

## 嘉实主题精选混合型证券投资基金

## 2011年第1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  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及董事声明本基金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法律责任。  
基金托管人声明本基金所载资料不存在虚假记载、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。

本报告期自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题混合
交易主代码	070010
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	9,705,398,385.81
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	较低风险,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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -85,032,613.99

2.本期利润 -950,352,611.45

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0943

4.期末基金资产净值 13,242,563,860.60

5.期末基金份额净值 1.364

注:①本期利润:实现收益扣减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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 -6.54% 3.7% 1.28% -9.46% 0.08%

3.2.2 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图对比如图

2006年7月21日至2011年3月31日

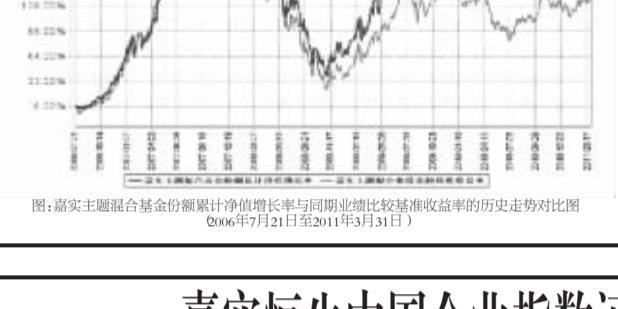


图:嘉实主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

2006年7月21日至2011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:2011年4月22日

§ 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

张宏民 本基金基金经理 2010年9月30日 - 10年 2000年10月加入嘉实基金管理有限公司,在研究部从事定量研究工作。2008年起任公司结构产品投资部高级数据分析员,从事指数化投资管理与研究工作。大学本科,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日;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》的有关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规的情况说明

报告期内,本基金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,嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 QDII-LOF 和嘉实主题精选混合型证券投资基金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。

本基金运作管理的规则和基金合同的条款或约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 为公平交易的执行的情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理办法》公司公平交易制度指导意见,和公司内部公平交易制度,通过IT系统和监控手段等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.4 为组合投资与个股投资相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内,本基金未进行个股投资,未与其他投资组合进行业绩比较。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对宏观经济、证券市场及行业走势的判断,请参见本基金定期报告。

4.6 报告期内基金的经营业绩及展望的说明

报告期内,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

5.1 报告期基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 209,002,072.74 86.19

2 固定收益投资 209,002,072.74 86.19

3 衍生品及套期保值工具 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

6 货币 - -

7 其他 - -

8 合计 345,936,733.94

本报告期基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 5,801,805.87

2 固定收益投资 114,763,362.92

3 衍生品及套期保值工具 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

6 货币 - -

7 其他 - -

8 合计 236,975,176.89

本报告期期末基金份额总额

§ 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(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 209,002,072.74 86.19

2 固定收益投资 209,002,072.74 86.19

3 衍生品及套期保值工具 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

6 货币 - -

7 其他 - -

8 合计 345,936,733.94

本报告期期末基金份额总额

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额 345,936,733.94

报告期基金份额变动 5,801,805.87

报告期末基金份额总额 345,936,733.94

本报告期基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额 236,975,176.89

报告期基金份额变动 236,975,176.89

报告期末基金份额总额 236,975,176.89

本报告期基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额 236,975,176.89

报告期基金份额变动