

# 嘉实领先成长混合型证券投资基金

## 2016年第3季度报告

2016年9月30日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2016年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	嘉实领先成长混合
基金主代码	070022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 31 日
报告期末基金份额总额	991,787,249.97 份
投资目标	本基金致力于挖掘中国经济中快速成长的行业，并投资于其中领先成长的企业，在严格控制风险的前提下，力争为基金持有人获取长期、持续的超额收益。
投资策略	在大类资产配置上，首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，在控制风险的前提下优先配置股票资产；在股票选择层面，本基金将在快速成长行业备选库中寻找市场占有率较高、具有较强竞争优势的领先成长公司。在债券投资方面，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债

	券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	-15,084,657.79
2. 本期利润	3,939,673.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0043
4. 期末基金资产净值	2,301,277,855.98
5. 期末基金份额净值	2.320

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

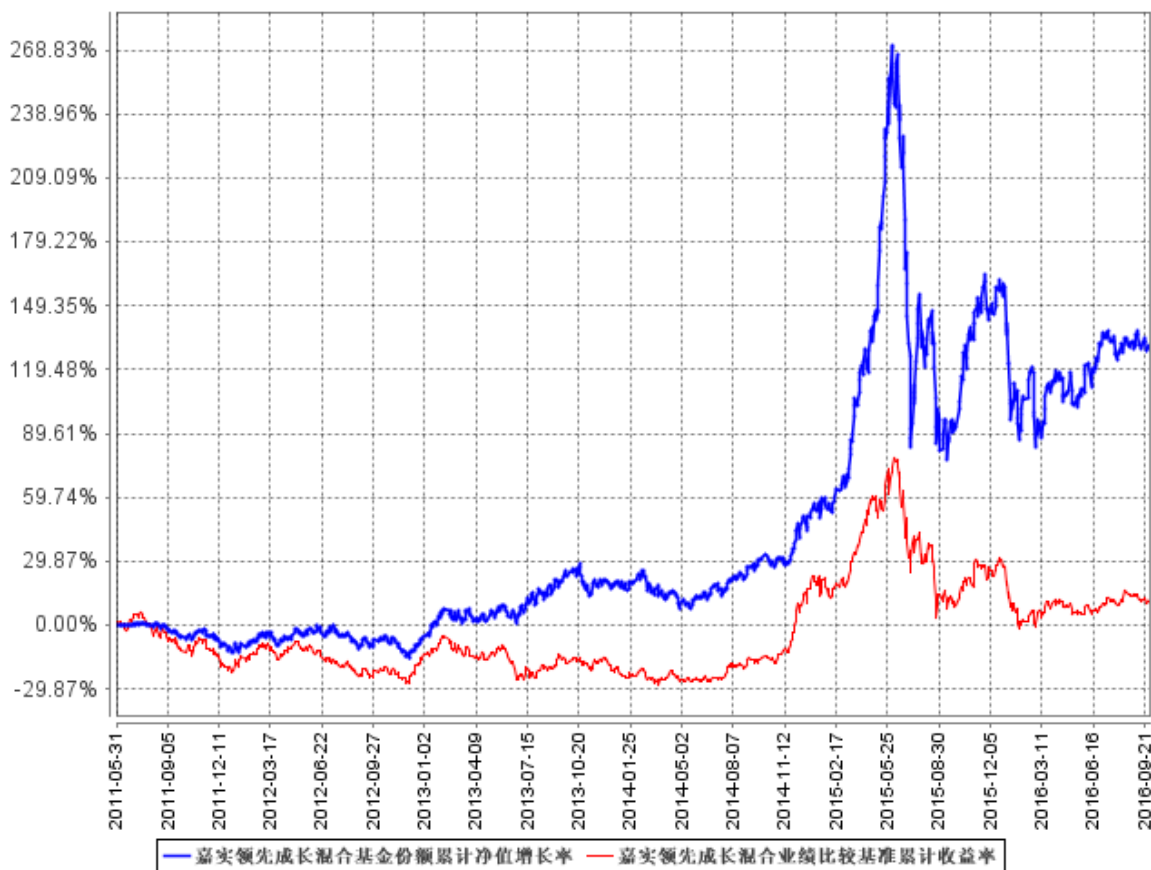
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.22%	0.94%	3.07%	0.76%	-2.85%	0.18%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 嘉实领先成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：嘉实领先成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

(2011年5月31日至2016年9月30日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“十二、基金的投资（三）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵秋涛	本基金、嘉实成长收益混合基金经理	2011 年 5 月 31 日	-	18 年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券，从事行业研究工作，先后担任研究员、高级研究员；2006 年 12 月加盟嘉实基金管理有限公司，历任公司高级研究员、投资经理，现任成长策略组组长。金融硕士，具有基金从业资格，澳大利亚籍。

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实领先成长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 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 报告期内基金投资策略和运作分析

国内 3 季度经济数据相对平稳，通胀也比较温和，房价持续上涨带来政策调控的压力比较大，核心城市的限购限贷政策频出。A 股在 3 季度呈现震荡向上行情，沪深 300 指数上涨 3.15%、中证 500 指数上涨 3.34%，其中建筑建材、房地产、家电等房地产产业链板块涨幅居前，计算机、传媒、电子等板块跌幅居前。市场呈现结构性行情，血制品、光通信、铜箔和覆铜板、PPP 板块等受益于景气度高，相关个股涨幅较大，也为本基金贡献较多的收益率。信息安全、军工信息化等板块在 3 季度缺乏基本面催化剂、相对估值较高，股价有所调整，对本基金业绩有一些拖累。本基金坚持以新兴产业作为投资主线，积极寻找中长期成长空间较大的优秀企业，力争获取中长期的良好投资回报。

### 4.5 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 2.320 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.22%，业绩比较基准收益率为 3.07%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,979,253,469.20	83.41
	其中：股票	1,979,253,469.20	83.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,000,000.00	1.26
	其中：债券	30,000,000.00	1.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售	-	-

	金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	340,872,661.02	14.37
8	其他资产	22,673,202.16	0.96
9	合计	2,372,799,332.38	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	24,881,982.80	1.08
B	采矿业	60,990,000.00	2.65
C	制造业	1,512,192,570.76	65.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,813,119.38	0.99
E	建筑业	74,616,601.48	3.24
F	批发和零售业	57,392,669.85	2.49
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	193,219,658.75	8.40
J	金融业	177,223.18	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,432,643.00	0.89
R	文化、体育和娱乐业	12,537,000.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	1,979,253,469.20	86.01

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600183	生益科技	9,997,100	123,964,040.00	5.39
2	002007	华兰生物	3,074,363	115,534,561.54	5.02
3	300353	东土科技	5,000,000	112,350,000.00	4.88
4	002281	光迅科技	1,264,512	105,447,655.68	4.58
5	600498	烽火通信	3,599,028	102,644,278.56	4.46

6	002614	蒙发利	5,571,700	88,924,332.00	3.86
7	300342	天银机电	3,063,600	75,762,828.00	3.29
8	600068	葛洲坝	9,430,100	74,592,091.00	3.24
9	002439	启明星辰	3,621,300	74,236,650.00	3.23
10	601799	星宇股份	1,514,600	62,659,002.00	2.72

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,000,000.00	1.30
	其中：政策性金融债	30,000,000.00	1.30
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	-	-
10	合计	30,000,000.00	1.30

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160204	16 国开 04	300,000	30,000,000.00	1.30

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。



## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	824,076.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	530,254.52
5	应收申购款	21,318,871.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,673,202.16

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300353	东土科技	112,350,000.00	4.88	重大事项停牌

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	932,063,912.66
报告期期间基金总申购份额	208,819,783.09
减：报告期期间基金总赎回份额	149,096,445.78
报告期期间基金拆分变动份额	-

报告期期末基金份额总额	991,787,249.97
-------------	----------------

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,436,113.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,436,113.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.45

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实领先成长混合型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实领先成长混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实领先成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实领先成长混合型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实领先成长混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 8.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

### 8.3 查阅方式

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

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-

600-8800, 或发电子邮件, E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 10 月 25 日