嘉实增长开放式证券投资基金

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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立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	嘉实增长混合
基金主代码	070002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	697,395,488.80份
投资目标	投资于具有高速或长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。
投资策略	从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票,重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,投资组合比例范围为股票40%~75%,债券20%~55%,现金5%左右。
业绩比较基准	巨潮500(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金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。
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	139,065,869.59
2.本期利润	292,808,464.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.3944
4.期末基金资产净值	3,761,473,924.31
5.期末基金份额净值	5.394

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	7.77%	1.18%	22.11%	1.38%	-14.34%	-0.20%

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

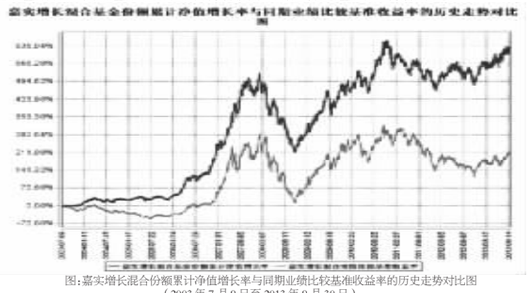


图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年7月9日至2013年9月30日)

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各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)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)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)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		
邵健	本基金、嘉实优质企业股票基金经理,公司总经理助理	2004年4月6日	-	15年	曾任职于国泰君安证券研究所,历任研究员、行业投资策略组组长、行业公司部副经理,从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003年7月加盟嘉实基金。经济学硕士,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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨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 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为5.394元;本报告期基金份额净值增长率为7.77%,业绩比较基准收益率为22.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们判断中国经济增速企稳后上行空间有限,外围11-12月份QE所释放的流动性可能有所回收。资本市场方面IPO重启临近,因此,A股指数整体上在四季度面临一定压力。另一方面,中共十八届三中全会前后,改革与转型仍将成为市场关注的中心,未来的改革可能在金融、财税、国企和土地等领域进一步展开。在指数缺乏机会的情况下,改革创新带来的结构性机会将凸显。

结合上述环境,我们总体仍将保持在电子、食品、医药、传媒、天然气、化工新材料等行业的超配,继续加强甄别,在其中优选商业模式较好、核心竞争力强、动态估值较低的企业进行投资,同时寻找一些在改革预期中有望获得长期增长的企业,力争为投资人获得良好的回报。

§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	2,589,533,436.14	68.55
	其中:股票	2,589,533,436.14	68.55
2	固定收益投资	886,441,243.10	23.47
	其中:债券	886,441,243.10	23.47
	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	112,666,985.34	2.98
6	其他资产	188,933,839.40	5.00
	合计	3,777,575,503.98	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	4,380,258.00	0.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,498,079,984.09	39.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	67,520,344.66	1.80
F	批发和零售业	-	-
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	706,064,627.69	18.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,458,639.90	0.12
L	租赁和商务服务业	8,111,136.60	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,504,645.30	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,144,649.87	0.03
R	文化、体育和娱乐业	151,013,892.91	4.01
S	综合	133,255,257.12	3.54
	合计	2,589,533,436.14	68.84

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	600518	康美药业	12,357,023	231,447,040.79	6.15
2	002450	康得新	9,280,602	222,548,835.96	5.92
3	002241	歌尔声学	4,810,919	203,405,655.32	5.41
4	600887	伊利股份	4,226,547	188,842,119.96	5.02
5	600570	恒生电子	7,188,935	154,993,438.60	4.12
6	300133	华策影视	3,729,659	151,013,892.91	4.01
7	600315	上海家化	3,451,430	149,826,576.30	3.98
8	600256	广汇能源	14,116,023	133,255,257.12	3.54
9	002439	启明星辰	4,634,801	126,947,199.39	3.37
10	300104	乐视网	3,637,187	124,610,026.62	3.31

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	-	-
3	金融债券	884,006,000.00	23.50
	其中:政策性金融债	884,006,000.00	23.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,435,243.10	0.06
8	其他	-	-
	合计	886,441,243.10	23.57

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	120215	12国开15	2,100,000	207,522,000.00	5.52
2	090407	09农发07	1,400,000	140,168,000.00	3.73
3	130201	13国开01	1,200,000	119,700,000.00	3.18
4	120212	12国开12	1,200,000	118,056,000.00	3.14
5	130218	13国开18	1,000,000	99,330,000.00	2.64

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	1,288,476.37
2	应收证券清算款	171,857,402.30
3	应收股利	-
4	应收利息	14,897,068.22
5	应收申购款	890,892.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	188,933,839.40

5.10.4 报告期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	110023	民生转债	2,381,783.10	0.06
2	110022	同仁转债	53,460.00	0.00

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	300104	乐视网	124,610,026.62	3.31	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	780,291,509.63
报告期期间基金总申购份额	22,892,767.68
减:报告期期间基金总赎回份额	105,788,788.51
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	697,395,488.80

注:报告期期间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理财通系列开放式证券投资基金设立的文件;

(2)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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合同》;

(3)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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招募说明书》;

(4)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨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)报告期内嘉实增长开放式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

嘉实多元收益债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	嘉实多元债券	
基金主代码	070015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年9月10日	
报告期末基金份额总额	589,877,508.30份	
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过谋求较高的当期收益,力争资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的单个证券选择计划组成。根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等动态分析,决定债券类、权益类资产配置比例。债券类投资采取积极主动的投资策略包括确定债券组合久期、债券组合期限结构及类属配置、单个资产选择,权益类投资作为辅助和补充,其最重要因素是本金安全。	
业绩比较基准	中央国债登记结算公司的中国债券总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
下属两级基金的交易代码	070015	070016
报告期末下属两级基金的份额总额	352,686,768.52份	237,190,739.78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(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
1.本期已实现收益	6,345,530.73	4,295,267.78
2.本期利润	-546,078.10	-479,292.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0015	-0.0018
4.期末基金资产净值	383,558,942.22	256,181,773.04
5.期末基金份额净值	1.088	1.080

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)嘉实多元债券A收取认(申)购费和赎回费,嘉实多元债券B不收取认(申)购费和赎回费但计提销售服务费。(3)所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

嘉实多元债券A

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	-0.09%	0.11%	-1.83%	0.10%	1.74%	0.01%

嘉实多元债券B

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	-0.18%	0.10%	-1.83%	0.10%	1.65%	0.00%

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

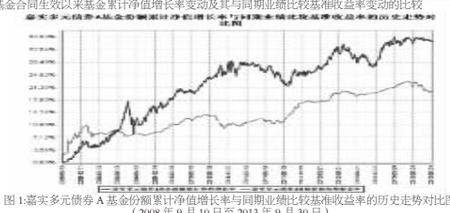


图1:嘉实多元债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年9月10日至2013年9月30日)

图2:嘉实多元债券B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9月10日至2013年9月30日)

注:根据本基金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投资组合比例符合基金合同"第十一部分基金的投资二、投资范围五(二)投资组合限制"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		
王茜	本基金基金经理、嘉实多利分级债券基金经理、公司固定收益部总监。	2009年2月13日	-	11年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理,中信证券固定收益部、长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008年11月加盟嘉实基金。工商管理硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职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、《嘉实多元收益债券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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度回顾:自6月份开始至8月份,经济数据出现超预期回升。以工业增加值为例,当月增速由6月份的8.9%回升至8月份的10.4%。我们认为,从库存周期规律来讲近期经济回升的动力主要来自于原材料库存的回补,体现在PMI指标中为原材料库存有所回升,而同时或品库存有所回落。从主要动力分解来看,政策托底效应有所体现,基建投资当月增速在8月份创出近几年新高。

在基本面阶段性好于预期的同时,央行货币政策呈现出中性偏紧的态度,也在一定程度上超出此前的市场预期。同时叠加3季度利率债供给增加的因素,因此整体来看3季度债券市场出现了一定幅度的调整。而权益类市场表现相对较好,基本面因素来自于经济阶段性回升,同时市场对改革寄予了较为乐观的预期。

操作上,三季度我们整体以稳健为主,权益资产没有过多参与;纯债资产方面整体以谨慎为主,保持了中性偏低的杠杆水平,在结构上逐步小幅增加了利率品配置比例,信用债方面仍然采取自下而上精选中高等级个券的操作思路。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实多元债券A基金份额净值为1.088元,本报告期基金份额净值增长率为-0.09%;截至报告期末嘉实多元债券B基金份额净值为1.080元,本报告期基金份额净值增长率为-0.18%;同期业绩比较基准收益率为-1.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度展望:我们认为3季度出现的经济阶段性回升并不可持续,同比增速可能会重新出现小幅回落。理由包括:3季度的库存回补,可能只是前期持续去库存之后的阶段性反弹。而从一个更长周期来看,我们以负债率以及库存占成本比重来看,我国经济还没有出现真正意义上的去杠杆、去库存调整。因此短周期的库存回补会反复出现,但是很难持续。基建增速回升在前期对经济起到托底作用,但我们认为政策意图也仅仅在于托底,并非想重新进行高快投资。因此在基建投资经历前期的明显恢复之后,4季度的边际贡献将有所下降。地产投资已经开始显出颓势,预计未来会延续。从历史上来看地产投资大体滞后销量2-3个季度,而本轮地产周期的销量高点在去年末、今年初已经出现,因此对于地产投资的推动也已经到达高点。

随着经济到达阶段性高点的迹象逐渐明确,且通胀及资金面较为稳定,我们认为债券市场前期的负面因素有所缓解,经济重新小幅回落可能构成阶段性的正面因素。整体来看利率品种可能存在阶段性的战术性机会,但是由于基本面整体波动幅度并不大,因此机会可能非常有限。信用品种仍然坚持较短久期,较高等级的偏防御策略。

对于权益类资产,我们认为当前市场对于阶段性的经济回升,以及未来的改革预期都已经反应的比较充分,进一步上涨的空间比较有限。在出现风险释放之后我们会积极关注其中的个股机会。

§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	5,870,204.07	0.76
	其中:股票	5,870,204.07	0.76
2	固定收益投资	729,111,025.36	94.80
	其中:债券	729,111,025.36	94.80
	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	19,648,937.36	2.55
6	其他资产	14,447,058.25	1.88
	合计	769,077,225.04	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	5,870,204.07	0.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,870,204.07	0.92

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	135,227	5,870,204.07	0.92

注:报告期末,本基金仅持有上述1只股票。

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	39,123,000.00	6.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,306,000.00	12.40
	其中:政策性金融债	79,306,000.00	12.40
4	企业债券	511,967,025.36	80.03
5	企业短期融资券	9,997,000.00	1.56
6	中期票据	88,718,000.00	13.87
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	729,111,025.36	113.97

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	130236	13国开36	400,000	39,948,000.00	6.24
2	122028	09华发债	300,000	30,945,000.00	4.84
3	122554	12宏海债	300,000	30,900,000.00	4.83
4	112031	11晨鸣债	300,000	30,210,000.00	4.72
5	1180087	11彤煤债	300,000	30,063,000.00	4.70

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	179,229.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,166,928.77
5	应收申购款	100,899.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	14,447,058.25

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

项目	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
报告期期初基金份额总额	372,396,284.97	276,243,725.48
报告期期间基金总申购份额	33,843,616.67	20,636,043.09
减:报告期期间基金总赎回份额	53,553,133.12	59,689,028.79
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	352,686,768.52	237,190,739.78

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《关于核准嘉实多元收益债券型证券投资基金募集的批复》;

(2)《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实多元收益债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实多元收益债券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)报告期内嘉实多元收益债券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

嘉实稳健开放式证券投资基金

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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立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	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	11,320,148,955.97份
投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置,通过基本面分析挖掘行业优势企业,获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票40%-75%,债券20%-55%,现金5%左右。
业绩比较基准	巨潮200(大盘)指数
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金,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β值保持在0.5至0.8之间。
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	290,725,876.37
2.本期利润	978,657,091.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0845
4.期末基金资产净值	9,806,517,200.20
5.期末基金份额净值	0.866

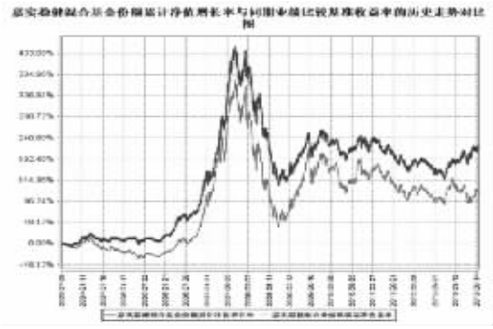
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.74%	1.11%	10.15%	1.47%	0.59%	-0.36%

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


嘉实稳健混合基金份额累计净值增长率与同期业绩