券	3,267,504.00	16.49
116	601111	中国国航	3,245,000.00	16.37
117	000888	峨眉山A	3,241,664.32	16.36
118	002411	九九久	3,176,467.00	16.03
119	601633	长城汽车	3,139,101.08	15.84
120	300425	环能科技	3,131,141.95	15.80
121	000524	岭南控股	3,123,847.63	15.76
122	002385	大北农	3,036,345.00	15.32
123	600271	航天信息	2,953,074.10	14.90
124	300313	天山生物	2,928,250.96	14.77
125	002358	森源电气	2,881,307.45	14.54
126	000049	德赛电池	2,849,684.77	14.38
127	002271	东方雨虹	2,735,922.92	13.80
128	600177	雅戈尔	2,700,178.00	13.62
129	002081	金螳螂	2,653,100.02	13.39

130	600015	华夏银行	2,617,000.00	13.20
131	600323	瀚蓝环境	2,560,968.00	12.92
132	002341	新纶科技	2,452,247.00	12.37
133	601992	金隅股份	2,329,678.14	11.75
134	000797	中国武夷	2,212,879.40	11.17
135	002098	浔兴股份	2,189,216.00	11.05
136	600153	建发股份	2,140,000.00	10.80
137	600557	康缘药业	1,835,121.50	9.26
138	300304	云意电气	1,739,480.72	8.78
139	300003	乐普医疗	1,580,872.99	7.98
140	000024	招商地产	1,567,372.02	7.91
141	002572	索菲亚	1,439,918.27	7.27
142	300210	森远股份	1,311,062.55	6.62
143	000099	中信海直	1,233,239.00	6.22
144	600887	伊利股份	1,229,398.02	6.20
145	000690	宝新能源	1,175,100.00	5.93
146	000625	长安汽车	1,140,195.88	5.75
147	600138	中青旅	1,089,144.22	5.50
148	002228	合兴包装	1,083,000.00	5.46
149	002609	捷顺科技	1,079,759.00	5.45
150	002253	川大智胜	1,074,742.00	5.42
151	002124	天邦股份	983,522.83	4.96
152	002727	一心堂	982,719.94	4.96
153	002436	兴森科技	962,036.00	4.85
154	300115	长盈精密	858,450.56	4.33
155	000932	华菱钢铁	826,340.00	4.17
156	002410	广联达	814,986.94	4.11
157	002477	雏鹰农牧	797,766.99	4.03
158	002202	金风科技	774,150.00	3.91
159	002002	鸿达兴业	690,880.00	3.49
160	300306	远方光电	638,735.98	3.22
161	002648	卫星石化	632,672.00	3.19
162	000513	丽珠集团	608,008.00	3.07
163	002007	华兰生物	556,089.00	2.81
164	000786	北新建材	532,062.00	2.68
165	600833	第一医药	513,174.00	2.59

166	603019	中科曙光	494,145.00	2.49
167	002030	达安基因	484,334.00	2.44
168	300175	朗源股份	471,458.30	2.38
169	000902	新洋丰	463,974.86	2.34
170	002250	联化科技	450,884.00	2.27
171	600559	老白干酒	450,000.00	2.27
172	600525	长园集团	438,194.00	2.21
173	600081	东风科技	424,372.95	2.14
174	000887	中鼎股份	422,037.51	2.13
175	300049	福瑞股份	419,250.00	2.12
176	300164	通源石油	417,146.50	2.10
177	300336	新文化	407,740.00	2.06

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002086	东方海洋	37,959,727.61	191.53
2	300133	华策影视	33,221,040.01	167.62
3	000333	美的集团	32,041,892.25	161.67
4	600037	歌华有线	31,770,878.98	160.30
5	002285	世联行	30,022,691.50	151.48
6	600570	恒生电子	26,917,014.48	135.81
7	000998	隆平高科	26,815,623.59	135.30
8	601021	春秋航空	22,947,829.85	115.78
9	601398	工商银行	20,644,221.11	104.16
10	300376	易事特	19,870,964.59	100.26
11	000820	金城股份	19,841,641.37	100.11
12	000651	格力电器	18,435,040.98	93.02
13	600856	中天能源	18,266,026.26	92.16
14	601288	农业银行	16,792,907.00	84.73
15	600687	刚泰控股	16,783,075.03	84.68
16	601166	兴业银行	16,157,831.91	81.53
17	002715	登云股份	15,919,044.74	80.32
18	300012	华测检测	15,383,296.72	77.62



19	002101	广东鸿图	15,298,975.25	77.19
20	601888	中国国旅	14,672,752.38	74.03
21	002241	歌尔声学	14,592,377.79	73.63
22	002612	朗姿股份	12,724,822.34	64.20
23	600055	华润万东	12,492,406.07	63.03
24	300325	德威新材	11,818,014.02	59.63
25	300274	阳光电源	11,586,773.80	58.46
26	601058	赛轮金宇	11,446,270.00	57.75
27	600511	国药股份	11,400,433.14	57.52
28	002467	二六三	11,208,426.94	56.55
29	600029	南方航空	10,944,426.27	55.22
30	002048	宁波华翔	10,254,627.08	51.74
31	600885	宏发股份	10,042,087.50	50.67
32	600000	浦发银行	10,018,554.21	50.55
33	002494	华斯股份	9,981,372.83	50.36
34	601939	建设银行	9,639,394.71	48.64
35	600585	海螺水泥	9,313,641.28	46.99
36	002192	*ST 融捷	9,185,906.14	46.35
37	601318	中国平安	8,871,836.43	44.76
38	603001	奥康国际	8,787,136.66	44.34
39	002041	登海种业	8,734,316.80	44.07
40	300271	华宇软件	8,520,186.93	42.99
41	002020	京新药业	7,742,347.48	39.06
42	600477	杭萧钢构	7,643,697.84	38.57
43	000028	国药一致	7,502,208.67	37.85
44	002563	森马服饰	7,458,823.60	37.63
45	002672	东江环保	7,443,894.00	37.56
46	603588	高能环境	7,336,581.34	37.02
47	300124	汇川技术	7,256,007.35	36.61
48	601169	北京银行	7,053,095.67	35.59
49	601601	中国太保	7,017,127.10	35.41
50	300418	昆仑万维	7,000,807.00	35.32
51	601328	交通银行	6,871,950.58	34.67
52	600708	光明地产	6,869,862.00	34.66
53	300056	三维丝	6,556,390.04	33.08
54	000158	常山股份	6,371,314.15	32.15
55	000002	万科A	6,304,020.18	31.81
56	000961	中南建设	6,285,736.63	31.72

57	300163	先锋新材	6,269,558.00	31.63
58	002400	省广股份	6,153,386.11	31.05
59	600527	江南高纤	6,088,440.00	30.72
60	600993	马应龙	6,004,028.64	30.29
61	000669	金鸿能源	5,974,787.34	30.15
62	600446	金证股份	5,649,846.54	28.51
63	600547	山东黄金	5,533,149.61	27.92
64	600050	中国联通	5,533,067.71	27.92
65	002696	百洋股份	5,508,817.61	27.80
66	600435	北方导航	5,370,750.40	27.10
67	600048	保利地产	5,359,701.41	27.04
68	601555	东吴证券	5,235,280.00	26.41
69	601788	光大证券	5,223,718.00	26.36
70	600651	飞乐音响	5,181,993.00	26.15
71	600079	人福医药	5,161,770.46	26.04
72	603718	海利生物	5,156,052.00	26.02
73	000540	中天城投	5,106,351.72	25.76
74	000673	当代东方	4,970,418.58	25.08
75	600325	华发股份	4,943,469.00	24.94
76	600594	益佰制药	4,892,087.50	24.68
77	600566	济川药业	4,748,142.50	23.96
78	002654	万润科技	4,732,120.50	23.88
79	300176	鸿特精密	4,681,339.00	23.62
80	600115	东方航空	4,650,095.49	23.46
81	000938	紫光股份	4,441,945.68	22.41
82	002311	海大集团	4,397,838.60	22.19
83	000710	天兴仪表	4,253,630.82	21.46
84	000001	平安银行	4,249,186.40	21.44
85	002469	三维工程	4,181,855.00	21.10
86	002373	千方科技	3,972,948.30	20.05
87	002702	海欣食品	3,922,796.40	19.79
88	601628	中国人寿	3,900,892.48	19.68
89	000888	峨眉山A	3,861,304.16	19.48
90	601818	光大银行	3,703,129.00	18.68
91	300425	环能科技	3,655,535.00	18.44
92	600667	太极实业	3,595,893.00	18.14
93	000599	青岛双星	3,590,320.00	18.12
94	600036	招商银行	3,484,736.00	17.58

95	600057	象屿股份	3,459,885.40	17.46
96	002566	益盛药业	3,418,509.00	17.25
97	002081	金螳螂	3,417,220.46	17.24
98	002614	蒙发利	3,409,211.60	17.20
99	002411	九九久	3,361,598.90	16.96
100	601633	长城汽车	3,299,440.57	16.65
101	000401	冀东水泥	3,218,197.51	16.24
102	000501	鄂武商A	3,160,706.52	15.95
103	002385	大北农	3,148,082.90	15.88
104	000858	五粮液	3,111,036.00	15.70
105	601992	金隅股份	3,091,728.98	15.60
106	601111	中国国航	3,031,600.00	15.30
107	002271	东方雨虹	3,021,634.50	15.25
108	600030	中信证券	2,940,101.00	14.83
109	600867	通化东宝	2,890,629.22	14.58
110	600177	雅戈尔	2,870,951.50	14.49
111	000049	德赛电池	2,851,192.00	14.39
112	300362	天保重装	2,761,492.40	13.93
113	000524	岭南控股	2,737,655.00	13.81
114	002341	新纶科技	2,675,477.00	13.50
115	600153	建发股份	2,645,734.93	13.35
116	002358	森源电气	2,576,872.48	13.00
117	002098	浔兴股份	2,560,616.00	12.92
118	000797	中国武夷	2,498,152.53	12.60
119	600323	瀚蓝环境	2,428,372.00	12.25
120	600015	华夏银行	2,400,220.00	12.11
121	300313	天山生物	2,395,358.12	12.09
122	000488	晨鸣纸业	2,348,893.53	11.85
123	600557	康缘药业	2,207,637.00	11.14
124	000625	长安汽车	1,636,446.17	8.26
125	300003	乐普医疗	1,608,614.01	8.12
126	000024	招商地产	1,583,856.29	7.99
127	002572	索菲亚	1,552,178.00	7.83
128	600081	东风科技	1,524,150.45	7.69
129	300304	云意电气	1,367,346.11	6.90
130	000690	宝新能源	1,317,338.00	6.65
131	300073	当升科技	1,266,708.99	6.39
132	600887	伊利股份	1,265,490.00	6.39

133	000099	中信海直	1,247,389.00	6.29
134	002253	川大智胜	1,215,102.02	6.13
135	002228	合兴包装	1,212,773.00	6.12
136	600660	福耀玻璃	1,212,645.00	6.12
137	300210	森远股份	1,202,082.00	6.07
138	600138	中青旅	1,172,273.80	5.91
139	000975	银泰资源	1,151,979.29	5.81
140	002727	一心堂	1,071,830.00	5.41
141	002609	捷顺科技	1,034,107.00	5.22
142	300115	长盈精密	1,001,777.64	5.05
143	000932	华菱钢铁	940,993.00	4.75
144	002410	广联达	931,045.00	4.70
145	002477	雏鹰农牧	910,700.00	4.59
146	002436	兴森科技	889,455.00	4.49
147	002124	天邦股份	865,172.88	4.37
148	002202	金风科技	840,000.00	4.24
149	300306	远方光电	839,961.00	4.24
150	002002	鸿达兴业	792,912.43	4.00
151	000963	华东医药	790,508.50	3.99
152	300175	朗源股份	738,113.00	3.72
153	000758	中色股份	703,414.00	3.55
154	000902	新洋丰	680,700.00	3.43
155	000059	*ST 华锦	674,400.00	3.40
156	002007	华兰生物	629,250.00	3.17
157	002648	卫星石化	627,745.35	3.17
158	000513	丽珠集团	591,374.40	2.98
159	002030	达安基因	577,581.80	2.91
160	600217	*ST 秦岭	558,360.04	2.82
161	600270	外运发展	552,799.80	2.79
162	000786	北新建材	550,697.22	2.78
163	600833	第一医药	545,817.00	2.75
164	600559	老白干酒	521,035.00	2.63
165	603019	中科曙光	509,566.80	2.57
166	300049	福瑞股份	482,178.00	2.43
167	000887	中鼎股份	469,409.57	2.37
168	601199	江南水务	464,346.33	2.34
169	600525	长园集团	438,228.99	2.21
170	002250	联化科技	436,415.05	2.20

171	000876	新希望	429,877.00	2.17
172	300336	新文化	428,439.76	2.16
173	600271	航天信息	424,600.00	2.14
174	300164	通源石油	418,000.00	2.11
175	600166	福田汽车	412,201.23	2.08

#### 8.4.3 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	1,342,613,164.46
卖出股票收入（成交）总额	1,093,290,388.70

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

报告期末，本基金未持有债券。

#### 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

报告期末，本基金未持有债券。

#### 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	220,037.14
2	应收证券清算款	2,340,842.97
3	应收股利	-
4	应收利息	22,183.07
5	应收申购款	3,949,967.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	6,533,031.14

#### 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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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 (户)	户均持有的 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 额比例	持有份额	占总份 额比例
10,805	36,704.64	103,797,450.67	26.17%	292,796,151.54	73.83%

### 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	614,704.10	0.15%

持有本基金		
-------	--	--

### 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（2012年6月26日）基金份额总额	588,616,310.91
本报告期期初基金份额总额	16,254,823.17
本报告期基金总申购份额	785,015,932.44
减:本报告期基金总赎回份额	404,677,153.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	396,593,602.21

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额、红利再投份额，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3月12日，本基金管理人发布《关于嘉实优化红利股票基金经理变更的公告》，翟琳琳女士不再担任本基金基金经理；聘请董理先生担任本基金基金经理职务。

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 60,000.00 元，该审计机构已连续 4 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	
民生证券股份有限公司	2	640,523,526.47	26.30%	448,368.76	26.30%	-
海通证券股份有限公司	2	518,368,320.70	21.28%	362,862.16	21.28%	-
齐鲁证券有限公司	1	254,494,828.25	10.45%	178,148.54	10.45%	-



东北证券股份 有限公司	2	228,140,997.13	9.37%	159,699.65	9.37%	-
东方证券股份 有限公司	4	169,745,955.05	6.97%	118,822.18	6.97%	新增 2 个
安信证券股份 有限公司	3	110,317,633.87	4.53%	77,222.37	4.53%	-
中国银河证券 股份有限公司	2	102,178,243.23	4.20%	71,524.76	4.20%	-
方正证券股份 有限公司	3	96,628,211.19	3.97%	67,640.63	3.97%	-
广发证券股份 有限公司	5	91,656,675.00	3.76%	64,159.68	3.76%	-
华创证券有限 责任公司	2	89,751,364.82	3.69%	62,827.14	3.69%	-
长江证券股份 有限公司	1	87,914,203.13	3.61%	61,540.95	3.61%	-
中信建投证券 股份有限公司	2	23,026,875.45	0.95%	16,118.81	0.95%	-
国信证券股份 有限公司	1	16,526,267.14	0.68%	11,568.41	0.68%	-
东兴证券股份 有限公司	1	6,233,031.73	0.26%	4,363.13	0.26%	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
华泰证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	新增 1 个
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券（浙 江）有限责任公 司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
宏源证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增 1 个

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