

嘉实优质企业股票型证券投资基金

[2012]第四季度报告

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
报告期截止日期: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

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	
货币支持证券	-	-	
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

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 采掘业	258,521,456.10	2.96	
C 制造业	5,961,673,422.17	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 小家具有	-	-	
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 建筑、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	
C9 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 公共运输、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 信息与文化产业	50,039,388.00	0.57	
M 综合类	-	-	
合计	7,320,566,153.57	83.79	

注:①本期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份额的各项费用,计算费率后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金主要财务指标

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份额的各项费用,计算费率后实际收益水平将低于所列数字。

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	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
2009年12月31日至2012年12月31日

注:1.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效,自2007年12月8日(含)日起,本基金合同生效,嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效。2.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。3.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。4.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。5.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。6.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。7.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。8.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。9.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。10.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。11.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。12.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。13.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。14.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。15.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。16.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。17.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。18.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。19.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。20.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。21.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。22.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。23.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。24.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。25.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。26.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。27.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。28.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。29.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。30.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。31.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。32.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。33.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。34.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。35.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。36.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。37.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。38.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。39.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。40.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。41.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。42.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。43.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。44.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。45.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。46.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。47.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。48.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。49.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。50.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。51.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。52.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。53.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。54.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。55.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。56.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。57.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。58.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。59.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。60.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。61.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。62.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。63.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。64.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。65.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。66.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。67.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。68.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。69.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。70.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。71.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。72.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。73.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。74.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。75.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。76.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。77.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。78.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。79.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。80.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。81.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。82.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。83.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。84.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。85.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。86.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。87.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。88.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。89.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。90.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。91.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。92.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。93.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。94.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。95.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。96.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。97.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。98.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。99.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,基金的名称变更为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。100.本基金在嘉实沪深300混合型开放式证券投资基金基金合同生效之日起,