

嘉实主题新动力股票型证券投资基金

2011第一季度报告

2011年3月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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2011年4月19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，确认报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

净值表现的比较基准及其说明：本基金的业绩比较基准为“上证综指×95%+上证国债指数×5%”。

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。

本报告期自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 嘉实主题新动力股票
交易代码 070021
基金运作方式 约定开放式
基金合同生效日 2010年12月7日
报告期基金总份额 5,802,106,506.14份
投资目标 充分把握驱动中国经济发展的结构性变化所带来的主题性投资机会,并在此基础上精选具有高成长潜力的上市公司,力争获取长期、持续的超额收益。

投资策略 通过发掘驱动经济增长及结构调整的新增长动力,并以新兴成长行业所指引的主题性投资机会为主的投资线索,将主题投资和基本面分析相结合,在基本面分析的基础上而下的管理策略。①主题投资:主要通过“主题”的“度量”以及经济周期与行业轮动的“度量”,对不同类别的配置资金,优先考虑股票型基金的配置;②深入挖掘具有受益于该主题的上市公司的股票。③综合考量投资组合的风险与收益的原则下,完成构建并定期更新的投资组合。

业绩比较基准 沪深300指数×95%+上证国债指数×5%

风险收益特征 债券收益和货币市场基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益 -39,718,464.32
2.本期利润 -411,253,580.68

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0675

4.期末基金份额净值 5,434,810,979.66
5.期初基金份额净值 0.937

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,本期利息收入为本期利息收入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,计算时未考虑申购赎回费用的影响。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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(净值增长标准差) 业绩比较基准收益(净值增长标准差) ①-(3) ②-(4)

过去三个月 -6.67% 0.99% 2.96% 1.30% -6.67% -0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000511 国阳股份 13,705,209 292,469,160.06 5.38

2 000028 一汽轿车 10,290,292 288,582,632.20 5.27

3 000792 盐湖钾肥 5,314,645 276,946,150.95 5.10

4 600278 恒瑞医药 5,855,239 268,521,260.54 4.94

5 601919 中国远洋 22,198,332 221,983,320.00 4.08

6 600519 贵州茅台 1,198,523 215,554,361.55 3.97

7 600600 青岛啤酒 5,927,286 185,642,597.52 3.42

8 600381 金地集团 26,299,953 178,376,687.00 3.29

9 600996 云天化 7,221,173 169,841,988.96 3.13

10 000999 华润三九 7,400,125 158,214,672.50 2.91

5.3 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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 100108 10年期国债 80 3,000,000 292,590,000.00 5.38

2 110001 10年期国债 35,650 3,992,000.00 0.07

注:报告期内,本基金没有以上计上2只债券。

5.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.5 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.6 投资组合报告附注

5.6.1 报告期内本基金持有的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在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。

5.6.2 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。

5.6.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,750,989.77

2 受托管理费款 303,840.00

3 信用减值 0

4 反向回购款 3,655,637.59

5 合计 1,073,079.51

5.6.4 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。

5.6.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

5.6.6 投资组合报告附注

虽然报告期内本基金在建工期较长,但是本基金采取了快速建仓策略,一方面放弃了持筹时间较长的个股,另一方面看好一些成长类股票进入买入过程后,因此就一直处在买进、买仓有些快,这在牛市市场的操作过程中有些吃亏。

整体上来看,一季度基金仓位在10%左右,持仓较为均衡,仓位配置上偏向于成长类的仓位,而钢铁、建材、机械等周期品种持仓比例较低,因此持仓较为均衡。

4.2 管理人报告期内本基金运作情况的说明

报告期内,本基金严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实主题新动力股票型证券投资基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,努力追求基金持有人谋求最大利益。本基金运营管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,通过IT系统和人工监控相结合的方式监督日常经营,对不同部门、不同基金经理进行公平交易监控。

4.3.2 本报告期内与其他基金组合的公平交易情况

本基金未发现不公平交易行为。

4.3.3 本报告期内本基金的异常交易行为

本基金未发现异常交易行为。

4.3.4 本报告期内本基金的内幕交易情况

本基金未发现内幕交易行为。

4.3.5 本报告期内本基金的关联交易情况

本基金未发现关联交易行为。

4.3.6 本报告期内本基金的关联交易定价政策

本基金未发现关联交易定价政策。

4.3.7 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.8 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.9 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.10 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.11 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.12 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.13 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.14 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.15 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.16 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.17 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.18 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.19 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.20 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.21 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.22 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.23 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.24 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.25 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.26 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.27 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.28 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.29 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.30 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.31 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.32 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.33 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.34 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.35 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.36 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金未发现异常交易行为。

4.3.37 本报告期内本基金的关联交易的说明

本基金未发现关联交易的说明。

4.3.38 本报告期内本基金的公平交易制度的执行情况

本基金未发现公平交易制度的执行情况。

4.3.39 本报告期内本基金的异常交易行为的专项说明