

嘉实增长开放式证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月19日

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。
基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年4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预示其未来表现,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基为嘉实理财增值系列证券投资基金之一,嘉实理财增值系列证券投资基金由具有不同市场定位的三个基金构成,包括包括在内的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金,每只基金均为契约型开放式,适用一个基金合同和招募说明书。
本报告期自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	嘉实增长混合
交易代码	070002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月1日
报告期末基金份额总额	867,259,538.43份
投资目标	投资于具有良好成长潜力的中小企业上市公司,以获取资本增值的机会,并谋求基金资产的长期增值,同时通过分散投资降低基金资产的流动性。
投资策略	以公募基金资产配置人于挑选具有成长性个股,重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的中小企业上市公司,分散投资于其他行业,投资比例范围为股票40%-70%,现金5%-10%,债券及货币类资产0-30%左右。
业绩比较基准	日经600+小盘+指数
风险收益特征	本基金属于中高风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基准收益的波动率不超过5.5%。
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

5.3 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(2013年1月1日—2013年3月31日)		
1.本期已实现收益	-86,665,766.97		
2.本期利润	253,499,092.69		
3.加权平均基金份额本期利润	0.2868		
4.期末基金资产净值	4,230,677,205.41		
5.期末基金份额净值	4.875		

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,计入费用后将实际收益水平降低约1%左右。

3.2 基金净值表现		单位:人民币元	
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③
过去三个月	6.13%	1.69%	5.96%
过去六个月	1.46%	0.19%	-0.41%

5.3.2 基金净值表现:本基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

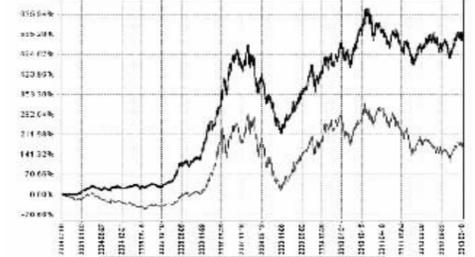


图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年7月19日至2013年3月31日)

注:本基金合同规定,本基金基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期间本基金各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四)一投资范围(即)各基金投资组合比例限制的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值80%;(2)任何一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,不得超过该证券市值的10%;(4)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的1%;(5)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券市值的10%;(6)法律法规及监管部门规定的其他比例限制。

5.4 管理人介绍

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王鹏	基金经理
王鹏	基金经理

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《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人及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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规,《嘉实理财增值系列证券投资基金资产管理合同》和《嘉实增长证券投资基金和嘉实债券证券投资基金合同》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。本基金运作符合有关法律法规和基金合同约定的投资范围,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
报告期内,本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,各投资组合按照投资管理政策和流程独立决策,并在获得投资建议、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制度,严格的流程控制、持续的监控改进,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,公平对待所有投资组合。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2012年—季度,在经济复苏与政策调控的激励下,中国股市市场是强劲上扬,此后,由于经济复苏力度弱于预期,以及政府对于房地产调控政策的加码,市场基本回调并筑底,从整个季度来看,结构分化十分明显,医药、电子、环保等先行行业表现出色,一些增长迅速的消费品行业,也呈现出较强的韧性,但整体来看,市场在震荡中前行,有望保持较好的增长势头,我们看好经济复苏和消费升级带来的投资机会,我们将继续看好医药、电子、环保等行业,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2012年—季度,在经济复苏与政策调控的激励下,中国股市市场是强劲上扬,此后,由于经济复苏力度弱于预期,以及政府对于房地产调控政策的加码,市场基本回调并筑底,从整个季度来看,结构分化十分明显,医药、电子、环保等先行行业表现出色,一些增长迅速的消费品行业,也呈现出较强的韧性,但整体来看,市场在震荡中前行,有望保持较好的增长势头,我们看好经济复苏和消费升级带来的投资机会,我们将继续看好医药、电子、环保等行业,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2012年—季度,在经济复苏与政策调控的激励下,中国股市市场是强劲上扬,此后,由于经济复苏力度弱于预期,以及政府对于房地产调控政策的加码,市场基本回调并筑底,从整个季度来看,结构分化十分明显,医药、电子、环保等先行行业表现出色,一些增长迅速的消费品行业,也呈现出较强的韧性,但整体来看,市场在震荡中前行,有望保持较好的增长势头,我们看好经济复苏和消费升级带来的投资机会,我们将继续看好医药、电子、环保等行业,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股,看好具有良好成长性的个股。

5.5 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	2,911,655,873.50	69.01
2	固定收益投资	946,961,073.60	22.30
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	264,179,949.99	6.27
6	其他资产	104,921,887.56	2.42
合计		4,247,118,826.65	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	1,779,367,282.29	42.06
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	96,862,563.34	2.29
F	批发和零售业	6,369,923.56	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	329,518,918.87	7.79
J	金融业	156,264,452.72	3.69
K	房地产业	142,162,531.40	3.30
L	租赁和商务服务业	-	-
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	卫生和社公业	690,404.10	0.02
R	文化、体育和娱乐业	48,487,223.24	1.15
S	综合	371,332,182.65	8.78
合计		2,911,655,873.50	69.01

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	600256	广晟矿业	17,523,935	173,231,826.65	8.78
2	600518	康美药业	20,484,072	359,299,222.88	8.49
3	000661	际华集团	283,433,333	283,433,333.34	6.96
4	600817	东安动力	2,199,761	209,992,641.32	4.96
5	600887	伊泰股份	5,429,234	171,713,013.12	4.06
6	601166	兴业银行	7,699,206	133,040,530.80	3.14
7	002410	广联达	5,174,763	117,467,120.30	2.79
8	600855	海康电子	6,152,175	111,959,922.75	2.63
9	600870	恒宝电子	8,638,107	109,331,563.34	2.63
10	000999	华鲁三九	2,979,889	95,323,488.60	2.25

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

序号	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	89,982,000.00	2.13
2	金融债	800,909,000.00	18.93
3	企业债	800,909,000.00	18.93
4	企业短期融资券	50,422,000.00	1.19
5	中期票据	-	-
6	可转债	5,648,073.60	0.13
7	其他	99,960,000.00	2.36
合计		946,961,073.60	22.38

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

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	120215	12国债15	2,100,000	210,420,000.00	4.97
2	090407	09央行07	1,400,000	141,036,000.00	3.33
3	120212	12国债12	1,200,000	119,280,000.00	2.82
4	120218	12国债18	1,100,000	109,960,000.00	2.60
5	120202	12国债02	1,000,000	99,960,000.00	2.36

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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资组合报告情况

报告期末,本基金未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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十名证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.9.2 报告期内,本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	1,584,621.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,182,903.57
5	应收申购款	2,562,419.67
6	待转款项	-
7	其他	-
8	其他	-
合计		13,299,944.45

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有可转换债券。

5.9.5 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的情况。

5.9.6 开放式基金份额变动

单位:份	
本报告期初基金份额总额	1,761,276,912.23
本报告期间基金总申购	217,375,927.22
本报告期间基金总赎回	162,407,472.82
本报告期间基金净申购	154,968,449.40
本报告期末基金份额总额	1,916,245,362.53

注:报告期末基金份额总额含红利再投资份额、基金总申购份额含转换转入份额。

5.10 本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	108,411,703.84	9.08
2	固定收益投资	1,021,719,953.36	85.54
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	33,373,921.07	2.80
6	其他资产	28,888,178.01	2.43
合计		1,192,383,756.28	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	69,904,014.04	9.31
D	电力、热力、燃气及生产供应业	3,868,400.00	0.32
E	建筑业	5,996,971.28	0.79
F	批发和零售业	12,691,658.36	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	4,543,223.06	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	11,807,300.00	1.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		108,411,703.84	14.44

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	600155	上海医药	208,417	14,611,200.00	1.95
2	601166	兴业银行	59,000	1,046,000.00	1.13
3	000513	荣盛石化	28,562	8,269,470.00	1.10
4	600887	伊泰股份	19,352	7,879,471.36	1.03
5	000895	双发	49,337	7,648,620.00	1.02
6	600858	海康电子	47,345	7,671,562.25	1.02
7	000063	中兴通讯	60,200	6,729,000.00	0.90
8	000021	深华新	161,606	5,796,921.20	0.75
9	600307	交银国际	288,000	3,808,000.00	0.50
10	600333	润兴股份	200,400	3,448,672.00	0.45

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

序号	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	76,143,000.00	9.35
2	金融债	713,430,000.00	9.35
3	企业债	162,150,764.00	82.76
4	企业短期融资券	140,957,000.00	18.78
5	中期票据	20,944,000.00	2.71
6	可转债	169,153,978.96	22.84
7	其他	-	-
8	其他	-	-
合计		1,021,719,953.36	136.13

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

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	110015	11国债15	638,200	71,562,188.00	9.33
2	120218	12国债18	400,000	39,800,000.00	5.33
3	120028	12国债08	279,130	34,699,276.40	4.62
4	120208	09国债08	300,000	31,266,000.00	4.17
5	120047	12国债04	300,000	31,160,000.00	4.15

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五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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资组合报告情况

报告期末,本基金未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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十名证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.9.2 本基金投资的十名股票,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	233,163.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,615,898.36
5	应收申购款	9,039,173.83
6	待转款项	-
7	其他	-
8	其他	-
合计		28,888,178.01

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有可转换债券。

5.9.5 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的情况。

5.9.6 开放式基金份额变动

单位:份		
本报告期初基金份额总额	367,899,548.35	376,233,471.04
本报告期间基金总申购	39,077,844.15	86,141,814.56
本报告期间基金总赎回	66,727,248.98	120,163,364.94
本报告期间基金净申购	2,189,143.52	2,110,920.66
本报告期末基金份额总额	370,088,691.87	378,344,391.60

注:报告期末基金份额总额含红利再投资份额、基金总申购份额含转换转入份额。

5.10 本报告期末基金资产组合情况