丰和价值证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实丰和价值封闭(场内简称：基金丰和)
基金主代码	184721
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年3月22日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
投资目标	本基金为价值型证券投资基金，主要投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资方法，在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金在股票、固债上的投资比例。坚持价值型投资理念，确立以相对价值判断为核心，兼顾对公司内在价值评估的选股思路；同时，以基本分析为基础，重视数量分析，系统考察上市公司的投资价值，最终确定所投资的股票，并以技术分析辅助个股投资的时机选择。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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（2013年7月1日 - 2013年9月30日）
1.本期已实现收益	61,480,567.17
2.本期利润	234,419,736.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0781
4.期末基金资产净值	3,211,744,059.41
5.期末基金份额净值	1.0706

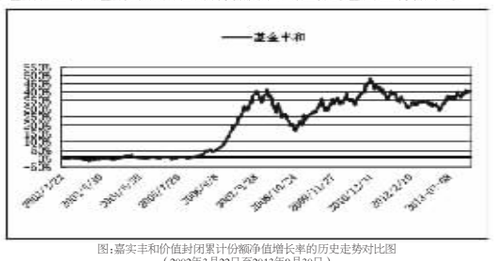
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.88%	1.88%				

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：嘉实丰和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图
（2002年3月22日至2013年9月30日）

注：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（七、(四)投资组合）的有关约定：（1）本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的80%，投资于国债的比重不低于基金资产净值的20%；（2）本基金投资于一家上市公司的股票，不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公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；（4）本基金股票投资组合的平均B/P值高于沪深A股市场的平均B/P值；（5）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

§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		
顾义河	本基金基金经理、嘉实价值优势股票基金经理	2009年6月17日	-	13年	曾任职于中银国际控股有限公司，2002年9月加盟嘉实基金管理有限公司，先后任分析师、高级分析师。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、《丰和价值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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场整体上涨，结构分化继续延续。风格上，创业板继续大幅跑赢中证500，中证500继续大幅跑赢沪深300及上证50。

从经济方面看，我们认为：第一，本季度宏观经济增速出现回升，市场对于企业盈利增长的担忧有所缓解；第二，政府政策出现放松的迹象，鼓励文化传媒发展、加大新能源补贴、推进自贸区建设等都推动了市场上涨；第三，海外方面，美联储量化宽松政策退出步伐低于预期，资金流出预期对A股流动性环境的负面影响减小。

从资金面的供求状况看，新股技术性停发，管理层鼓励上市公司通过多种手段并购拟上市公司等政策都短期内缓解了市场的供给压力，但从中长期看，市场的正常融资功能必将恢复，市场扩容和大小非减持将持续对市场构成压制，而流动性三季度相对宽松，有利资本市场。

综观三季度，成长股表现相对较好，传媒、计算机应用、电子元器件、信息设备、生物医药、乳业等行业表现较优，自贸区、商业贸易等投资主题也较为抢眼，而强周期行业如煤炭、有色、建材、钢铁以及金融板块都显著跑输。

本基金报告期内持续超配必需消费、医药、家电、汽车等板块，逐步降低了对估值进入合理区间上限的海油工程、传媒、环保等行业的配置，增持了新能源、装饰，在市场上涨过程中兑现了部分收益。

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1.0706元，本报告期基金份额净值增长率为7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，我们认为：首先，产业调整、扩大内需、振兴民族产业等政策取向将继续延续，GDP增速预期区间将企稳，传统企业的盈利能力将继续受到质疑，新经济增长点也将持续，但我们认为行业内的分化也将加大；其次，国家财政支付能力压力、地方政府债务等问题将继续限制宏观政策调整空间，而三中全会后的政策调整方向非常引人注意；再次，企业首发及再融资进展、大小非减持力度将继续对市场形成较大的供给压力；最后，大国博弈、美国QE退出等事件将继续对国内市场形成间接影响。

综合来看，我们认为市场四季度将继续呈现结构分化的局面，我们将继续淡化仓位，继续持有食品饮料、医药、装饰、汽车、软件等行业，择机增持受益中国经济转型的行业及精选个股。

§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	2,517,284,071.07	78.16
	其中：股票	2,517,284,071.07	78.16
2	固定收益投资	655,863,000.00	20.36
	其中：债券	655,863,000.00	20.36
	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	36,224,591.81	1.12
6	其他资产	11,384,301.00	0.35
	合计	3,220,755,963.88	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	94,131,775.63	2.93
C	制造业	1,278,231,142.92	39.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,806,508.28	0.90
E	建筑业	239,542,282.85	7.46
F	批发和零售业	131,318,298.56	4.09
G	交通运输、仓储和邮政业	32,390,000.00	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,369,596.15	3.50
J	金融业	126,947,473.91	3.95
K	房地产业	239,291,190.86	7.45
L	租赁和商务服务业	173,207,429.91	5.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	61,048,372.00	1.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,517,284,071.07	78.38

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	600887	伊利股份	6,348,920	283,669,745.60	8.83
2	002081	金螳螂	9,103,040	199,538,636.80	6.21
3	002400	省广股份	3,944,601	173,207,429.91	5.39
4	000028	国药一致	3,120,682	131,318,298.56	4.09
5	000625	长安汽车	11,185,231	115,207,879.30	3.59
6	600340	华夏幸福	3,044,210	98,875,940.80	3.08
7	000651	格力电器	3,693,702	98,104,725.12	3.05
8	002020	京新药业	6,062,822	91,851,753.30	2.86
9	600309	万华化学	5,438,698	88,378,842.50	2.75
10	000002	万 科A	9,370,117	85,549,168.21	2.66

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	179,062,000.00	5.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	476,801,000.00	14.85
	其中：政策性金融债	476,801,000.00	14.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	655,863,000.00	20.42

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	120245	12国开45	900,000	89,874,000.00	2.80
2	130201	13国开01	700,000	69,825,000.00	2.17
3	130218	13国开18	700,000	69,531,000.00	2.16
4	110015	11附息国债15	500,000	49,940,000.00	1.55
5	110019	11附息国债19	500,000	49,730,000.00	1.55

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	958,087.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,426,213.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	11,384,301.00

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存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	002400	省广股份	173,207,429.91	5.39	重大事项停牌

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

份额单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	12,010,000.00
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	12,010,000.00
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准丰和价值证券投资基金设立的文件；

（2）《丰和价值证券投资基金基金合同》；

（3）《丰和价值证券投资基金招募说明书》；

（4）《丰和价值证券投资基金基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内丰和价值证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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10月24日

嘉实主题精选混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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：2013年10月24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10月22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2013年7月1日起至2013年9月30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	6,704,761,999.86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（2013年7月1日 - 2013年9月30日）
1.本期已实现收益	23,873,323.87
2.本期利润	523,071,453.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0752
4.期末基金资产净值	7,458,289,624.57
5.期末基金份额净值	1.112

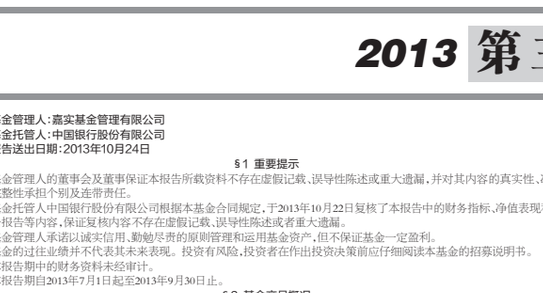
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.23%	0.58%	9.02%	1.36%	-1.79%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2013年9月30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	-	11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运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度经济层面波澜不惊，2季度企业受流动性以及对经济前景的悲观预期影响加大了去库存，导致经济有个阶段性的低点，而3季度经济略有反弹，目前看长期低位盘整的趋势并未结束。在政府的货币政策支持下影子银行等表外业务仍是愈演愈烈，市场总体流动性还是比较宽松的，而在政府加大转型的政策预期刺激下，主题性投资机会层出不穷，尤其是以信息化为核心的题材板块获得了资金的青睐。3季度上证上涨10%，而创业板涨幅高达35%，表现最好的是计算机软硬件板块，涨幅达到55%，反映了社会向信息化转型的预期以及美国"棱镜门事件"后国家对信息安全的高度重视；表现其次的是长期低迷的交通运输板块，主要是自贸区概念带动的；其他表现好的还有房地产、医药、农业、通信以及家电零售等。我们认为经济下行趋势仍未结束，房地产的泡沫化问题可能最终还是要解决，而工业企业的去杠杆和去产能则刚刚开始，周期性板块的缺乏机会以及中小创业板的估值高企都是问题，总体上3季度本基金持续保持较低仓位。

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1.112元；本报告期基金份额净值增长率为7.23%，业绩比较基准收益率为9.02%。

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4季度，经济增长在需求端很难再看到刺激性因素，而结构性改革的进行势必对现有产业格局带来冲击，改革是一定会付出成本的，可能会在地产产业链或者在其他制造业产业链。目前看，一线房地产市场可能会是个关键的观察因素，地王频出，价格高企，而房贷等资金面正在全面收紧，可能明年会出现大的价格调整。从流动性角度看，目前央行对短期银行间市场的把控方向还是较为宽松的，也就是个中性的思路，而海外来看美国经济低于预期（也许原先一直就是高估的），大幅度退出QE的概率已经大大降低，对市场预期影响可能不会太大。从短期现实看，IPO的重启可能会对创业板等题材板块带来比较大的冲击，不排除创业板见顶的可能，本基金将积极寻找新兴行业板块下跌中的配置机会。经济无亮点，而新兴板块估值高企，本基金仍旧维持较低仓位，并着眼于长期，将在节能环保、生物医药、软件、军工、基础消费品以及移动互联网络、高端装备等板块寻找长期的主题类投资机会。

§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	3,184,070,810.29	42.54
	其中：股票	3,184,070,810.29	42.54
2	固定收益投资	398,156,000.00	5.32
	其中：债券	398,156,000.00	5.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,233,642,425.81	29.85
	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	1,652,383,396.98	22.08
6	其他资产	15,820,185.04	0.21
	合计	7,484,072,818.12	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	238,177,788.00	3.19
B	采矿业	30,025,000.00	0.40
C	制造业	2,583,107,441.53	34.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,061,119.54	0.86
F	批发和零售业	96,255,718.72	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,275,988.32	0.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,696,167.74	0.08
M	科学研究和技术服务业	637,500.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	143,834,086.44	1.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,184,070,810.29	42.69

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	600887	伊利股份	16,450,850	735,023,978.00	9.86
2	600518	康美药业	30,883,473	578,447,449.29	7.76
3	300273	和佳股份	10,622,634	254,730,763.32	3.42
4	000998	隆平高科	10,355,556	238,177,788.00	3.19
5	002038	双鹭药业	4,103,630	229,187,735.50	3.07
6	000538	云南白药	1,500,000	175,590,000.00	2.35
7	300144	宋城股份	7,030,014	143,834,086.44	1.93
8	300146	汤臣倍健	1,220,572	80,557,752.00	1.08
9	002317	众生药业	3,067,611	74,205,510.09	0.99
10	000915	山大华特	1,321,936	48,065,592.96	0.64

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	59,515,000.00	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	338,641,000.00	4.54
	其中：政策性金融债	338,641,000.00	4.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	398,156,000.00	5.34

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	130218	13国开18	1,300,000	129,129,000.00	1.73
2	120245	12国开45	900,000	89,874,000.00	1.21
3	120019	12附息国债19	500,000	49,985,000.00	0.67
4	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	0.67
5	130227	13国开27	400,000	39,820,000.00	0.53

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,429,035.24
2	应收证券清算款	143,351.32
3	应收股利	-
4	应收利息	9,507,703.04
5	应收申购款	740,095.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	15,820,185.04

5.10.4 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。

5.10.5 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

报告期期初基金份额总额	7,153,204,073.27
报告期期间基金总申购份额	123,128,502.76
减：报告期期间基金总赎回份额	571,570,576.17
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,704,761,999.86

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准嘉实主题精选混合型证券投资基金募集的文件；

（2）《嘉实主题精选混合型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实主题精选混合型证券投资基金招募说明书》；

（4）《嘉实主题精选混合型证券投资基金基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实主题精选混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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10月24日

嘉实成长收益证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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：2013年10月24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10月22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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月5日
报告期末基金份额总额	7,803,966,192.14份
投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金，在获取稳定的现金收益的基础上，积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现"稳定收益"的目标；同时通过实施"行业优选、积极轮换"的策略，实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的贝塔值不超过0.75。在此前提下，本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的65%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。
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（2013年7月1日 - 2013年9月30日）
1.本期已实现收益	334,214,025.32
2.本期利润	628,303,135.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1057
4.期末基金资产净值	5,318,419,496.85
5.期末基金份额净值	0.6815

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	15.31%	1.00%	9.90%	1.14%	5.41%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：嘉实成长收益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
（2002年11月5日至2013年9月30日）

注：按基金合同规定，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十八条（（二）投资范围和（六）投资组合比例限制）的约定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；（2）持有一家公司的股票，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公