嘉实研究精选股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:2013年1月21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2013年1月15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10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实研究精选股票
基金主代码	070013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月27日
报告期末基金份额总额	2,573,722,732.77份
投资目标	通过持续、系统、深入的基本面研究,挖掘企业内在价值,寻找具备长期增长潜力的上市公司,以获取基金资产长期稳定增值。
投资策略	优先考虑股票类资产的配置,采用“自下而上”的精选策略,定量分析与定性分析相结合的方法,精选个股,构建股票投资组合;剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产,债券投资采取“自上而下”的策略。
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	中国银行股份有限公司

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-55,316,963.82
2.本期利润	275,650,350.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.1097
4.期末基金资产净值	3,716,886,016.33
5.期末基金份额净值	1.444

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	8.00%	0.97%	9.56%	1.22%	-1.56%	-0.25%

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

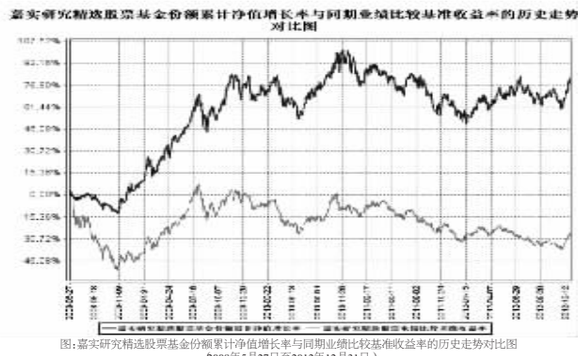

图:嘉实研究精选股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年5月27日至2012年12月31日)

注:按基金合同约定,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投资组合比例符合基金合同“十四、基金的投资(二)投资范围、(七)2.投资组合比例限制”的约定。

§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		
张弢	本基金基金经理,嘉实策略混合基金经理	2010年6月8日	-	9年	曾任兴安证券行业分析师。2005年9月加盟嘉实基金任行业分析师,曾任社保组合基金经理、嘉实增长混合基金经理。经济学硕士。CFA,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①任职日期、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、《嘉实研究精选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,中国经济呈现弱复苏态势,十八大之后政府加快推进经济和社会转型,提出了城镇化、反腐败等政策导向,股票市场给予积极回应,在历来较为平淡的12月份大幅反弹,金融地产、汽车、机械等低估值、周期性行业表现较好。报告期内,受塑化剂事件影响,白酒板块跌幅较大,对组合造成较大负面就。

本基金在报告期内适度增持了银行、汽车等早周期行业,重点减持了食品饮料,组合相对更趋均衡。由于报告期内白酒、医药等重仓板块表现不佳,本基金报告期业绩跑输基准和同业,但全年仍取得明显超额收益。

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0.902元;本报告期基金份额净值增长率为3.92%,业绩比较基准收益率为9.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,中国经济有望维持企稳回升的态势,主要拉动力仍将来自于政府主导的相关投资,短期内难以看到新的经济增长点,经济转型进展缓慢。美元仍将呈现弱势特征,从而助推全球流动性泛滥和资产价格上升,国内外CPI和PPI可能于年内明显反弹。

展望全年,A股市场有望延续去年年底的强势表现,尤其要关注影子银行的演变和社会资金成本的变化,国内外资金有望同时对市场形成正面因素。同时,地产价格反弹和物价上升也可能引致紧缩政策,对市场形成阶段性冲击。本基金将适当提升股票仓位,行业配置适度均衡,重点投资于兼具估值优势和成长空间的优质企业,力争持续为持有人获取超额收益。

§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	3,434,998,118.04	90.89
	其中:股票	3,434,998,118.04	90.89
2	固定收益投资	119,371,013.40	3.16
	其中:债券	119,371,013.40	3.16
	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	210,473,926.33	5.57
6	其他资产	14,618,672.65	0.39
	合计	3,779,461,730.42	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	-	-
C	制造业	1,833,937,061.60	49.34
C0	食品、饮料	378,207,600.91	10.18
C1	纺织、服装、皮毛	56,835,919.14	1.53
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	355,879,015.56	9.57
C5	电子	16,098,735.76	0.43
C6	金属、非金属	1,478,000.00	0.04
C7	机械、设备、仪表	768,838,677.58	20.69
C8	医药、生物制品	256,599,112.65	6.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	70,390,094.97	1.89
E	建筑业	70,030,508.36	1.88
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	63,117,617.52	1.70
H	批发和零售贸易	362,308,049.92	9.75
I	金融、保险业	728,028,542.07	19.59
J	房地产业	177,266,322.20	4.77
K	社会服务业	129,919,921.40	3.50
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,434,998,118.04	92.42

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	600315	上海家化	6,060,271	309,013,218.29	8.31
2	600036	招商银行	16,524,179	227,207,461.25	6.11
3	601166	兴业银行	12,910,546	215,477,012.74	5.80
4	600887	伊利股份	8,729,034	191,864,167.32	5.16
5	000513	丽珠集团	5,283,607	183,869,523.60	4.95
6	000651	格力电器	7,154,833	182,448,241.50	4.91
7	000002	万 科A	17,516,435	177,266,322.20	4.77
8	000895	双汇发展	2,863,767	165,812,109.30	4.46
9	601299	中国北车	35,768,870	161,317,603.70	4.34
10	600000	浦发银行	12,813,441	127,109,334.72	3.42

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	19,974,000.00	0.54
3	金融债券	90,036,000.00	2.42
	其中:政策性金融债	90,036,000.00	2.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,361,013.40	0.25
8	其他	-	-
	合计	119,371,013.40	3.21

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	120216	12国开16	900,000	90,036,000.00	2.42
2	1001060	10央行票据60	200,000	19,974,000.00	0.54
3	113002	工行转债	50,000	5,479,000.00	0.15
4	110015	石化转债	20,700	2,130,237.00	0.06
5	110013	国投转债	14,360	1,751,776.40	0.05

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	465,960.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,597,722.80
5	应收申购款	11,554,989.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	14,618,672.65

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	5,479,000.00	0.15
2	110015	石化转债	2,130,237.00	0.06
3	110013	国投转债	1,751,776.40	0.05

5.8.5 报告期末前十名股票中在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	000002	万 科A	177,266,322.20	4.77	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,238,428,500.97
本报告期基金总申购份额	636,597,395.77
减:本报告期基金总赎回份额	301,303,163.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,573,722,732.77

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)中国证监会核准嘉实研究精选股票型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实研究精选股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实研究精选股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实研究精选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)报告期内嘉实研究精选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
2013年1月21日

嘉实优质企业股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1月15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10月1日起至2012年12月31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	9,688,307,053.30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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-191,220,286.02
2.本期利润	325,661,296.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0344
4.期末基金资产净值	8,736,800,608.49
5.期末基金份额净值	0.902

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	3.92%	1.00%	9.56%	1.22%	-5.64%	-0.22%

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12月31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,中国经济呈现弱复苏态势,十八大之后政府加快推进经济和社会转型,提出了城镇化、反腐败等政策导向,股票市场给予积极回应,在历来较为平淡的12月份大幅反弹,金融地产、汽车、机械等低估值、周期性行业表现较好。报告期内,受塑化剂事件影响,白酒板块跌幅较大,对组合造成较大负面就。

本基金在报告期内适度增持了银行、汽车等早周期行业,重点减持了食品饮料,组合相对更趋均衡。由于报告期内白酒、医药等重仓板块表现不佳,本基金报告期业绩跑输基准和同业,但全年仍取得明显超额收益。

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0.902元;本报告期基金份额净值增长率为3.92%,业绩比较基准收益率为9.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,中国经济有望维持企稳回升的态势,主要拉动力仍将来自于政府主导的相关投资,短期内难以看到新的经济增长点,经济转型进展缓慢。美元仍将呈现弱势特征,从而助推全球流动性泛滥和资产价格上升,国内外CPI和PPI可能于年内明显反弹。

展望全年,A股市场有望延续去年年底的强势表现,尤其要关注影子银行的演变和社会资金成本的变化,国内外资金有望同时对市场形成正面因素。同时,地产价格反弹和物价上升也可能引致紧缩政策,对市场形成阶段性冲击。本基金将适当提升股票仓位,行业配置适度均衡,重点投资于兼具估值优势和成长空间的优质企业,力争持续为持有人获取超额收益。

§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	7,320,566,153.57	82.17
	其中:股票	7,320,566,153.57	82.17
2	固定收益投资	673,034,842.60	7.55
	其中:债券	673,034,842.60	7.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	660,000,000.00	7.41
	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	217,534,310.62	2.44
6	其他资产	37,516,271.89	0.42
	合计	8,908,651,578.68	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	258,521,456.10	2.96
C	制造业	5,961,673,424.17	68.24
C0	食品、饮料	1,474,770,193.98	16.88
C1	纺织、服装、皮毛	215,860,426.06	2.47
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	72,404,454.70	0.83
C5	电子	902,799,685.65	10.33
C6	金属、非金属	214,390,289.50	2.45
C7	机械、设备、仪表	1,998,992,164.92	22.88
C8	医药、生物制品	1,082,456,209.36	12.39
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	173,198,390.30	1.98
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,900,000.00	0.18
H	批发和零售贸易	47,920,000.00	0.55
I	金融、保险业	484,790,970.00	5.55
J	房地产业	283,522,525.00	3.25
K	社会服务业	45,000,000.00	0.52
L	传播与文化产业	50,039,388.00	0.57
M	综合类	-	-
	合计	7,320,566,153.57	83.79

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	30,000,000	765,000,000.00	8.76
2	002241	歌尔声学	12,993,661	489,861,019.70	5.61
3	000568	泸州老窖	12,000,000	424,800,000.00	4.86
4	601633	长城汽车	17,875,917	423,659,232.90	4.85
5	600519	贵州茅台	2,000,000	418,040,000.00	4.78
6	000538	云南白药	6,032,433	410,205,444.00	4.70
7	000423	东阿阿胶	8,659,331	349,923,565.71	4.01
8	002236	大华股份	6,633,063	307,442,470.05	3.52
9	600048	保利地产	20,000,000	272,000,000.00	3.11
10	600887	伊利股份	12,031,401	264,450,193.98	3.03

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	129,831,000.00	1.49
3	金融债券	289,734,000.00	3.32
	其中:政策性金融债	289,734,000.00	3.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	253,469,842.60	2.90
8	其他	-	-
	合计	673,034,842.60	7.70

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	113002	工行转债	1,873,470	205,294,842.60	2.35
2	120245	12国开45	1,500,000	149,760,000.00	1.71
3	1001060	10央行票据60	1,300,000	129,831,000.00	1.49
4	120318	12进出18	1,000,000	100,030,000.00	1.14
5	113001	中行转债	500,000	48,175,000.00	0.55

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	3,931,343.83
5	应收申购款	32,584,928.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	37,516,271.89

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	205,294,842.60	2.35
2	113001	中行转债	48,175,000.00	0.55

5.8.5 报告期末前十名股票中在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

本报告期期初基金份额总额	9,413,866,720.53
本报告期基金总申购份额	816,233,944.67
减:本报告期基金总赎回份额	541,793,611.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,688,307,053.30

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
2013年1月21日

嘉实主题精选混合型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:2013年1月21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2013年1月15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10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21日
报告期末基金份额总额	7,833,234,627.29份
投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用“主题投资策略”,从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合,并优先考虑股票类资产的配置,剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×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	中国银行股份有限公司

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	87,912,823.00
2.本期利润	432,323,674.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0550
4.期末基金资产净值	9,331,060,045.46
5.期末基金份额净值	1.191

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	4.84%	0.72%	9.53%	1.22%	-4.69%	-0.50%

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:嘉实主题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
(2006年7月21日至2012年12月31日)

注:按基金合同约定,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第十四条(二)投资范围、(八)2.投资组合比例限制的约定:①)资产配置范围为:股票资产30%-95%,债券0-70%,权证0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;②)持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;③)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;④)在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五;⑤)持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的3%;⑥)法律法规和基金合同规定的其他限制。

§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		
马惠明	本基金基金经理	2012年3月7日	-	10年	曾任加拿大HCL衍生品经纪公司分析师。2004年10月加盟嘉实基金管理有限公司,曾任行业分析师、投资经理、公司机构投资部副总监。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①)任职日期、离任日期是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、《嘉实主题精选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