

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

嘉实策略增长混合型证券投资基金

2011年度 报告摘要

2011年12月31日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中所引用资料均来源于公开披露信息,并不构成对基金业绩表现的保证。

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中所引用资料均来源于公开披露信息,并不构成对基金业绩表现的保证。

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金简称, etc.) and Value (嘉实策略增长混合型证券投资基金, etc.)

Table with 2 columns: Item (基金管理人, 基金托管人, etc.) and Value (嘉实基金管理有限公司, etc.)

Table with 2 columns: Item (基金管理人, 基金托管人, etc.) and Value (嘉实基金管理有限公司, etc.)

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: Item (本期期末余额, 上期期末余额, etc.), 2011年, 2010年, 2009年

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。

注:2.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:3.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:4.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:5.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:6.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:7.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:8.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:9.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:10.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:11.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:12.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:13.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:14.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:15.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:16.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:17.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:18.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:19.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:20.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:21.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:22.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:23.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:24.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:25.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:26.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:27.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:28.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:29.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:30.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

注:31.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益中属于未实现的部分。

4.5 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2012年,国际经济环境依然存在一定不确定性,欧债的演进、伊朗的冲突,其它一些国家在全球失衡的过程中可能出现的问题,都有可能对A股市场的运行带来一定的影响。

国内经济层面,我们预期可以观察到一些复苏迹象带来的积极因素;第一,通胀进一步回落;第二,二季度投资的快速下降有带来信贷的阶段性放松,这在资金供给和资金价格上缓解实体经济和资本市场的压力。

在宏观经济方面,我们关注到经过2011年的大幅下跌,市场整体估值水平偏低较弱的压力,无论是周期股还是消费股、中期股还是蓝筹股,都找不到多少具备长期投资价值的机会。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
下述关联交易均在日常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联交易单元进行的交易
7.4.4.1.1 股票交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.2 债券交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.3 基金买卖

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.4 支付关联方款项

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.5 关联方担保

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.6 关联方应收应付款项

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.7 关联方委托理财

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.8 关联方承诺

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.1.9 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2 关联方应收应付款项

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.1 应收关联方款项

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.2 应付关联方款项

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.3 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.4 关联方承诺

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.5 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.6 关联方承诺

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.7 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.8 关联方承诺

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.9 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.10 关联方承诺

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.11 关联方其他

Table with 4 columns: 关联方名称, 本期, 上期, 2009年

7.4.4.2.12 关联方承诺

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额

注:8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3项“买入成本”、“卖出收入”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 期末按品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值

8.7 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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值

8.8 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(张), 公允价值

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 公允价值

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 5 columns: 序号, 基金份额代码, 基金份额, 基金份额持有人户数, 基金份额持有人结构

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额占期末基金份额总额比例

9.3 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.4 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.5 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.6 期末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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.8 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

9.9 投资组合报告附注

9.9.1 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。

9.9.2 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

9.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 公允价值