嘉实安心货币市场基金

2012 第三季度 报告

2012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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月26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2012年10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,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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实安心货币	
基金主代码	070028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月28日	
报告期末基金份额总额	751,820,894.79份	
投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。根据宏观经济指标决定债券组合的剩余期限和比例分布;根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例;根据债券的信用等级及担保状况决定组合的风险级别。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
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	
下属两级基金简称	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
下属两级交易代码	070028	070029
下属两级基金报告期末份额总额	54,524,549.75份	697,296,345.04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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)	
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
1. 本期已实现收益	356,229.12	2,664,015.70
2.本期利润	356,229.12	2,664,015.70
3.期末基金资产净值	54,524,549.75	697,296,345.04

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)嘉实安心货币A与嘉实安心货币B适用不同的销售服务费率。(3)本基金无持有人认购申购或交易基金的各项费用;(4)本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实安心货币A

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.5929%	0.0010%	0.3408%	0.0000%	0.2521%	0.0010%

嘉实安心货币B

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	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	0.6538%	0.0010%	0.3408%	0.0000%	0.3130%	0.0010%

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

图1:嘉实安心货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月28日至2012年9月30日)

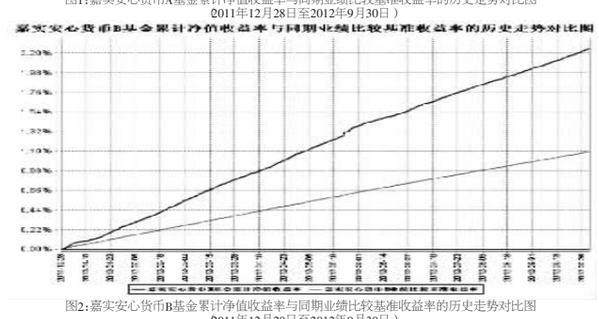

图2:嘉实安心货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月28日至2012年9月30日)

注:本基金基金合同生效日2011年12月28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 (十四 、投资范围和 八、投资组合比例限制)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		
桑迎	本基金基金经理、嘉实理财宝7天债券基金经理	2011年12月28日	-	10年	曾任交通银行外汇交易员,华夏银行总行交易员。2008年1月加入嘉实基金管理有限公司,历任交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。银行与金融专业硕士,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)证券从业人员的含义遵从行业协会《证券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、《嘉实安心货币市场基金基金合同》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,本基金未发生异常交易行为。

4.4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

2012年3季度,央行并未如市场预期一般大幅放松货币政策,本季度没有降息也没有降准,央行仅通过逆回购滚动资金填补市场需求。尽管央行3季度累计通过逆回购在市场中投放了8340亿资金,但是逆回购的效果始终无法与降准等政策相比,且春加外汇占款出现趋势性逆转等因素的影响,3季度货币市场始终处于偏紧的状态。7天回购利率季度均值为3.44%,较2季度均值3.28%上行了16个基点。在资金利率推动下,3季度货币市场经历了一轮明显的收益率上行。银行间市场短期债券方面,1年期央票收益率从7月初2.5%附近一路攀升至3%以上,收益率上行50余基点。信用产品方面,1年期AA级别短期融资券7月初估值为3.4%,9月底前该级别短期融资券收益率高达4.3%,上行幅度达到90余基点。其他评级品种追随AA级别出现调整,AA-级别短期融资券收益率季度上行90余基点,AA级别短期融资券收益率上行80余基点。总体而言,政府出于种种考虑,提高了对经济下行的容忍度,3季度仍然延续了2012年上半年以来宏观经济下行的走势,货币政策实际操作中性偏紧,货币市场呈现不利于组合的走势。

2012年3季度,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以保证组合安全性为首要任务。操作中始终注意保持组合久期处于较低水平,并通过适时增加同业存款等高收益品种来提高组合静态收益。通过上述操作,本基金3季度顺利应对了市场的波动,保证了组合安全。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实安心货币A的基金份额净值收益率为0.5929%,嘉实安心货币B的基金份额净值收益率为0.6538%,同期业绩比较基准收益率为0.3408%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年4季度,政策走势仍将是影响货币市场的主要因素。在政府换届明朗化后,央行货币政策走势的变化值得我们密切关注。4季度从翘尾等因素看,不排除通胀出现反弹的可能性,因此不应对央行大幅放松货币政策抱有过高的期待。央行的意图应当是维持货币市场稳定即可,过松或过紧都不是目前央行希望见到的。需要密切关注的是十八大以后,随着新一代领导班子上任,央行的政策是否会有所转变。毕竟央行目前主推的逆回购或能缓解资金紧张,但难以降低资金价格,较高的资金利率会对信贷投放、信用债发行造成不利影响,从而影响经济复苏。针对上述复杂的市场环境,本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,继续保持较高的流动性资产配置,谨慎控制组合的信用配置,以应对利率上行风险和组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	119,696,133.18	15.90
	其中:债券	119,696,133.18	15.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	336,000,000.00	44.65
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	295,816,036.05	39.31
4	其他资产	1,072,268.66	0.14
	合计	752,584,437.89	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	24
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	65
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过75天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	79.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.33	-
3	60天(含)-90天	5.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	2.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.96	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	89,630,836.40	11.92
3	金融债券	10,027,760.41	1.33
	其中:政策性金融债	10,027,760.41	1.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,037,536.37	2.67
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
	合计	119,696,133.18	15.92
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	10,027,760.41	1.33

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101088	11央行票据88	700,000	69,736,962.81	9.28
2	1101094	11央行票据94	200,000	19,893,873.59	2.65
3	041254016	12长电CP002	100,000	10,042,347.45	1.34
4	110206	11国开06	100,000	10,027,760.41	1.33
5	041251015	12铁道CP001	100,000	9,995,188.92	1.33

注:报告期末本基金仅持有上述5只债券。

5.6 影子定价"与 摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25 (含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0555%
报告期内偏离度的最低值	-0.0205%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0209%

5.7 报告期末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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	11,676.39
3	应收利息	1,052,592.27
4	应收申购款	8,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	1,072,268.66

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
本报告期期初基金份额总额	81,254,448.73	705,373,331.60
本报告期基金总申购份额	50,595,278.62	828,643,825.07
减:本报告期基金总赎回份额	77,325,177.60	836,720,811.63
本报告期期末基金份额总额	54,524,549.75	697,296,345.04

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升级调增份额;总赎回份额含转换出及基金份额自动降级调减份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实安心货币市场基金募集的文件;

(2)《嘉实安心货币市场基金基金合同》;

(3)《嘉实安心货币市场基金招募说明书》;

(4)《嘉实安心货币市场基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实安心货币市场基金公告的各项原稿。

7.2 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

7.3 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
2012年10月26日

嘉实优质企业股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月26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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10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,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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实优质企业股票
基金主代码	070099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月8日
报告期末基金份额总额	9,413,866,720.53份
投资目标	力争为基金份额持有人创造长期超额收益
投资策略	在具备足够多、预期收益率良好的投资标的时优先考虑股票类资产配置,剩余配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资以自下而上的个股精选策略为主,结合行业配置适度均衡策略,构造和优化组合;通过新股申购、债券投资及衍生工具等投资策略,规避风险、增强收益。
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	较高风险,较高收益。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-60,927,311.59
2.本期利润	-220,609,380.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	8,174,387,725.80
5.期末基金份额净值	0.868

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	-2.69%	1.11%	-6.46%	1.13%	3.77%	-0.02%

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

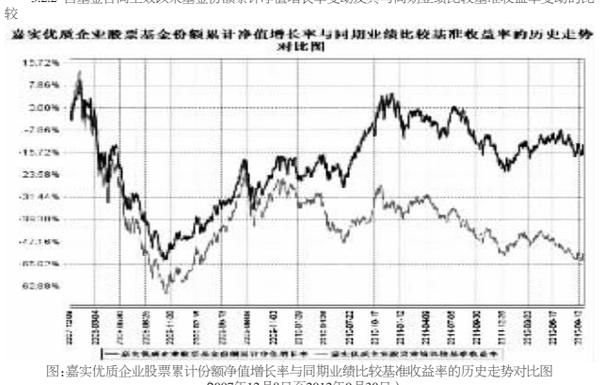

图:嘉实优质企业股票累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年12月8日至2012年9月30日)

注1:本基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日 (含当日)起,本基金基金合同生效,嘉实浦安保本基金基金合同失效。

注2:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3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第十八条 (二)投资范围和 八)投资组合比例限制)的规定:(1)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(3)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;(4)《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

§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		
刘天君	本基金基金经理,嘉实成长收益混合基金经理,公司股票投资部总监	2007年12月8日	-	11年	曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副总监、嘉实泰和封闭、嘉实成长收益混合基金经理。北京大学光华管理学院经济学硕士,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,离任日期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、《嘉实优质企业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,本基金未发生异常交易行为。

4.4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

报告期内,国内经济增速进一步放缓,通胀水平也进一步降低,但货币政策并未如预期继续放松,国内股票市场表现低迷。在中国经济进入减速增长的环境下,很多企业并未做好充足应对措施,仍然沿袭传统的 野蛮扩张"模式,经营状况日益严峻,但仍有少数企业保持了较好的经营态势。

报告期内,市场继续追捧业绩稳定的优质企业,抛弃经营状况不佳的企业。本基金在报告期内保持了对食品饮料、医药、家电等稳定成长性行业的超配,逢低增持地产板块以替代面临产能过剩压力的机械板块,整体而言取得了较好的效果。

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0.868元;本报告期基金份额净值增长率为-2.69%,业绩比较基准收益率为-6.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,中国经济仍将维持弱复苏态势,政府有望加快推进经济转型,面临产能过剩和需求不足的行业短期内难以扭转经营态势,有些行业则面临良好的发展机遇和经营环境。本基金认为随着市场的持续下跌,部分板块和行业已经具备较好的投资价值,因此将继续淡化仓位策略,积极选择优势行业,重点投资其中的优质企业,成长与价值并重,力争为持有人取得较好的长期回报。

§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	6,865,054,061.51	83.79
	其中:股票	6,865,054,061.51	83.79
2	固定收益投资	536,558,280.00	6.55
	其中:债券	536,558,280.00	6.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	775,854,804.59	9.47
6	其他资产	15,466,085.04	0.19
	合计	8,192,933,231.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	采掘业	100,256,000.00	1.23
C	制造业	5,903,051,950.78	72.21
C0	食品、饮料	2,085,891,946.00	25.52
C1	纺织、服装、皮毛	215,532,966.77	2.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	64,107,354.44	0.78
C5	电子	753,699,092.99	9.22
C6	金属、非金属	211,431,874.55	2.59
C7	机械、设备、仪表	1,630,887,789.29	19.95
C8	医药、生物制品	941,500,926.74	11.52
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,994,632.50	0.44
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,850,000.00	0.16
H	批发和零售贸易	123,501,753.24	1.51
I	金融、保险业	246,539,280.99	3.02
J	房地产业	346,335,473.60	4.24
K	社会服务业	56,146,064.80	0.69
L	传播与文化产业	40,378,905.60	0.49
M	综合类	-	-
	合计	6,865,054,061.51	83.98

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	000651	格力电器	32,530,743	695,507,285.34	8.51
2	000568	泸州老窖	15,034,019	578,809,731.50	7.08
3	002241	歌尔声学	11,857,127	442,152,265.83	5.41
4	000858	五 粮 液	12,719,196	431,180,744.40	5.27
5	600519	贵州茅台	1,600,000	393,280,000.00	4.81
6	600518	康美药业	20,000,000	316,400,000.00	3.87
7	601633	长城汽车	18,000,000	315,540,000.00	3.86
8	600048	保利地产	28,505,530	306,719,502.80	3.75
9	000538	云南白药	4,859,080	302,234,776.00	3.70
10	600887	伊利股份	13,902,927	296,132,345.10	3.62

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	405,933,000.00	4.97
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	130,625,280.00	1.60
8	其他	-	-
	合计	536,558,280.00	6.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1101094	11央行票据94	2,500,000	241,750,000.00	2.96
2	1101086	11央行票据86	1,400,000	135,212,000.00	1.65
3	113002	工行转债	817,280	82,545,280.00	1.01
4	113001	中行转债	500,000	48,080,000.00	0.59
5	1101079	11央行票据79	300,000	28,971,000.00	0.35

5.6 报告期末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

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名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,589,389.79
5	应收申购款	1,876,695.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	15,466,085.04

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	82,545,280.00	1.01
2	113001	中行转债	48,080,000.00	0.59

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	
本报告期期初基金份额总额	9,102,090,819.14
本报告期基金总申购份额	585,299,927.45
减:本报告期基金总赎回份额	273,524,026.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,413,866,720.53

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(1)中国证监会《关于核准嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字 [2007]320号);

(2)《嘉实优质企业股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实优质企业股票型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实优质企业股票型证券投资基金招募说明书》;

(5)《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

(6)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(7)报告期内嘉实优质企业股票型证券投资基金公告的各项原稿。

7.2 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

7.3 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
2012年10月26日

嘉实周期优选股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2012年10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,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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实周期优选股票
基金主代码	070027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月8日
报告期末基金份额总额	388,085,890.02份
投资目标	本基金精选周期行业的上市公司