

# 嘉实增长开放式证券投资基金 2015 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
8.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	53
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实增长开放式证券投资基金
基金简称	嘉实增长混合
基金主代码	070002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 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	300,248,211.86 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司，以获取未来资本增值的机会，并谋求基金资产的中长期稳定增值，同时通过分散投资提高基金资产的流动性。
投资策略	从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票，重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮 500（小盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为单位基金资产净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 1.0 左右。

### 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
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 46 层 06-08 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100005	100818
法定代表人	邓红国	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

## § 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	1,928,710,896.33	589,280,823.34	246,190,230.65
本期利润	1,821,394,913.69	421,650,384.45	561,012,523.85
加权平均基金份额本期利润	5.4138	0.7347	0.7194
本期加权平均净值利润率	58.84%	13.80%	14.20%
本期基金份额净值增长率	67.43%	14.88%	14.12%
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	2,716,145,389.18	2,330,539,376.26	2,792,422,700.67
期末可供分配基金份额利润	9.0463	5.0086	4.2410
期末基金资产净值	3,016,393,601.04	2,795,844,785.00	3,450,863,623.79
期末基金份额净值	10.046	6.009	5.241
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	1,264.22%	714.79%	609.26%

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	18.72%	1.36%	18.49%	1.24%	0.23%	0.12%
过去六个月	-4.10%	2.14%	-9.27%	2.45%	5.17%	-0.31%
过去一年	67.43%	2.28%	57.66%	2.38%	9.77%	-0.10%
过去三年	119.51%	1.58%	163.44%	1.77%	-43.93%	-0.19%
过去五年	88.32%	1.36%	78.94%	1.69%	9.38%	-0.33%
自基金合同生效起至今	1,264.22%	1.31%	573.39%	2.00%	690.83%	-0.69%

注：本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 500(小盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

巨潮小盘指数的总市值相对于 A 股市场覆盖率约为 14%，具有良好的市场代表性，用以反映 A 股市场小盘市值股票的运行情况，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

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

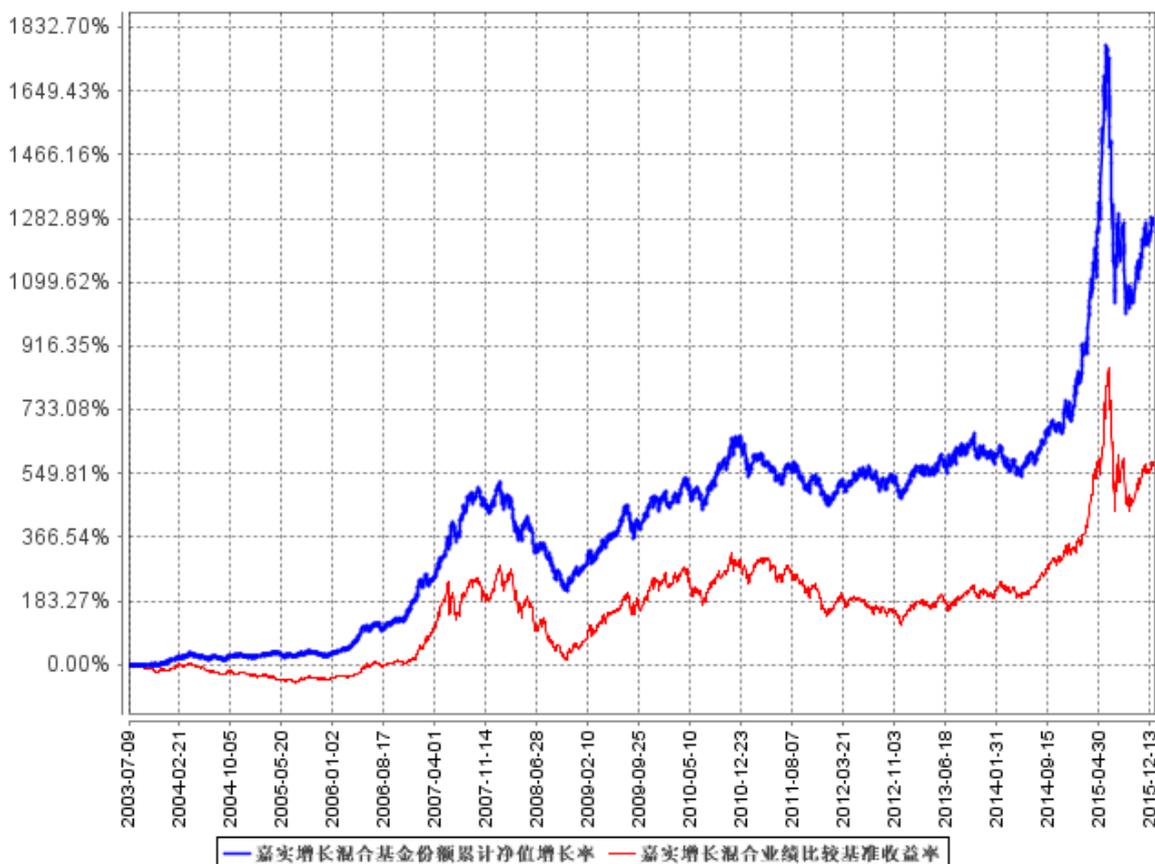
$$\text{Return}(t) = 60\% * \text{巨潮 500(小盘)指数}(t) / \text{巨潮 500(小盘)指数}(t-1) - 1 + 40\% * (\text{中国债券总指数}(t) / \text{中国债券总指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实增长混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实增长混合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

(2003 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日)

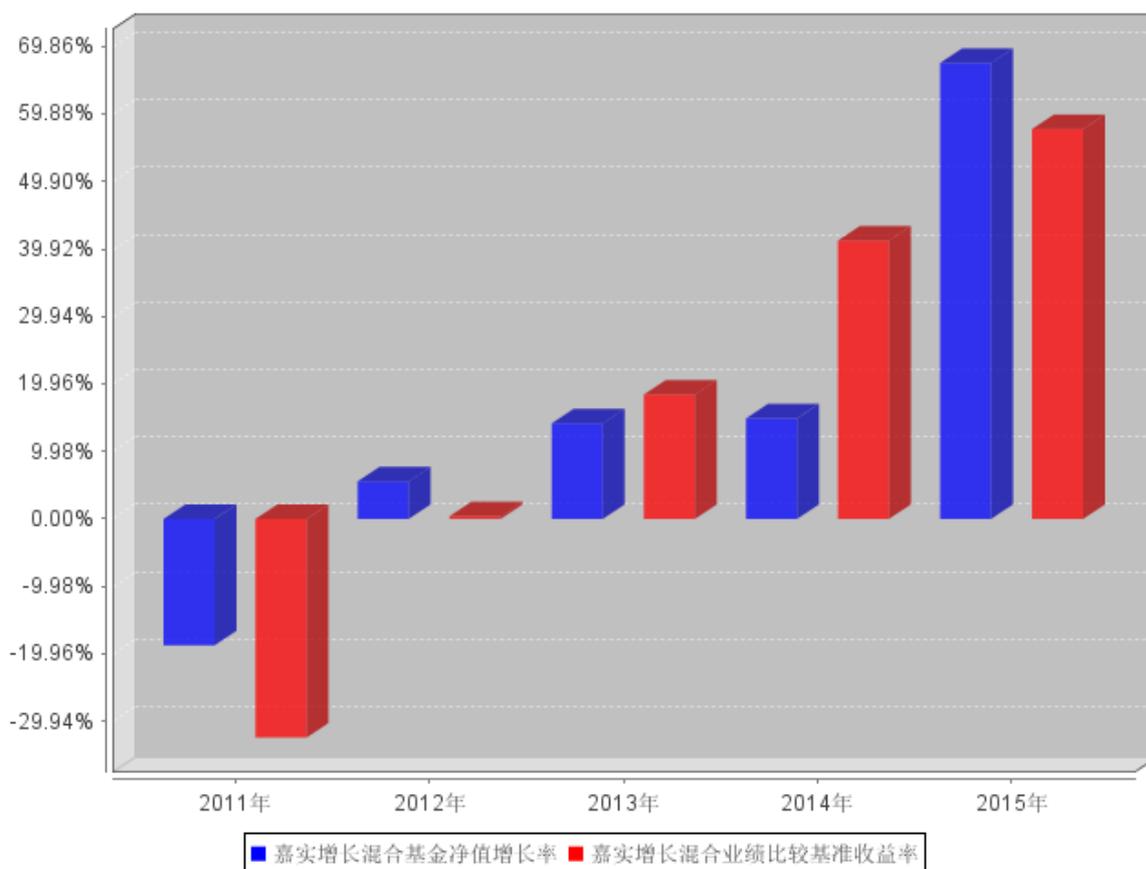
注 1：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第三部分（四（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（5）本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

注 2：2015 年 7 月 8 日，本基金管理人发布《关于嘉实增长混合基金经理变更的公告》，邵健先生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。

注 3：2015 年 12 月 31 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实增长混合基金经理的公告》，增聘刘美玲女士担任本基金基金经理职务，与基金经理董理先生共同管理本基金。

### 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

嘉实增长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

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	0.1000	1,402,813.56	3,072,956.74	4,475,770.30	
2014	0.1000	2,247,121.20	4,275,845.19	6,522,966.39	
2013	0.1000	3,366,758.59	5,556,088.20	8,922,846.79	
合计	0.3000	7,016,693.35	12,904,890.13	19,921,583.48	

## § 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		
刘美玲	本基金基金经理	2015 年 12 月 31 日	-	11 年	2004 年 6 月加入嘉实基金，先后在研究部、投资部工作，并担任过研究部能源组组长、投

					资经理职务。具有基金从业资格。
董理	本基金基金经理，嘉实优化红利混合、嘉实创新成长混合基金经理	2015年7月8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。
邵健	本基金基金经理、公司副总经理	2010年6月8日	2015年7月8日	17年	曾任国泰君安证券研究所研究员、行业投资策略组组长、行业公司部副经理，从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003年7月加入嘉实基金管理有限公司投资部工作。经济学硕士，具有基金从业资格、中国国籍。

注：（1）任职日期、离任日期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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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 67.43% 的收益，作为股票上限 75% 的混合型基金，大幅战胜市场。

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，选股上重仓持有优质的成长股比如乐视网、启明星辰等。这些个股为组合贡献了巨大的收益。在 6 月开始的调整中，由于市场成交量萎靡，组合被动出现了较大幅度的回调，在市场成交量恢复后，组合积极调整了持仓，增加了更多相对稳健的成长股，使得组合的流动性得到了较为明显的改善。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 10.046 元；本报告期基金份额净值增长率为 67.43%，业绩比较基准收益率为 57.66%。

#### 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，回归对资本市场影响最直接的企业盈利和流动性两大要素，我们认为 2016 年资本市场将面临更多的考验。过往不断的需求端刺激已经无法为继，2016 年中央经济工作会议核心的基调是供给侧改革，我们即将迎来改革真正深入的一年，过程中会经历阵痛，经历经济增速的放缓以及企业盈利增长的承压。流动性方面，相比 2015 年的大水漫灌，2016 年继续降准降息的空间在缩窄，资本市场的资金净流入显著弱于 2015 年。虽然当前市场上大市值权重股估值偏低，但大多数个股估值都处于较高水平。2016 年的 A 股市场格局正如经济格局一样，不破不立，需要等待泡沫的消纳和企业盈利的支撑，系统性向上机会才会逐步显现。

虽然对年初的市场行情相对谨慎，但我们相信仍然会有优秀的公司穿越经济周期实现快速增长和良好回报，尤其当市场真正兑现了下跌预期、部分股票逐步进入估值合理区间后，需要我们以更乐观的心态，积极寻找个股机会、优化组合结构。转型和创新是长期的主线，在未来的行业与主题方面，我们认为云计算与大数据、先进制造、大安全等都是值得关注的方面。同时我们也会适当关注改革带来价值股的阶段性机会。在新的一年里，我们将进一步努力发掘具备巨大成长空间与较高估值吸引力的细分行业和龙头个股，力争继续为投资人获取良好的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。重点支持创新业务和新产品拓展。创新是公司永恒的主题，同时应有效防控风险，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则的创新，使之更加符合投资者需求。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查(包括各类产品及业务)，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 19 日发布《嘉实增长开放式证券投资基金 2014 年年度收益分配公告》，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 0.100 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 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实增长开放式证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.10 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。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。

#### 4.9 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”）在嘉实增长开放式证券投资基金（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

安永华明（2016）审字第 60468756\_A03 号

嘉实增长开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实增长开放式证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

#### 一、基金管理人对于财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人嘉实基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

## 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实增长开放式证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师 汤 骏

中国 北京

中国注册会计师 贺 耀

2016 年 3 月 18 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实增长开放式证券投资基金

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	457,611,730.57	5,167,359.98
结算备付金		6,094,023.15	4,138,632.53
存出保证金		1,080,182.30	725,534.24
交易性金融资产	7.4.7.2	2,665,018,515.26	2,606,808,582.44
其中：股票投资		1,996,715,608.46	1,961,913,103.24
基金投资		-	-
债券投资		668,302,906.80	644,895,479.20
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		2,126,284.19	185,623,662.26
应收利息	7.4.7.5	17,892,842.32	15,632,297.83
应收股利		-	-
应收申购款		1,471,159.41	247,392.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,151,294,737.20	2,818,343,462.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 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		120,224,109.98	-
应付赎回款		6,363,829.33	15,954,991.37
应付管理人报酬		3,971,042.09	3,757,220.24
应付托管费		661,840.35	626,203.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,261,486.86	1,741,013.47
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	418,827.55	419,248.66
负债合计		134,901,136.16	22,498,677.13
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	300,248,211.86	465,305,408.74
未分配利润	7.4.7.10	2,716,145,389.18	2,330,539,376.26
所有者权益合计		3,016,393,601.04	2,795,844,785.00
负债和所有者权益总计		3,151,294,737.20	2,818,343,462.13

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 10.046 元，基金份额总额 300,248,211.86 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实增长开放式证券投资基金

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>		1,893,926,280.94	485,956,615.45
1. 利息收入		27,681,760.73	30,196,568.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,455,448.16	1,059,867.23
债券利息收入		26,156,978.26	28,537,056.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		69,334.31	599,645.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		1,972,403,206.73	621,231,762.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,969,724,187.26	577,675,394.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,666,954.82	24,327,948.75
资产支持证券投资		-	-
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	7,345,974.29	19,228,420.00
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-107,315,982.64	-167,630,438.89
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	1,157,296.12	2,158,722.54
<b>减：二、费用</b>		72,531,367.25	64,306,231.00
1. 管理人报酬		46,258,643.92	45,896,384.67
2. 托管费		7,709,774.01	7,649,397.44
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	18,326,192.56	9,285,822.40
5. 利息支出		-	1,244,815.01
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,244,815.01
6. 其他费用	7.4.7.19	236,756.76	229,811.48
<b>三、利润总额</b>		1,821,394,913.69	421,650,384.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		1,821,394,913.69	421,650,384.45

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实增长开放式证券投资基金

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）	465,305,408.74	2,330,539,376.26	2,795,844,785.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,821,394,913.69	1,821,394,913.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-165,057,196.88	-1,431,313,130.47	-1,596,370,327.35
其中：1. 基金申购款	163,297,827.84	1,351,166,472.44	1,514,464,300.28
2. 基金赎回款	-328,355,024.72	-2,782,479,602.91	-3,110,834,627.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-4,475,770.30	-4,475,770.30
五、期末所有者权益（基金净值）	300,248,211.86	2,716,145,389.18	3,016,393,601.04
	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
项目	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）	658,440,923.12	2,792,422,700.67	3,450,863,623.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	421,650,384.45	421,650,384.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-193,135,514.38	-877,010,742.47	-1,070,146,256.85
其中：1. 基金申购款	62,705,090.99	270,087,301.81	332,792,392.80
2. 基金赎回款	-255,840,605.37	-1,147,098,044.28	-1,402,938,649.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-6,522,966.39	-6,522,966.39
五、期末所有者权益（基金净值）	465,305,408.74	2,330,539,376.26	2,795,844,785.00

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  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王红  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
常旭  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)、嘉实稳健开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 945,335,227.25 份基金单位。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的中、小市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场后 50%的上市公司中寻找具有高速成长潜力的中、小市值上市公司，投资于中、小市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。本基金的业绩比较基准为：60%\*巨潮 500(小盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，

同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认, 并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失) 系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方, 经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购证券支出, 按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的, 则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或再投资方式, 投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资, 未选择分红方式的基金份额持有人的分红方式为现金红利;

(2) 每一基金单位享有同等分配权;

(3) 基金当期收益先弥补上期亏损后, 方可进行当期收益分配;

(4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值;

(5) 如果基金当期出现亏损, 则不进行收益分配;

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行;

(7) 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益分配每年至少一次, 成立不满三个月, 收益可不分配; 年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成;

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定,自 2015 年 3 月 31 日起,交易所上市交易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)采用中证指数有限公司提供的估值数据进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	457,611,730.57	5,167,359.98
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	457,611,730.57	5,167,359.98

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,841,410,753.49	1,996,715,608.46	155,304,854.97
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	56,878,194.30	-581,287.50
	银行间市场	611,225,338.80	780,661.20
	合计	668,103,533.10	199,373.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,509,514,286.59	2,665,018,515.26	155,504,228.67
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,714,352,930.86	1,961,913,103.24	247,560,172.38
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,810,730.27	15,895,748.93
	银行间市场	589,824,710.00	-635,710.00
	合计	629,635,440.27	15,260,038.93
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,343,988,371.13	2,606,808,582.44	262,820,211.31

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	50,334.21	5,381.13
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,742.30	1,862.40
应收债券利息	17,839,220.82	15,624,687.67
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	58.89	40.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	486.10	326.50
合计	17,892,842.32	15,632,297.83

## 7.4.7.6 其他资产

本期末（2015年12月31日）及上年度末（2014年12月31日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,260,536.86	1,737,502.99
银行间市场应付交易费用	950.00	3,510.48
合计	3,261,486.86	1,741,013.47

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	8,827.55	9,248.66
预提费用	160,000.00	160,000.00
应付指数使用费	-	-
其他	-	-
合计	418,827.55	419,248.66

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	465,305,408.74	465,305,408.74
本期申购	163,297,827.84	163,297,827.84
本期赎回	-328,355,024.72	-328,355,024.72
本期末	300,248,211.86	300,248,211.86

注：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,596,428,955.84	-265,889,579.58	2,330,539,376.26
本期利润	1,928,710,896.33	-107,315,982.64	1,821,394,913.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,101,406,058.67	-329,907,071.80	-1,431,313,130.47
其中：基金申购款	1,638,008,392.85	-286,841,920.41	1,351,166,472.44
基金赎回款	-2,739,414,451.52	-43,065,151.39	-2,782,479,602.91
本期已分配利润	-4,475,770.30	-	-4,475,770.30
本期末	3,419,258,023.20	-703,112,634.02	2,716,145,389.18

## 7.4.7.11 存款利息收入

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
	活期存款利息收入	1,347,765.51
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	74,361.05	38,882.81
其他	33,321.60	11,652.30
合计	1,455,448.16	1,059,867.23

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015	上年度可比期间 2014年1月1日至2014

	年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,605,835,221.54	3,789,343,853.63
减：卖出股票成本总额	5,636,111,034.28	3,211,668,459.41
买卖股票差价收入	1,969,724,187.26	577,675,394.22

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,569,571,444.55	778,213,092.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,530,976,280.20	736,858,407.68
减：应收利息总额	43,262,119.17	17,026,736.35
买卖债券差价收入	-4,666,954.82	24,327,948.75

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

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），本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	7,345,974.29	19,228,420.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,345,974.29	19,228,420.00

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-107,315,982.64	-167,630,438.89
——股票投资	-92,255,317.41	-193,682,807.82
——债券投资	-15,060,665.23	26,052,368.93
——资产支持证券投资	-	-

——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-107,315,982.64	-167,630,438.89

#### 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	766,247.55	292,465.09
基金转出费收入	391,048.57	28,802.12
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	1,837,455.33
合计	1,157,296.12	2,158,722.54

#### 7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	18,316,997.56	9,281,497.40
银行间市场交易费用	9,195.00	4,325.00
合计	18,326,192.56	9,285,822.40

#### 7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行划款手续费	40,106.76	33,411.48
指数使用费	-	-
上市年费	-	-

红利手续费	-	-
其他	650.00	400.00
合计	236,756.76	229,811.48

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2016年1月15日，本基金管理人发布《嘉实增长开放式证券投资基金2015年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2015年12月31日，权益登记日、除息日为2016年1月18日，红利发放日为2016年1月19日，收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.100元。

#### 7.4.9 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

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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	46,258,643.92	45,896,384.67
其中：支付销售机构的客户维护费	4,878,379.05	5,068,749.88

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 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	7,709,774.01	7,649,397.44

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 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	-	187,439,621.92	-	-	-	-

注：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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固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），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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	457,611,730.57	1,347,765.51	5,167,359.98	1,009,332.12

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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 1 月 21 日	-	2015 年 1 月 21 日	0.1000	1,402,813.56	3,072,956.74	4,475,770.30	2014 年年度收益分配于 2015 年实施
合计	-	-	-	0.1000	1,402,813.56	3,072,956.74	4,475,770.30	

注：2016 年 1 月 15 日，本基金管理人发布《嘉实增长开放式证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，权益登记日、除息日为 2016 年 1 月 18 日，红利发放日为 2016 年 1 月 19 日，收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.100 元。

**7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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。

**7.4.12.2 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	-	-	800,000	49,286,415.59	55,744,000.00	-
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	4,499,995	86,203,474.11	79,244,911.95	-
002020	京新药业	2015年12月29日	重大事项停牌	33.55	2016年1月20日	30.20	3,354,357	91,443,668.31	112,538,677.35	-
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	1,427,950	95,352,810.76	90,274,999.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和

工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风

险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	457,611,730.57	-	-	-	457,611,730.57
结算备付金	6,094,023.15	-	-	-	6,094,023.15
存出保证金	1,080,182.30	-	-	-	1,080,182.30
交易性金融资产	602,561,154.40	60,562,051.30	5,179,701.10	1,996,715,608.46	2,665,018,515.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,126,284.19	2,126,284.19
应收利息	-	-	-	17,892,842.32	17,892,842.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	143,937.17	-	-	1,327,222.24	1,471,159.41
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,067,491,027.59	60,562,051.30	5,179,701.10	2,018,061,957.21	3,151,294,737.20
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	120,224,109.98	120,224,109.98
应付赎回款	-	-	-	6,363,829.33	6,363,829.33
应付管理人报酬	-	-	-	3,971,042.09	3,971,042.09
应付托管费	-	-	-	661,840.35	661,840.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,261,486.86	3,261,486.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	418,827.55	418,827.55
负债总计	-	-	-	134,901,136.16	134,901,136.16

利率敏感度缺口	1,067,491,027.59	60,562,051.30	5,179,701.10	1,883,160,821.05	3,016,393,601.04
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,167,359.98	-	-	-	5,167,359.98
结算备付金	4,138,632.53	-	-	-	4,138,632.53
存出保证金	725,534.24	-	-	-	725,534.24
交易性金融资产	644,895,479.20	-	-	1,961,913,103.24	2,606,808,582.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	185,623,662.26	185,623,662.26
应收利息	-	-	-	15,632,297.83	15,632,297.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	71,236.61	-	-	176,156.24	247,392.85
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	654,998,242.56	-	-	2,163,345,219.57	2,818,343,462.13
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	15,954,991.37	15,954,991.37
应付管理人报酬	-	-	-	3,757,220.24	3,757,220.24
应付托管费	-	-	-	626,203.39	626,203.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,741,013.47	1,741,013.47
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	419,248.66	419,248.66
负债总计	-	-	-	22,498,677.13	22,498,677.13
利率敏感度缺口	654,998,242.56	-	-	-2,140,846,542.44	2,795,844,785.00

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；

	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	794,678.64	363,999.49
市场利率上升 25 个基点	-790,389.01	-363,396.76	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。于 2015 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,996,715,608.46	66.20	1,961,913,103.24	70.17
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,996,715,608.46	66.20	1,961,913,103.24	70.17

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	127,562,526.37	96,705,763.02
	业绩比较基准下降 5%	-127,562,526.37	-96,705,763.02

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金和存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 1,658,913,020.16 元，属于第二层次的余额为人民币 1,006,105,495.10 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次的余额为人民币 1,826,110,179.97 元，第二层次的余额为人民币 780,698,402.47 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 31 日起，交易所上市交易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）采用中证指数有限公司提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情

况（上年度：无）。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	1,996,715,608.46	63.36
	其中：股票	1,996,715,608.46	63.36
2	固定收益投资	668,302,906.80	21.21
	其中：债券	668,302,906.80	21.21
	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	463,705,753.72	14.71
7	其他各项资产	22,570,468.22	0.72
	合计	3,151,294,737.20	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	150,316,766.25	4.98
B	采矿业	58,182,936.00	1.93
C	制造业	806,813,051.38	26.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	184,233,053.10	6.11
F	批发和零售业	419,393,525.52	13.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	239,595,915.20	7.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	57,099,680.24	1.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	81,080,680.77	2.69
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,996,715,608.46	66.20

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	3,308,767	271,186,543.32	8.99
2	600477	杭萧钢构	14,978,297	184,233,053.10	6.11
3	000998	隆平高科	6,329,127	150,316,766.25	4.98
4	002439	启明星辰	4,665,570	149,298,240.00	4.95
5	300362	天保重装	1,919,832	116,572,199.04	3.86
6	002020	京新药业	3,354,357	112,538,677.35	3.73
7	603001	奥康国际	3,143,163	105,673,140.06	3.50
8	002049	同方国芯	1,427,950	90,274,999.00	2.99
9	002563	森马服饰	7,248,739	89,884,363.60	2.98
10	002253	川大智胜	1,680,544	89,572,995.20	2.97
11	300012	华测检测	3,297,303	81,080,680.77	2.69
12	000876	新希望	4,499,995	79,244,911.95	2.63
13	300385	雪浪环境	1,592,300	74,455,948.00	2.47
14	000501	鄂武商A	2,959,803	63,339,784.20	2.10
15	300004	南风股份	2,245,861	59,717,443.99	1.98
16	600547	山东黄金	2,770,616	58,182,936.00	1.93
17	000882	华联股份	9,999,944	57,099,680.24	1.89

18	600687	刚泰控股	2,399,869	56,588,911.02	1.88
19	000028	国药一致	800,000	55,744,000.00	1.85
20	000652	泰达股份	4,084,600	29,123,198.00	0.97
21	000401	冀东水泥	1,401,100	15,271,990.00	0.51
22	601992	金隅股份	602,601	5,646,371.37	0.19
23	000932	华菱钢铁	289,600	944,096.00	0.03
24	002368	太极股份	10,800	724,680.00	0.02

## 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	308,302,685.59	11.03
2	000963	华东医药	230,697,491.28	8.25
3	600477	杭萧钢构	187,281,597.84	6.70
4	300004	南风股份	185,269,998.83	6.63
5	002400	省广股份	168,462,606.72	6.03
6	601166	兴业银行	166,005,914.44	5.94
7	300133	华策影视	164,168,963.99	5.87
8	002439	启明星辰	152,308,900.61	5.45
9	000651	格力电器	152,169,537.31	5.44
10	000333	美的集团	131,004,366.58	4.69
11	300012	华测检测	126,575,442.92	4.53
12	000820	金城股份	117,729,276.75	4.21
13	300362	天保重装	103,138,479.17	3.69
14	600547	山东黄金	102,051,329.02	3.65
15	002086	东方海洋	101,316,347.88	3.62
16	601888	中国国旅	96,582,443.26	3.45
17	002049	同方国芯	95,352,810.76	3.41
18	600856	中天能源	94,586,641.16	3.38
19	002020	京新药业	91,443,668.31	3.27
20	002253	川大智胜	89,553,842.64	3.20
21	300054	鼎龙股份	88,906,040.15	3.18
22	002563	森马服饰	86,764,517.57	3.10
23	601398	工商银行	86,458,717.87	3.09

24	000876	新希望	86,203,474.11	3.08
25	000488	晨鸣纸业	78,717,605.46	2.82
26	300379	东方通	78,034,830.17	2.79
27	603001	奥康国际	74,630,531.52	2.67
28	300385	雪浪环境	72,061,261.83	2.58
29	601288	农业银行	71,186,631.55	2.55
30	600037	歌华有线	67,735,879.38	2.42
31	300369	绿盟科技	66,890,545.68	2.39
32	300359	全通教育	66,169,247.14	2.37
33	600962	*ST中鲁	65,196,836.44	2.33
34	000882	华联股份	63,226,836.01	2.26
35	300465	高伟达	59,898,027.00	2.14
36	002331	皖通科技	59,388,857.95	2.12

#### 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	002439	启明星辰	455,250,629.38	16.28
2	300104	乐视网	443,194,280.26	15.85
3	600446	金证股份	331,972,631.66	11.87
4	000651	格力电器	224,764,099.04	8.04
5	002450	康得新	206,944,658.88	7.40
6	600570	恒生电子	201,048,692.71	7.19
7	002400	省广股份	197,851,356.15	7.08
8	300133	华策影视	195,433,948.54	6.99
9	300004	南风股份	184,731,753.53	6.61
10	300359	全通教育	178,773,017.60	6.39
11	000820	金城股份	178,589,368.20	6.39
12	601166	兴业银行	163,604,128.84	5.85
13	300253	卫宁软件	153,188,618.79	5.48
14	000998	隆平高科	150,538,148.48	5.38
15	300369	绿盟科技	145,057,950.23	5.19
16	000333	美的集团	130,459,972.67	4.67
17	300377	赢时胜	127,846,088.60	4.57
18	002086	东方海洋	127,832,166.76	4.57

19	002081	金螳螂	124,494,804.59	4.45
20	300378	鼎捷软件	111,703,004.04	4.00
21	600525	长园集团	89,843,790.25	3.21
22	000401	冀东水泥	89,659,445.38	3.21
23	601398	工商银行	88,989,488.30	3.18
24	600037	歌华有线	88,635,728.12	3.17
25	000488	晨鸣纸业	88,233,719.50	3.16
26	002085	万丰奥威	83,274,556.46	2.98
27	601888	中国国旅	83,111,231.00	2.97
28	600856	中天能源	82,793,958.26	2.96
29	300054	鼎龙股份	81,432,111.57	2.91
30	601006	大秦铁路	76,364,737.16	2.73
31	300274	阳光电源	73,942,859.38	2.64
32	601288	农业银行	72,205,837.18	2.58
33	600000	浦发银行	70,521,862.35	2.52
34	000028	国药一致	66,748,313.10	2.39
35	002338	奥普光电	66,593,577.72	2.38
36	600079	人福医药	63,455,165.13	2.27
37	300379	东方通	56,225,610.87	2.01
38	601318	中国平安	55,989,342.85	2.00

#### 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	5,763,168,856.91
卖出股票收入（成交）总额	7,605,835,221.54

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	5,179,701.10	0.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	663,123,205.70	21.98
	其中：政策性金融债	663,123,205.70	21.98
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	668,302,906.80	22.16

## 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	150311	15 进出 11	1,400,000	140,140,000.00	4.65
2	150202	15 国开 02	1,300,000	130,156,000.00	4.31
3	150211	15 国开 11	900,000	90,261,000.00	2.99
3	150411	15 农发 11	900,000	90,261,000.00	2.99
4	150301	15 进出 01	500,000	50,045,000.00	1.66
5	150201	15 国开 01	400,000	40,992,000.00	1.36

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	1,080,182.30
2	应收证券清算款	2,126,284.19
3	应收股利	-
4	应收利息	17,892,842.32
5	应收申购款	1,471,159.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	22,570,468.22

### 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	002020	京新药业	112,538,677.35	3.73	重大事项停牌
2	002049	同方国芯	90,274,999.00	2.99	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 (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
94,025	3,193.28	39,899,270.93	13.29%	260,348,940.93	86.71%

## 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	150,651.82	0.05%

## 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月9日）基金份额总额	945,335,227.25
本报告期期初基金份额总额	465,305,408.74
本报告期基金总申购份额	163,297,827.84
减：本报告期基金总赎回份额	328,355,024.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	300,248,211.86

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7月8日，本基金管理人发布《关于嘉实增长混合基金经理变更的公告》，邵健先生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。

2015年12月31日，本基金管理人发布《关于新增嘉实增长混合基金经理的公告》，增聘刘美玲女士担任本基金基金经理，与董理先生共同管理本基金。

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。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 70,000.00 元，该审计机构已连续 13 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

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
海通证券股份有限公司		22,274,907,174.15	17.02%	1,592,451.03	17.01%	-
中信建投证券		21,790,058,180.64	13.39%	1,253,050.56	13.38%	-

股份有限公司						
兴业证券股份 有限公司	3	1,635,896,459.01	12.24%	1,145,132.97	12.23%	-
中国国际金融 有限公司	2	1,502,080,902.56	11.24%	1,051,461.37	11.23%	-
广发证券股份 有限公司	5	859,567,842.84	6.43%	601,703.63	6.43%	-
申万宏源证券 有限公司	2	736,356,967.67	5.51%	515,451.58	5.51%	-
方正证券股份 有限公司	3	626,258,994.76	4.68%	442,036.45	4.72%	-
东方证券股份 有限公司	4	613,735,510.40	4.59%	429,617.73	4.59%	新增 2 个
国泰君安证券 股份有限公司	4	591,093,589.46	4.42%	413,768.37	4.42%	-
安信证券股份 有限公司	3	381,988,676.95	2.86%	267,392.06	2.86%	-
齐鲁证券有限 公司	1	381,806,596.25	2.86%	267,267.88	2.85%	-
招商证券股份 有限公司	2	329,428,903.49	2.46%	230,602.24	2.46%	-
中信证券股份 有限公司	3	314,410,603.36	2.35%	220,089.48	2.35%	-
新时代证券有 限责任公司	1	277,392,580.40	2.07%	194,174.80	2.07%	-
长江证券股份 有限公司	1	272,433,718.99	2.04%	190,706.73	2.04%	-
东北证券股份 有限公司	2	248,843,618.90	1.86%	174,191.95	1.86%	-
国元证券股份 有限公司	1	150,429,333.99	1.13%	105,300.53	1.12%	-
华创证券有限 责任公司	2	139,304,072.67	1.04%	97,514.32	1.04%	-
国金证券股份 有限公司	2	94,297,398.74	0.71%	66,008.18	0.71%	-
瑞银证券有限 责任公司	1	74,439,769.33	0.56%	52,107.83	0.56%	-
光大证券股份 有限公司	1	73,954,162.89	0.55%	51,767.93	0.55%	-
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	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 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 有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额 的比例
广发证券股份 有限公司	103,923,294.70	25.85%	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	36,879,190.00	9.17%	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	261,280,732.10	64.98%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	嘉实增长开放式证券投资基金 2014 年年度收益分配公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 1 月 19 日
2	关于增加江南农商行为嘉实旗下 基金代销机构并开展定投业务的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 1 月 21 日
3	关于增加天风证券为嘉实旗下基 金代销机构并开展定投业务的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 1 月 26 日
4	嘉实基金管理有限公司关于对华 夏银行借记卡持卡人开通嘉实直 销网上交易在线支付业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 2 月 2 日
5	关于增加众禄基金为嘉实旗下基 金代销机构并开展定投业务的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 2 月 10 日
6	嘉实基金管理有限公司关于降低 旗下部分开放式基金电话交易申 购、赎回单笔最低要求及最低账 面份额的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 2 月 12 日
7	关于对上海银行借记卡持卡人开 通嘉实直销网上交易在线支付业 务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 3 月 5 日
8	中国农业银行关于开放式基金网 上银行、手机银行申购费率优惠 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 6 月 1 日
9	嘉实基金管理有限公司关于降低 旗下部分开放式基金申购、赎回、 转换及最低账面份额单笔最低要 求的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2015 年 6 月 25 日

10	嘉实基金管理有限公司关于在直销自有平台（含电话交易）开展转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 6 月 29 日
11	关于嘉实增长混合基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 8 日
12	嘉实增长开放式证券投资基金恢复申购（含转入）及定投业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 8 日
13	嘉实基金管理有限公司关于在平安证券有限责任公司前端申购费用基金产品的申购、定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 20 日
14	关于变更嘉实稳健、嘉实增长业绩比较基准并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 30 日
15	嘉实基金管理有限公司关于在第一创业证券股份有限公司交易系统网上申购费率优惠（含定投）活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 3 日
16	关于工商银行开办嘉实旗下基金日常转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 5 日
17	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展 0 折费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 14 日
18	关于增加诺亚正行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加诺亚正行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 19 日

19	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金在中金公司所有渠道实施申购费率优惠（不含转入、定投）的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年8月24日
20	关于增加上海汇付为嘉实旗下基金代销机构及参加上海汇付费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年8月24日
21	于增加上海陆金所资产管理有限公司为嘉实旗下基金代销机构及参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年9月1日
22	关于增加成都农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年9月24日
23	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金在华宝证券网上、手机端等非现场交易方式实施申购费率优惠（含定投、不含转入）的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年9月30日
24	关于增加盈米财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年10月16日
25	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金在西南证券通过所有代销渠道实施申购费率优惠（含定投、转入）的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年11月2日
26	关于增加中经北证为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015年11月6日
27	嘉实基金管理有限公司关于在京	中国证券报、上海证	2015年12月4日

	东店铺开展 0 折费率优惠活动的公告	券报、证券时报、管理人网站	
28	关于增加贵阳银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 4 日
29	关于增加乐清农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加乐清农商行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 10 日
30	关于增加威海市商业银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 14 日
31	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 16 日
32	关于增加泉州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 21 日
33	关于新增嘉实增长混合基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金托管协议》；

- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财通系列开放式证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 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

## 12.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 3 月 29 日