

## 信息披露 Disclosure

## 嘉实研究精选股票型证券投资基金

## [2011] 第一季 度 报 告

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:2011年4月22日  
§ 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在保证本基金信息披露真实、准确、完整、及时的基础上,声明:本基金报告期所载的信息不存在虚假记载、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。

基金管理人和基金托管人严格按照《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》及其他相关法律法规的规定,于2011年4月19日复核了本基金报告中的财务指标、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本基金,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。

本报告期期间的财务资料未经审计。

报告期自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

嘉实研究精选股票型证券投资基金

交易主代码 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 1,831,533,862.42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,定性分析与定量分析相结合的方法,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

报告期(2011年1月1日-2011年3月31日) 单位:人民币元

主要财务指标

1.本期已实现收益 88,348,819.51

2.本期利润 -155,858,128.62

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0899

4.期末基金资产净值 2,661,404,957.67

5.期末基金份额净值 1.453

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)减去必要的费用后的余额,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 本基金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/净值增长标准差 业绩比较基准收/业绩比较基准差 ①/③ ②/④

过去三个月 5.20% 1.15% 2.96% 1.30% -8.16% -0.15%

3.2.2 本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

嘉实研究精选股票型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

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图(2008年5月27日至2011年3月31日)

§ 4 报告期末基金资产组合报告

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 2,363,731,563.04 86.89

其中:股票 2,363,731,563.04 86.89

2 固定收益投资 123,505,490.85 4.54

其中:债券 123,505,490.85 4.54

3 货币市场工具 - -

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 181,274,795.93 6.66

6 其他资产 51,813,850.64 1.90

7 合计 2,720,325,700.46 100.00

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 1,355,900.00 0.05

C 制造业 1,636,368,779.77 61.48

D 食品、饮料 335,847,686.30 12.62

E 纺织、服装、皮毛 - -

F 石油、化学、塑胶、塑料 297,662,372.00 11.18

G 电子 4,348,508.60 0.16

G 金属、非金属 359,186,818.87 13.50

H 机械、设备、仪表 354,654,432.36 13.33

I 医药、生物制品 284,668,895.64 10.70

J 其他制造业 - -

K 建筑业 - -

L 交通运输、仓储业 - -

M 综合类 20,340,623.76 0.76

N 信息技术业 106,004,968.68 3.98

O 批发和零售业 237,784,141.48 8.93

P 金融、保险业 159,298,435.99 5.99

Q 地产业 202,578,713.36 7.61

R 社会服务业 - -

S 传播与文化产业 - -

T 综合类 - -

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 上海石化 6,529,467 247,858,567.32 9.31

2 600887 伊利股份 6,300,046 217,666,589.30 8.18

3 600239 云南城投 7,681,998 129,797,406.16 4.88

4 000651 格力电器 5,500,017 124,630,385.22 4.68

5 000858 五粮液 3,700,000 117,993,000.00 4.43

6 002152 广电运通 2,599,943 108,755,615.69 4.09

7 600079 人福医药 4,600,051 97,659,082.73 3.67

8 600271 航天信息 3,400,079 84,729,968.68 3.18

9 600660 福耀玻璃 7,000,000 83,020,000.00 3.12

10 000877 天山股份 1,667,674 68,257,896.82 2.56

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(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采掘业 - -

C 制造业 2,656,376,359.97 54.41

D 食品、饮料 604,014,570.06 12.37

E 纺织、服装、皮毛 - -

F 石油、化学、塑胶、塑料 8,045,652,560 0.16

G 电子 82,377,581.33 1.69

G 金属、非金属 58,466,864.75 1.20

H 机械、设备、仪表 613,011,412.81 12.56

I 金融、保险业 791,576,625.77 16.21

J 其他制造业 - -

K 建筑业 42,969,428.40 0.88

L 交通运输、仓储业 343,160,579.56 7.03

M 信息技术业 62,023,803.09 1.27

N 银行业 120,186,159.84 2.46

O 房地产业 148,690,294.46 3.05

P 批发和零售业 3,397,503.42 0.07

Q 交通运输与邮电业 - -

R 传播与文化产业 4,881,835,521.81 7.24

S 其他服务业 - -

T 综合类 5,023 3,428,955,100.68 70.24

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十名债券投资明细

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 110103 11央行票据17 800,000 79,440,000.00 2.98

2 0801044 08央行票据44 200,000 20,022,000.00 0.75

3 0801047 08央行票据47 100,000 10,016,000.00 0.38

4 0801038 08央行票据38 100,000 10,004,000.00 0.36

5 110105 11央行票据38 20,700 2,236,014.00 0.08

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 110103 11央行票据17 800,000 79,440,000.00 2.98

2 0801044 08央行票据44 200,000 20,022,000.00 0.75

3 0801047 08央行票据47 100,000 10,016,000.00 0.38

4 0801038 08央行票据38 100,000 10,004,000.00 0.36

5 110105 11央行票据38 20,700 2,236,014.00 0.08

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定期存款

序号 机构名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国银行股份有限公司 800,000 79,440,000.00 2.98

2 中国工商银行股份有限公司 200,000 20,022,000.00 0.75

3 中国建设银行股份有限公司 100,000 10,016,000.00 0.38

4 中国农业银行股份有限公司 100,000 10,004,000.00 0.36

5 中国民生银行股份有限公司 20,700 2,236,014.00 0.08

5.8 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投资组合

序号 机构名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)