

# 嘉实文体娱乐股票型证券投资基金

## 2016 年第 4 季度报告

2016 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

报告送出日期：2017 年 1 月 19 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 16 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 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实文体娱乐股票
基金主代码	003053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日
报告期末基金份额总额	838,389,944.35 份
投资目标	本基金通过投资于文体娱乐行业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面，资金面和估值等五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。对文体娱乐主题相关产业的发展进行密切跟踪，在个股选择上采用定性和定量相结合的方法；通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，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	中证文体指数×80%+中债综合指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币

	市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
下属分级基金的交易代码	003053	003054
报告期末下属分级基金的份额总额	772, 067, 199. 13 份	66, 322, 745. 22 份

### § 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10月1日—2016年12月31日）	
	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
1. 本期已实现收益	630, 549. 08	-78, 957. 73
2. 本期利润	-7, 081, 825. 82	-615, 007. 90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0091	-0. 0081
4. 期末基金资产净值	764, 943, 679. 33	65, 583, 556. 24
5. 期末基金份额净值	0. 991	0. 989

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）嘉实文体娱乐股票 A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实文体娱乐股票 C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费。（3）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

###### 嘉实文体娱乐股票 A

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. 90%	0. 22%	-5. 63%	0. 76%	4. 73%	-0. 54%

###### 嘉实文体娱乐股票 C

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	-1. 00%	0. 23%	-5. 63%	0. 76%	4. 63%	-0. 53%

### 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

嘉实文体娱乐股票A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

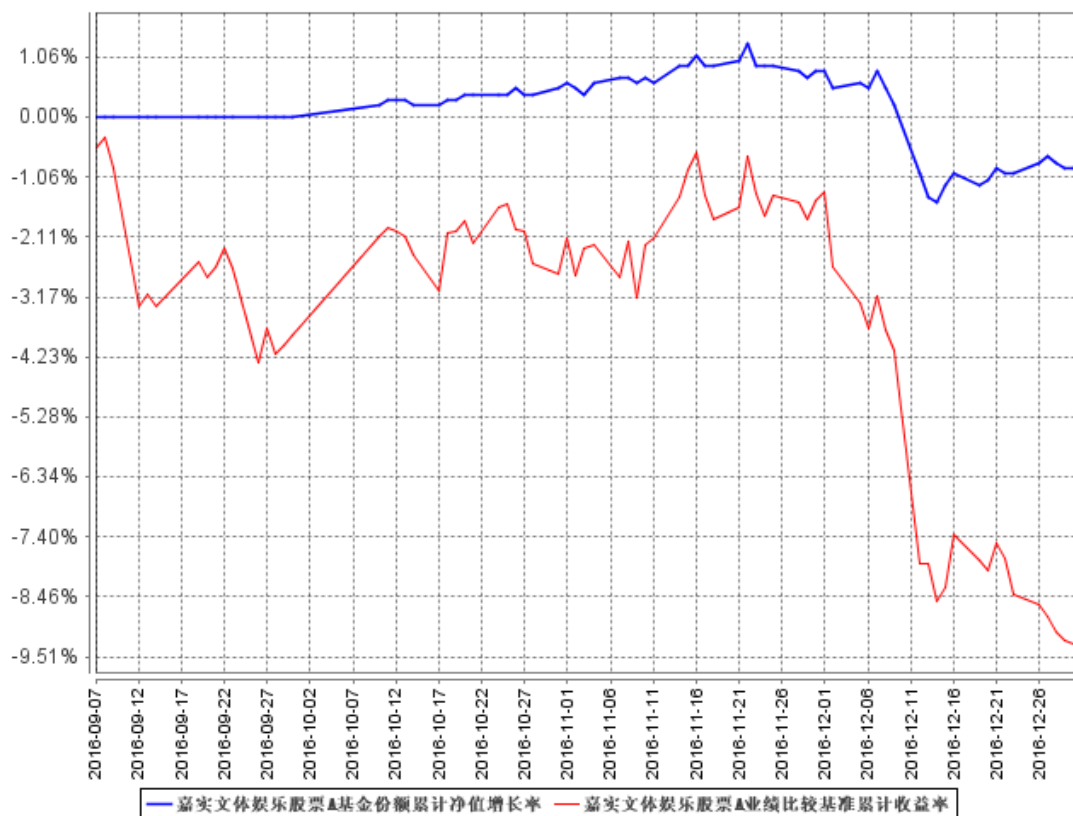


图 1：嘉实文体娱乐股票 A 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 9 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日)

嘉实文体娱乐股票C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

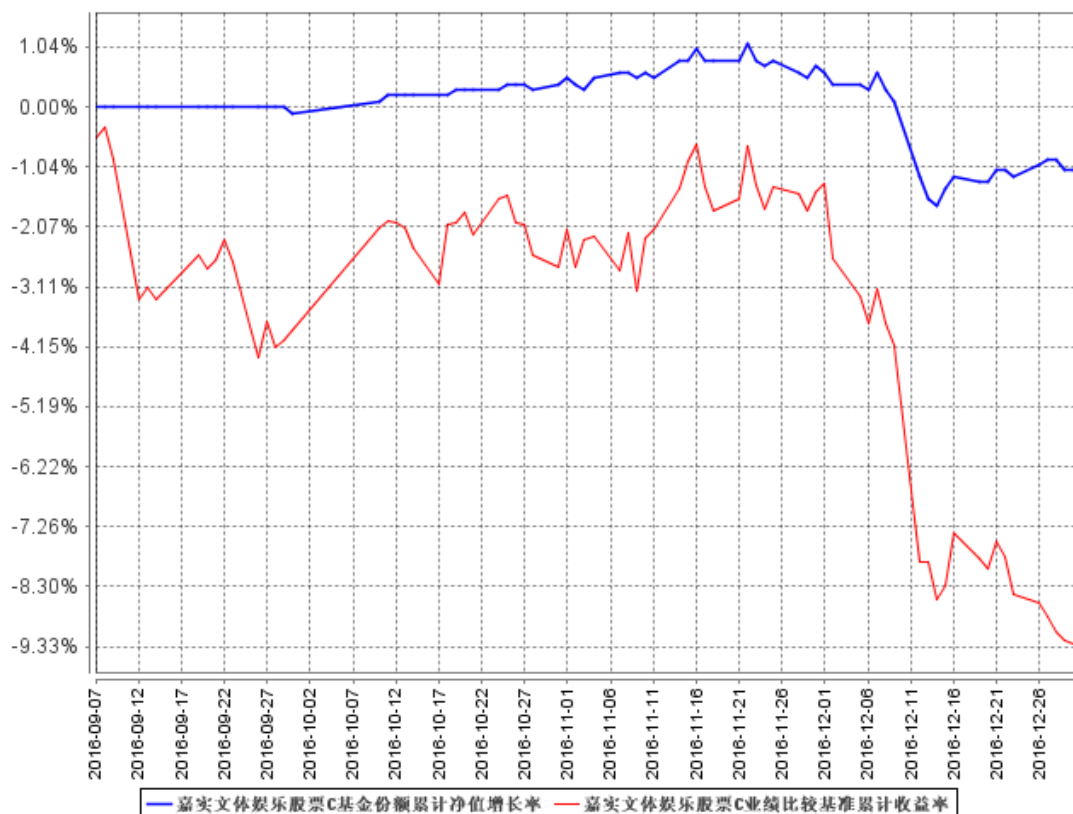


图 2：嘉实文体娱乐股票 C 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 9 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日)

注：本基金基金合同生效日 2016 年 9 月 7 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，本报告期处于建仓期内。

## § 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		
王凯	本基金经理	2016年9月7日	-	6年	曾任职于景顺长城基金管理有限公司，担任行业研究员一职。2013年9月加入嘉实基金管理有限公司研究部，从事计算机、传媒等行业研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

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、《嘉实文体娱乐股票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 4 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

4 季度国内经济主要有三个变化：第一 PPI 持续回升；第二政府高压态度对高房价问题采取集中调控措施；第三利率结束下降趋势反转后升高，同时造成债市大幅调整。A 股在 4 季度呈现震荡行情：股市波动较前三个季度加大，且冲高回落，市场风格仍然延续了前三个季度的情况，风格偏向大盘蓝筹股，保险和产业资本增持较多。本基金目前仍处于建仓期，由于基金投资主要是新型成长方向，而短期内市场仍然偏向大盘蓝筹，所以仓位仍然较低。从后续回顾看规避了风险，相对业绩基准获得+8.21%的超额收益，效果显著。在选股方面，本基金将以业绩持续成长、估值合理或偏低的文体娱乐和相关公司为配置主线，以期在短期和中长期都能给持有人带来良好投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 A 基金份额净值为 0.991 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.90%；截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 C 基金份额净值为 0.989 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.00%；同期业绩比较基准收益率为-5.63%。

#### 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	187,509,965.61	22.52
	其中：股票	187,509,965.61	22.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	250,000,000.00	30.03
	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	76,482,689.68	9.19
8	其他资产	318,540,806.96	38.26
9	合计	832,533,462.25	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,450,275.21	12.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	82,230,454.40	9.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,829,236.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	187,509,965.61	22.58

## 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	002439	启明星辰	1,635,300	33,997,887.00	4.09
2	300097	智云股份	580,096	31,795,061.76	3.83
3	002425	凯撒文化	1,322,400	30,084,600.00	3.62
4	002635	安洁科技	540,700	19,681,480.00	2.37
5	300104	乐视网	564,820	18,616,467.20	2.24
6	002777	久远银海	121,400	10,950,280.00	1.32
7	300369	绿盟科技	315,800	10,727,726.00	1.29
8	002761	多喜爱	254,700	10,407,042.00	1.25
9	300433	蓝思科技	333,800	9,216,218.00	1.11
10	300379	东方通	114,300	7,931,277.00	0.95

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。



**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**

报告期末，本基金未持有债券。

**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	35,304.99
2	应收证券清算款	318,124,145.29
3	应收股利	-
4	应收利息	377,454.08
5	应收申购款	3,902.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,540,806.96

#### 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	002635	安洁科技	19,681,480.00	2.37	重大事项停牌
2	300104	乐视网	18,616,467.20	2.24	重大事项停牌

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
报告期期初基金份额总额	810,368,799.16	96,608,885.01
报告期期间基金总申购份额	55,565,687.02	2,250,350.83
减：报告期期间基金总赎回份额	93,867,287.05	32,536,490.62
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	772,067,199.13	66,322,745.22

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

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文体娱乐股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实文体娱乐股票型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) 报告期内嘉实文体娱乐股票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  
2017 年 1 月 19 日