

嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	43
7.7 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.....	43
7.8 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.....	44
7.9 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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44

§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 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.....	45
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	嘉实新机遇混合发起式
基金主代码	001620
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月13日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,010,000,000.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300*50%+中债总指数*50%
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，属于较高风险、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	洪渊
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010) 66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市建国门北大街8号	北京市西城区复兴门内大街55

	华润大厦 8 层	号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	邓红国	易会满

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	776,120,564.64
本期利润	-3,745,900,734.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1090
本期加权平均净值利润率	-11.61%
本期基金份额净值增长率	-8.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,238,274,401.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0309
期末基金资产净值	38,771,725,598.12
期末基金份额净值	0.969
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.10%

注（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）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
过去一个月	2.22%	1.01%	0.09%	0.49%	2.13%	0.52%
过去三个月	1.36%	1.02%	-0.72%	0.51%	2.08%	0.51%
过去六个月	-8.84%	1.42%	-6.85%	0.92%	-1.99%	0.50%
自基金合同生效起至今	-3.10%	1.43%	-8.51%	1.08%	5.41%	0.35%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300×50%+中债总指数×50%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势，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：

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

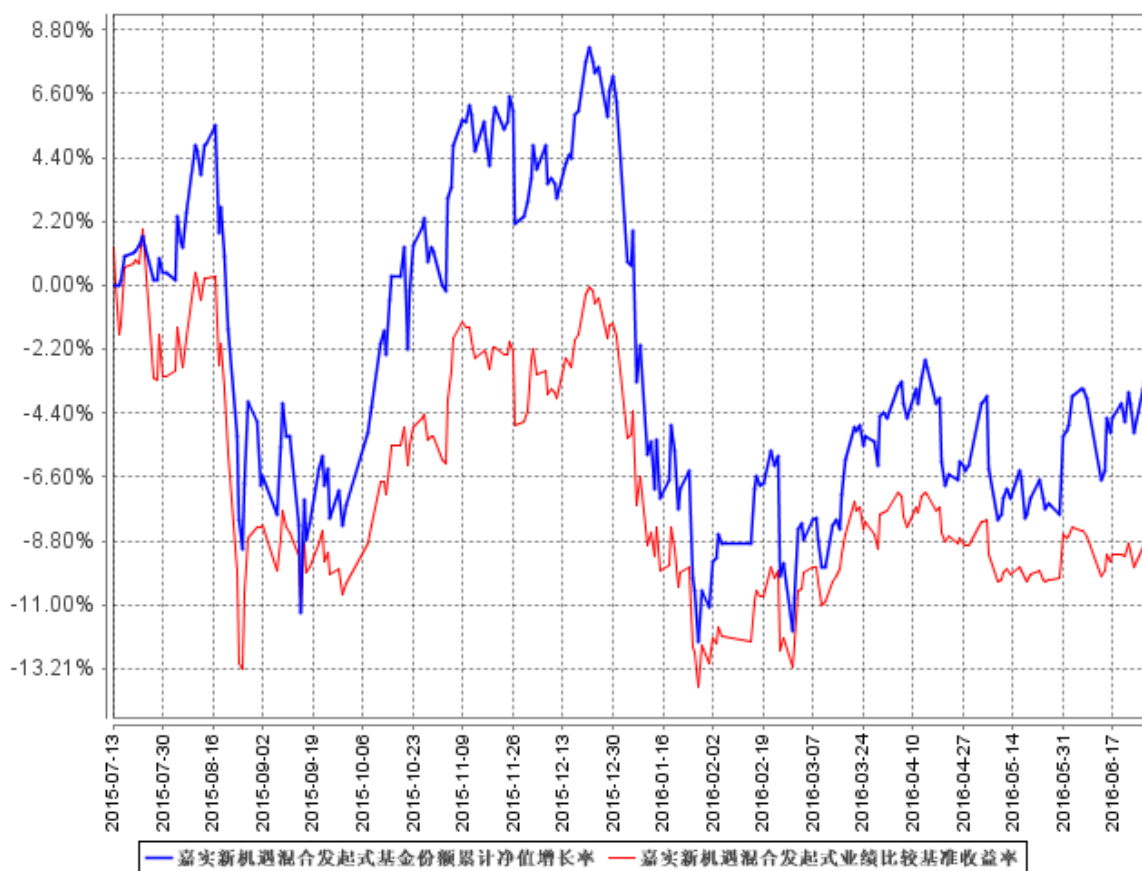
$$\text{Return}(t)=50\%*\text{沪深 300 指数}(t)/\text{沪深 300 指数}(t-1)-1)+50%*(\text{中国债券总指数}(t)/\text{中国债券总指数}(t-1)-1)$$

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

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

嘉实新机遇混合发起式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：嘉实新机遇混合发起式基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

(2015年7月13日至2016年6月30日)

注：本基金基金合同生效日2015年7月13日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 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、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯

债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。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		
王茜	本基金、嘉实多元债券、嘉实多利分级债券、嘉实新起点混合、嘉实新起航混合基金经理、公司固定收益业务体系配置策略组组长。	2015年7月13日	-	13年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理，中信证券固定收益部，长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008年11月加盟嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系配置策略组组长。工商管理硕士，具有基金从业资格，中国国籍。
谢泽林	本基金、嘉实成长收益混合基金经理	2015年9月10日	-	6年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部，曾任行业研究员一职。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）基金经理王茜的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理谢泽林的任职日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 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

国内经济弱复苏在二季度逐步被证伪，经济增速贴地运行，民间投资失速，通胀预期减弱，A 股市场年初经历大幅下跌之后维持低位震荡。但另一方面，新兴产业仍保持蓬勃发展的态势，如集成电路、新能源汽车、军工信息化、小间距 LED 显示、人工智能等，经济呈现结构性机会，A 股市场也相应呈现结构性机会，上述新兴产业的股票表现相对较好。除此以外，传统产业如养殖、黄金由于价格上涨带来板块的阶段性机会，传统产业中一些业绩持续增长、估值相对较低的优质企业，股价表现也相对较好。

本基金坚持在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置、选择安全边际较高和流动性较好的个股，力争实现基金资产的长期稳健增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.969 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.84%，业绩比较基准收益率为-6.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增速预计维持平稳，民间投资增速虽下降、政府投资可能会更加积极，但整体加杆杠的空间不大。经济增长的主要内生动力，一方面来自新兴产业的持续拉动，另一方面需要改革的进一步推进。下半年 A 股市场整体可能以震荡行情为主，但预计仍不缺乏结构性机会。

中国正处于从中等收入国家向中高收入国家发展的过程中，技术创新、产业升级、消费升级等层出不穷，这个过程会不断诞生新蓝筹。我们通过不断的深度研究和调研，积极寻找新兴产业中具备核心技术的优质企业、理想远大的优秀企业家，以期获得较好的中长期投资回报。

我们关注国家对改革的进一步推进，改革将带来垄断利润的进一步释放，将带来经济效率的进一步提升。国企改革、供给侧改革，特别是国有的科技企业混改，将带来投资机会。我们也关注传统产业中一些景气底部反转的行业，把握阶段性的博弈机会。

鉴于今年震荡的行情，我们的选股会遵循更加严格的标准，在股票仓位上会更加灵活把握，争取为投资人实现更好的投资回报。

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、合规部等部门负责人组成，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) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-3,745,900,734.61 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-1,238,274,401.88 元、“期末可供分配基金份额利润”为-0.0309 元，“期末基金份额净值”为 0.969 元，以及本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）“3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定，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，本基金托管人在对嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,171,908,180.82	4,330,869,131.13
结算备付金		247,670,952.38	857,142,857.14
存出保证金		990,228.14	8,126,965.09
交易性金融资产	6.4.7.2	21,832,860,329.20	27,318,985,173.09
其中：股票投资		20,203,536,329.20	27,315,637,273.09
基金投资		-	-
债券投资		1,629,324,000.00	3,347,900.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,491,717,608.60	10,000,000,000.00
应收证券清算款		542,866.94	1,865,807.68
应收利息	6.4.7.5	27,282,230.24	2,553,183.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		38,772,972,396.32	42,519,543,117.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		1,092,874.50	1,786,784.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,608.60	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	139,315.10	130,000.00
负债合计		1,246,798.20	1,916,784.79
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-1,238,274,401.88	2,507,626,332.73
所有者权益合计		38,771,725,598.12	42,517,626,332.73
负债和所有者权益总计		38,772,972,396.32	42,519,543,117.52

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.969 元，基金份额总额 40,010,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		-3,734,363,620.24
1.利息收入		127,831,655.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,230,048.52
债券利息收入		13,689,693.19
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		78,911,913.31
其他利息收入		-
2.投资收益		644,161,023.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	444,405,511.20
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	479,565.84
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	199,275,946.95
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-4,522,021,299.25
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.17	15,665,000.00
减：二、费用		11,537,114.37
1. 管理人报酬		-
2. 托管费		8,058,456.86
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,340,527.35
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	138,130.16
三、利润总额		-3,745,900,734.61
减：所得税费用		-
四、净利润		-3,745,900,734.61

注：本基金合同生效日为2015年7月13日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	40,010,000,000.00	2,507,626,332.73	42,517,626,332.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,745,900,734.61	-3,745,900,734.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-468,000,000.00	-468,000,000.00
2.基金赎回款	-	468,000,000.00	468,000,000.00
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)	40,010,000,000.00	-1,238,274,401.88	38,771,725,598.12

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 13 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1393号《关于准予嘉实新机遇灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会证监许可[2015]1584号《关于准予嘉实新机遇灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集共募集40,010,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第920号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为40,010,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、大额存单、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。业绩比较基准为沪深 300 X 50% + 中债总指数 X 50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	1,171,908,180.82

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,171,908,180.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	22,372,356,492.86	20,203,536,329.20	-2,168,820,163.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,629,946,960.00	1,629,324,000.00	-622,960.00
	合计	1,629,946,960.00	1,629,324,000.00	-622,960.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	24,002,303,452.86	21,832,860,329.20	-2,169,443,123.66	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产款	12,491,717,608.60	-
交易所市场买入返售金融资产款	3,000,000,000.00	-
合计	15,491,717,608.60	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	500,661.50
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	100,306.71
应收债券利息	23,455,387.98
应收买入返售证券利息	3,225,473.01
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	401.04
合计	27,282,230.24

6.4.7.6 其他资产

本期末（2016年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	14,608.60
合计	14,608.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	139,315.10
应付指数使用费	-
其他	-
合计	139,315.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00

6.4.7.10 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	155,048,157.14	2,352,578,175.59	2,507,626,332.73
本期利润	776,120,564.64	-4,522,021,299.25	-3,745,900,734.61
本期基金份额交易产生的变动数	167,422,142.67	-167,422,142.67	-
其中：基金申购款	347,190,115.36	-815,190,115.36	-468,000,000.00
基金赎回款	-179,767,972.69	647,767,972.69	468,000,000.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,098,590,864.45	-2,336,865,266.33	-1,238,274,401.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	2,255,555.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,344,134.28
其他	25,989.00
合计	35,230,048.52

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	2,619,795,025.17
买卖股票差价收入	444,405,511.20

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,828,639.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,347,900.00
减：应收利息总额	1,174.06
买卖债券差价收入	479,565.84

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	199,275,946.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	199,275,946.95

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,522,021,299.25
——股票投资	-4,521,398,339.25
——债券投资	-622,960.00
——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	-4,522,021,299.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
基金转出费收入	-
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	15,665,000.00
合计	15,665,000.00

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,336,202.35
银行间市场交易费用	4,325.00
合计	3,340,527.35

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	74,589.06
债券托管账户维护费	10,500.00
银行划款手续费	3,215.06
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	100.00
合计	138,130.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

本基金不收取管理费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,058,456.86

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2016年1月1日至2016年6月30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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%

注：本报告期内（2016年1月1日至2016年6月30日）基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.4.2 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（2016年6月30日）及上年度末（2015年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,171,908,180.82	27,604,369.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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（2016年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.2 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
000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大事项停牌	10.60	2016年7月14日	11.32	50	494.77	530.00	-

000547	航天发展	2016年4月19日	重大事项停牌	16.30	-	-	8,897,220	199,491,779.27	145,024,686.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	22.04	-	-	27,238,480	568,659,451.80	600,336,099.20	-
002065	东华软件	2015年12月21日	重大事项停牌	25.10	2016年7月4日	22.59	6,611,520	139,821,266.62	165,949,152.00	-
002249	大洋电机	2016年6月8日	重大事项停牌	11.97	2016年7月28日	10.77	7,785,591	92,294,976.91	93,193,524.27	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	13,082,044	201,833,900.80	162,740,627.36	-
002672	东江环保	2016年5月23日	重大事项停牌	17.33	2016年7月15日	19.06	2,735,241	48,299,565.26	47,401,726.53	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项停牌	2.76	-	-	28,327,409	128,615,818.22	78,183,648.84	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项停牌	27.44	2016年8月4日	30.16	2,817,111	98,618,975.61	77,301,525.84	-
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大事项停牌	7.58	2016年7月11日	8.10	1,356,325	13,995,889.54	10,280,943.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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，属于较高风险、较高收益的品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金

投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的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，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及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公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司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 workflows、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。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部基

金持有由一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 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，其余均能以合理价格适时变现。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,171,908,180.82	-	-	-	1,171,908,180.82
结算备付金	247,670,952.38	-	-	-	247,670,952.38
存出保证金	990,228.14	-	-	-	990,228.14
交易性金融资产	1,629,324,000.00	-	-	20,203,536,329.20	21,832,860,329.20

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	15,491,717,608.60	-	-	-	15,491,717,608.60
应收证券清算款	-	-	-	542,866.94	542,866.94
应收利息	-	-	-	27,282,230.24	27,282,230.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,541,610,969.94	-	-	20,231,361,426.38	38,772,972,396.32
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	1,092,874.50	1,092,874.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,608.60	14,608.60
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	139,315.10	139,315.10
负债总计	-	-	-	1,246,798.20	1,246,798.20
利率敏感度缺口	18,541,610,969.94	-	-	20,230,114,628.18	38,771,725,598.12
上年度末 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	4,330,869,131.13	-	-	-	4,330,869,131.13
结算备付金	857,142,857.14	-	-	-	857,142,857.14
存出保证金	8,126,965.09	-	-	-	8,126,965.09
交易性金融资产	-	-	3,347,900.00	27,315,637,273.09	27,318,985,173.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	10,000,000,000.00	-	-	-	10,000,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,865,807.68	1,865,807.68
应收利息	-	-	-	2,553,183.39	2,553,183.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,196,138,953.36	-	3,347,900.00	27,320,056,264.16	42,519,543,117.52
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	1,786,784.79	1,786,784.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	1,916,784.79	1,916,784.79
利率敏感度缺口	15,196,138,953.36	-	3,347,900.00	27,318,139,479.37	42,517,626,332.73

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.20%（2015年12月31日：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2015年12月31日：同）

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	20,203,536,329.20	52.11	27,315,637,273.09	64.25
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	20,203,536,329.20	52.11	27,315,637,273.09	64.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	2,306,917,673.08	-
业绩比较基准下降5%	-2,306,917,673.08	-	

注：于2015年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金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中属于第一层次的余额为 18,823,123,865.66 元，属于第二层次的余额为 3,009,736,463.54 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 25,334,991,621.03 元，第二层次 1,983,993,552.06 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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，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次；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次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	20,203,536,329.20	52.11
	其中：股票	20,203,536,329.20	52.11
2	固定收益投资	1,629,324,000.00	4.20
	其中：债券	1,629,324,000.00	4.20
	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	15,491,717,608.60	39.95
	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	1,419,579,133.20	3.66
7	其他各项资产	28,815,325.32	0.07
	合计	38,772,972,396.32	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	221,547,038.82	0.57
B	采矿业	148,759,917.25	0.38
C	制造业	13,000,132,975.93	33.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	900,605,669.80	2.32
E	建筑业	368,642,260.38	0.95
F	批发和零售业	627,542,863.85	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	990,622,380.09	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,581,153,191.20	4.08
J	金融业	893,376,344.37	2.30
K	房地产业	408,186,963.20	1.05
L	租赁和商务服务业	291,403,045.67	0.75
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	194,284,957.17	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	59,243,516.09	0.15
R	文化、体育和娱乐业	507,661,769.44	1.31
S	综合	10,373,435.94	0.03
	合计	20,203,536,329.20	52.11

7.3 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	000651	格力电器	27,238,480	600,336,099.20	1.55
2	600887	伊利股份	30,266,502	504,542,588.34	1.30
3	601166	兴业银行	32,783,711	499,623,755.64	1.29
4	000333	美的集团	17,121,105	406,112,610.60	1.05
5	601336	新华保险	7,276,311	293,962,964.40	0.76
6	600115	东方航空	38,114,895	251,939,455.95	0.65
7	600100	同方股份	16,265,605	243,333,450.80	0.63
8	600011	华能国际	31,728,369	238,597,334.88	0.62
9	600570	恒生电子	3,559,835	237,690,182.95	0.61
10	600271	航天信息	9,893,308	235,460,730.40	0.61
11	002450	康得新	13,547,082	231,655,102.20	0.60
12	600795	国电电力	77,142,000	226,026,060.00	0.58
13	600519	贵州茅台	773,212	225,716,047.04	0.58
14	600518	康美药业	14,570,585	221,327,186.15	0.57
15	300017	网宿科技	3,286,014	220,820,140.80	0.57
16	000625	长安汽车	14,071,317	192,354,903.39	0.50
17	600276	恒瑞医药	4,633,364	185,844,230.04	0.48
18	000538	云南白药	2,833,293	182,180,739.90	0.47
19	601006	大秦铁路	27,757,494	178,758,261.36	0.46
20	600585	海螺水泥	11,592,236	168,551,111.44	0.43
21	002065	东华软件	6,611,520	165,949,152.00	0.43
22	600535	天士力	4,626,072	165,428,334.72	0.43
23	600690	青岛海尔	18,583,723	165,023,460.24	0.43
24	002465	海格通信	13,082,044	162,740,627.36	0.42
25	600196	复星医药	8,355,017	158,912,423.34	0.41

26	600201	生物股份	5,635,678	154,023,079.74	0.40
27	600221	海南航空	48,139,500	152,602,215.00	0.39
28	002202	金风科技	9,813,535	148,478,784.55	0.38
29	300104	乐视网	2,797,386	148,009,693.26	0.38
30	002008	大族激光	6,449,670	147,310,462.80	0.38
31	601888	中国国旅	3,327,500	146,343,450.00	0.38
32	000547	航天发展	8,897,220	145,024,686.00	0.37
33	002340	格林美	16,335,500	143,262,335.00	0.37
34	002456	欧菲光	4,766,541	140,612,959.50	0.36
35	600118	中国卫星	4,158,801	139,735,713.60	0.36
36	600089	特变电工	16,126,168	137,394,951.36	0.35
37	000997	新大陆	6,777,100	135,813,084.00	0.35
38	002385	大北农	16,699,817	134,600,525.02	0.35
39	002241	歌尔股份	4,640,646	133,093,727.28	0.34
40	000661	长春高新	1,243,943	132,703,839.24	0.34
41	000998	隆平高科	6,940,314	131,727,159.72	0.34
42	600309	万华化学	7,600,170	131,482,941.00	0.34
43	300124	汇川技术	6,666,919	129,338,228.60	0.33
44	601607	上海医药	7,011,951	126,565,715.55	0.33
45	000423	东阿阿胶	2,387,942	126,154,975.86	0.33
46	002022	科华生物	5,865,549	124,994,849.19	0.32
47	300003	乐普医疗	6,808,288	124,183,173.12	0.32
48	000559	万向钱潮	7,904,728	123,313,756.80	0.32
49	002230	科大讯飞	3,651,377	119,947,734.45	0.31
50	002304	洋河股份	1,655,527	119,065,501.84	0.31
51	300199	翰宇药业	5,844,250	118,930,487.50	0.31
52	600340	华夏幸福	4,829,188	117,735,603.44	0.30
53	600500	中化国际	12,820,028	115,893,053.12	0.30
54	002701	奥瑞金	13,108,824	115,750,915.92	0.30
55	600436	片仔癀	2,556,531	115,069,460.31	0.30
56	300144	宋城演艺	4,602,712	114,653,555.92	0.30
57	600594	益佰制药	7,154,580	114,330,188.40	0.29
58	000895	双汇发展	5,460,194	114,008,850.72	0.29
59	600674	川投能源	13,558,935	111,996,803.10	0.29
60	600198	大唐电信	5,620,280	111,731,166.40	0.29
61	600009	上海机场	4,274,355	111,346,947.75	0.29
62	300072	三聚环保	3,993,934	110,392,335.76	0.28
63	600037	歌华有线	7,202,374	109,548,108.54	0.28
64	600741	华域汽车	7,759,906	108,716,283.06	0.28

65	601012	隆基股份	8,234,763	107,463,657.15	0.28
66	600066	宇通客车	5,202,281	103,005,163.80	0.27
67	002236	大华股份	7,840,805	102,714,545.50	0.26
68	002285	世联行	13,060,298	101,739,721.42	0.26
69	600252	中恒集团	23,426,826	101,672,424.84	0.26
70	300291	华录百纳	4,306,527	101,332,580.31	0.26
71	600642	申能股份	17,529,320	100,618,296.80	0.26
72	300115	长盈精密	4,835,808	99,617,644.80	0.26
73	600406	国电南瑞	7,371,247	98,553,572.39	0.25
74	600332	白云山	3,935,128	96,961,553.92	0.25
75	002038	双鹭药业	3,193,701	96,385,896.18	0.25
76	002475	立讯精密	4,872,173	95,738,199.45	0.25
77	000858	五粮液	2,928,284	95,257,078.52	0.25
78	002249	大洋电机	7,785,591	93,193,524.27	0.24
79	002004	华邦健康	10,148,483	92,655,649.79	0.24
80	000758	中色股份	11,818,682	91,594,785.50	0.24
81	000046	泛海控股	8,898,917	89,968,050.87	0.23
82	002311	海大集团	5,693,261	89,782,725.97	0.23
83	000568	泸州老窖	3,013,110	89,489,367.00	0.23
84	300274	阳光电源	3,665,410	89,436,004.00	0.23
85	002081	金螳螂	8,910,131	89,279,512.62	0.23
86	600549	厦门钨业	2,940,088	87,350,014.48	0.23
87	002371	七星电子	2,078,546	86,924,793.72	0.22
88	600398	海澜之家	7,667,822	86,646,388.60	0.22
89	600588	用友网络	4,321,210	84,609,291.80	0.22
90	601117	中国化学	15,218,169	84,156,474.57	0.22
91	600138	中青旅	4,327,626	83,609,734.32	0.22
92	600536	中国软件	3,346,520	83,395,278.40	0.22
93	601098	中南传媒	4,562,685	82,630,225.35	0.21
94	601179	中国西电	15,914,711	80,687,584.77	0.21
95	000039	中集集团	5,595,027	79,281,532.59	0.20
96	002444	巨星科技	3,886,826	78,980,304.32	0.20
97	600993	马应龙	3,782,464	78,788,725.12	0.20
98	600005	武钢股份	28,327,409	78,183,648.84	0.20
99	600827	百联股份	6,407,883	77,407,226.64	0.20
100	600511	国药股份	2,817,111	77,301,525.84	0.20
101	600498	烽火通信	3,130,656	76,012,327.68	0.20
102	600699	均胜电子	1,978,316	75,769,502.80	0.20
103	600487	亨通光电	5,928,564	74,581,335.12	0.19

104	300147	香雪制药	5,011,301	73,816,463.73	0.19
105	000826	启迪桑德	2,404,342	73,452,648.10	0.19
106	600422	昆药集团	5,349,286	72,964,261.04	0.19
107	002595	豪迈科技	3,409,017	72,850,693.29	0.19
108	002594	比亚迪	1,193,215	72,798,047.15	0.19
109	600517	置信电气	7,528,050	71,591,755.50	0.18
110	300133	华策影视	4,538,814	70,669,333.98	0.18
111	600125	铁龙物流	10,989,240	70,001,458.80	0.18
112	600787	中储股份	9,314,641	69,207,782.63	0.18
113	002146	荣盛发展	10,123,588	68,030,511.36	0.18
114	600557	康缘药业	4,097,892	66,918,576.36	0.17
115	600270	外运发展	3,810,830	66,651,416.70	0.17
116	000848	承德露露	5,499,337	65,717,077.15	0.17
117	000027	深圳能源	10,223,657	65,226,931.66	0.17
118	600685	中船防务	2,541,003	64,439,836.08	0.17
119	000400	许继电气	4,118,981	63,597,066.64	0.16
120	000028	国药一致	964,226	62,771,112.60	0.16
121	601377	兴业证券	8,454,675	62,480,048.25	0.16
122	600884	杉杉股份	3,554,320	61,169,847.20	0.16
123	600600	青岛啤酒	2,090,644	60,775,021.08	0.16
124	600409	三友化工	9,003,150	60,681,231.00	0.16
125	600372	中航电子	3,102,054	60,396,991.38	0.16
126	601928	凤凰传媒	5,700,068	60,078,716.72	0.15
127	000999	华润三九	2,477,308	60,000,399.76	0.15
128	600572	康恩贝	9,246,060	59,914,468.80	0.15
129	600062	华润双鹤	3,231,668	58,880,990.96	0.15
130	300146	汤臣倍健	4,338,926	58,749,058.04	0.15
131	600835	上海机电	2,993,972	57,454,322.68	0.15
132	000876	新希望	6,892,694	57,347,214.08	0.15
133	600660	福耀玻璃	4,090,879	57,272,306.00	0.15
134	000729	燕京啤酒	7,485,651	56,816,091.09	0.15
135	000099	中信海直	4,305,800	55,975,400.00	0.14
136	600587	新华医疗	2,398,769	55,387,576.21	0.14
137	600008	首创股份	14,208,702	55,271,850.78	0.14
138	601808	中海油服	4,509,305	54,788,055.75	0.14
139	600261	阳光照明	7,627,753	53,851,936.18	0.14
140	601886	江河集团	4,898,700	50,309,649.00	0.13
141	000860	顺鑫农业	2,113,800	50,266,164.00	0.13
142	000049	德赛电池	1,180,994	49,530,888.36	0.13

143	601992	金隅股份	6,344,371	49,168,875.25	0.13
144	002153	石基信息	1,857,081	48,989,796.78	0.13
145	000090	天健集团	5,564,873	48,970,882.40	0.13
146	002041	登海种业	3,148,050	48,920,697.00	0.13
147	600337	美克家居	3,741,931	48,682,522.31	0.13
148	600079	人福医药	2,877,423	48,254,383.71	0.12
149	300015	爱尔眼科	1,318,213	48,154,320.89	0.12
150	002051	中工国际	2,447,135	48,135,145.45	0.12
151	002672	东江环保	2,735,241	47,401,726.53	0.12
152	600059	古越龙山	4,600,501	47,339,155.29	0.12
153	300058	蓝色光标	4,618,405	44,844,712.55	0.12
154	600894	广日股份	3,336,424	44,474,531.92	0.11
155	600850	华东电脑	1,541,280	44,219,323.20	0.11
156	601777	力帆股份	3,756,345	44,212,180.65	0.11
157	600885	宏发股份	1,432,836	44,002,393.56	0.11
158	002250	联化科技	3,059,676	43,814,560.32	0.11
159	600970	中材国际	6,896,550	43,448,265.00	0.11
160	603288	海天味业	1,426,891	43,377,486.40	0.11
161	002482	广田集团	5,708,923	43,273,636.34	0.11
162	600292	远达环保	3,317,210	42,029,050.70	0.11
163	600596	新安股份	5,748,000	41,902,920.00	0.11
164	002056	横店东磁	2,454,000	41,718,000.00	0.11
165	002317	众生药业	3,464,600	41,540,554.00	0.11
166	603555	贵人鸟	1,648,900	41,107,077.00	0.11
167	002299	圣农发展	1,579,119	40,899,182.10	0.11
168	002294	信立泰	1,496,346	40,700,611.20	0.10
169	601801	皖新传媒	3,423,852	39,956,352.84	0.10
170	600761	安徽合力	3,896,753	39,318,237.77	0.10
171	600998	九州通	2,213,417	38,756,931.67	0.10
172	600329	中新药业	2,226,351	38,449,081.77	0.10
173	600551	时代出版	1,920,892	38,341,004.32	0.10
174	600199	金种子酒	3,452,762	38,325,658.20	0.10
175	600195	中牧股份	2,064,800	37,785,840.00	0.10
176	600705	中航资本	6,345,166	37,309,576.08	0.10
177	603699	纽威股份	2,095,000	37,165,300.00	0.10
178	000768	中航飞机	1,857,060	36,565,511.40	0.09
179	000596	古井贡酒	757,761	36,334,639.95	0.09
180	002007	华兰生物	1,148,078	36,049,649.20	0.09
181	000919	金陵药业	2,731,288	35,752,559.92	0.09

182	000501	鄂武商 A	2,272,160	35,650,190.40	0.09
183	600141	兴发集团	3,044,750	35,075,520.00	0.09
184	600029	南方航空	4,835,615	34,139,441.90	0.09
185	600085	同仁堂	1,133,737	33,774,025.23	0.09
186	002293	罗莱生活	2,445,800	33,507,460.00	0.09
187	600251	冠农股份	4,128,321	33,026,568.00	0.09
188	002271	东方雨虹	1,906,860	32,855,197.80	0.08
189	600873	梅花生物	5,160,690	32,047,884.90	0.08
190	300070	碧水源	2,110,318	31,401,531.84	0.08
191	600488	天药股份	5,307,550	31,367,620.50	0.08
192	002064	华峰氨纶	6,492,782	31,165,353.60	0.08
193	601208	东材科技	3,624,200	30,914,426.00	0.08
194	002588	史丹利	2,345,640	28,968,654.00	0.07
195	601727	上海电气	3,672,761	27,766,073.16	0.07
196	002267	陕天然气	2,599,330	27,292,965.00	0.07
197	002646	青青稞酒	1,314,600	27,093,906.00	0.07
198	000726	鲁泰 A	2,319,800	25,772,978.00	0.07
199	601933	永辉超市	6,056,944	25,015,178.72	0.06
200	600617	国新能源	2,173,028	24,902,900.88	0.06
201	002419	天虹商场	2,034,200	24,329,032.00	0.06
202	600566	济川药业	940,543	24,209,576.82	0.06
203	600809	山西汾酒	1,078,273	23,916,095.14	0.06
204	000800	一汽轿车	2,192,834	23,858,033.92	0.06
205	601965	中国汽研	2,477,930	23,812,907.30	0.06
206	002405	四维图新	936,291	23,032,758.60	0.06
207	603005	晶方科技	606,158	22,955,203.46	0.06
208	600780	通宝能源	4,567,663	22,929,668.26	0.06
209	603899	晨光文具	1,287,676	22,791,865.20	0.06
210	000550	江铃汽车	798,707	19,456,502.52	0.05
211	601231	环旭电子	1,708,430	18,280,201.00	0.05
212	002653	海思科	1,038,895	16,643,097.90	0.04
213	000061	农产品	1,365,555	16,605,148.80	0.04
214	002030	达安基因	594,506	16,527,266.80	0.04
215	600635	大众公用	2,556,848	15,417,793.44	0.04
216	002410	广联达	1,047,708	14,982,224.40	0.04
217	600507	方大特钢	3,033,411	14,560,372.80	0.04
218	600718	东软集团	791,272	14,496,103.04	0.04
219	601258	庞大集团	5,148,786	14,159,161.50	0.04
220	600525	长园集团	988,920	13,696,542.00	0.04

221	603000	人民网	800,935	13,303,530.35	0.03
222	002179	中航光电	295,621	12,806,301.72	0.03
223	300253	卫宁健康	517,395	12,779,656.50	0.03
224	600917	重庆燃气	1,238,700	12,325,065.00	0.03
225	002223	鱼跃医疗	368,863	11,700,334.36	0.03
226	600316	洪都航空	590,389	11,518,489.39	0.03
227	000031	中粮地产	1,207,167	11,383,584.81	0.03
228	300244	迪安诊断	336,240	11,089,195.20	0.03
229	600158	中体产业	609,037	10,810,406.75	0.03
230	600737	中粮屯河	921,700	10,645,635.00	0.03
231	603369	今世缘	779,250	10,457,535.00	0.03
232	600770	综艺股份	832,539	10,373,435.94	0.03
233	000930	中粮生化	944,700	10,372,806.00	0.03
234	600759	洲际油气	1,356,325	10,280,943.50	0.03
235	600151	航天机电	893,400	10,095,420.00	0.03
236	000969	安泰科技	630,221	8,842,000.63	0.02
237	600325	华发股份	769,565	8,519,084.55	0.02
238	002013	中航机电	617,868	8,328,860.64	0.02
239	002073	软控股份	684,801	8,251,852.05	0.02
240	002025	航天电器	329,910	8,145,477.90	0.02
241	600006	东风汽车	900,614	7,988,446.18	0.02
242	603019	中科曙光	199,800	7,956,036.00	0.02
243	603766	隆鑫通用	391,400	7,914,108.00	0.02
244	600058	五矿发展	417,400	7,834,598.00	0.02
245	000777	中核科技	330,300	7,781,868.00	0.02
246	600171	上海贝岭	443,128	7,697,133.36	0.02
247	600750	江中药业	239,092	7,603,125.60	0.02
248	002275	桂林三金	383,709	7,083,268.14	0.02
249	601908	京运通	731,200	5,608,304.00	0.01
250	002315	焦点科技	74,319	5,013,559.74	0.01
251	600429	三元股份	580,800	4,547,664.00	0.01
252	002140	东华科技	296,000	4,516,960.00	0.01
253	000418	小天鹅A	138,030	4,502,538.60	0.01
254	002048	宁波华翔	153,600	3,512,832.00	0.01
255	002049	紫光国芯	75,672	3,325,784.40	0.01
256	600563	法拉电子	58,699	2,671,978.48	0.01
257	002678	珠江钢琴	212,400	2,606,148.00	0.01
258	603169	兰石重装	194,420	2,422,473.20	0.01
259	600397	安源煤业	537,800	2,377,076.00	0.01

260	600184	光电股份	35,300	799,192.00	0.00
261	000401	冀东水泥	50	530.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

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	601377	兴业证券	15,979,337.01	0.04
2	000661	长春高新	13,113,083.52	0.03

注：报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金仅买入上述2只股票。

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

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	601166	兴业银行	312,050,698.55	0.73
2	600519	贵州茅台	300,213,822.25	0.71
3	002466	天齐锂业	182,562,855.63	0.43
4	002273	水晶光电	136,425,506.56	0.32
5	000988	华工科技	118,267,717.27	0.28
6	600085	同仁堂	117,235,669.87	0.28
7	002049	紫光国芯	111,916,827.10	0.26
8	600718	东软集团	88,785,632.58	0.21
9	600518	康美药业	84,767,896.68	0.20
10	600660	福耀玻璃	74,518,399.47	0.18
11	600521	华海药业	71,791,316.67	0.17
12	600276	恒瑞医药	71,516,563.72	0.17
13	002001	新和成	69,640,712.73	0.16
14	002048	宁波华翔	67,806,761.31	0.16
15	600699	均胜电子	67,601,843.87	0.16
16	002007	华兰生物	61,702,923.63	0.15
17	600498	烽火通信	60,893,035.97	0.14
18	600066	宇通客车	60,886,087.06	0.14
19	600079	人福医药	60,349,150.65	0.14
20	600298	安琪酵母	53,844,514.58	0.13

7.4.3 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	29,092,420.53
卖出股票收入（成交）总额	3,064,200,536.37

注：7.4.1项“买入金额”、7.4.2项“卖出金额”及7.4.3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。

7.5 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	1,629,324,000.00	4.20
	其中：政策性金融债	1,629,324,000.00	4.20
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	1,629,324,000.00	4.20

7.6 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	150222	15国开22	5,000,000	499,950,000.00	1.29
2	160204	16国开04	5,000,000	499,400,000.00	1.29
3	160401	16农发01	3,800,000	379,924,000.00	0.98
4	150419	15农发19	2,500,000	250,050,000.00	0.64

注：报告期末，本基金仅持有上述4只债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	990,228.14
2	应收证券清算款	542,866.94
3	应收股利	-
4	应收利息	27,282,230.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	28,815,325.32

7.12.4 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。

7.12.5 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	000651	格力电器	600,336,099.20	1.55	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2	20,005,000,000.00	40,010,000,000.00	100.00%	-	-

8.2 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	-	0.00%

8.3 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	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.02	10,000,000.00	0.02	3年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.02	10,000,000.00	0.02	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月13日）基金份额总额	40,010,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	40,010,000,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40,010,000,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2016年1月20日本基金管理人发布公告，戴京焦女士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

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中国银河证券股份有限公司	1	1,742,505,185.33	56.87%	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	1,321,695,351.04	43.13%	-	-	新增1个
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-

民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增

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：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注 4：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 5：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

10.7.2 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
中国银河证券股份有限公司	-	-	654,335,300,000.00	100.00%	-	-
长江证券股份有限公司	3,828,639.90	100.00%	-	-	-	-

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016年8月27日