

【2012】第一季度报告

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	58,349,538.56	6.47
C	制造业	396,784,807.55	44.01
C0	食品、饮料	76,896,520.46	8.53
C1	纺织、服装、皮毛	8,281,725.00	0.92
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	6,682,353.74	0.74
C4	石油、化学、塑胶、塑料	47,702,560.23	5.29
C5	电子	26,428,587.58	2.93
C6	金属、非金属	37,557,649.52	4.17
C7	机械、设备、仪表	82,092,662.05	9.11
C8	医药、生物制品	101,278,455.59	11.23
C99	其他制造业	9,864,293.38	1.09
D	电力、煤气及水的生产和供应业	21,889,622.42	2.43
E	建筑业	22,998,003.83	2.55
F	交通运输、仓储业	30,383,447.02	3.37
G	信息技术业	33,879,614.17	3.76
H	批发和零售贸易	57,816,145.43	6.41
I	金融、保险业	90,968,315.97	10.09
J	房地产业	29,033,609.12	3.22
K	社会服务业	16,306,222.57	1.81
L	传统与文化产业	9,695,905.50	1.08

M	综合类			98,999,373.11	3.43
	合计			798,994,695.25	(88.63)
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	600036	招商银行	1,595,714	18,988,996.60	2.11
2	000568	泸州老窖	409,931	16,024,202.79	1.78
3	600519	贵州茅台	70,326	13,851,408.96	1.54
4	601808	中海油服	771,200	12,855,904.00	1.43
5	601328	交通银行	2,632,500	12,399,075.00	1.38
6	000623	吉林敖东	523,202	11,955,165.70	1.33
7	600030	中信证券	1,026,600	11,898,294.00	1.32
8	600859	王府井	385,444	11,547,902.24	1.28
9	600085	同仁堂	800,000	11,136,000.00	1.24
10	600887	伊利股份	499,987	11,019,713.48	1.22



图：嘉实量化阿尔法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对比图
2009年3月20日至2012年3月31日

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末,本基金前十名证券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 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,175,166.19
2	应收证券清算款	8,621,681.95
3	应收股利	-
4	应收利息	660,029.60
5	应收申购款	465,181.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	10,922,059.70

5.8.4 报告期末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	110003	新钢转债	3,122,009.60	0.35
2	110015	石化转债	1,010,800.00	0.11
3	125731	美丰转债	12,776.05	0.00

5.8.5 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
序号	1,042,163,776.83
本报告期基金总申购份额	102,875,738.18
减:本报告期基金总赎回份额	77,900,268.22
本报告期基金净申购份额	-
本报告期期末基金总份额	1,067,139,246.81

注:本报告期期末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 备查文件目录

7.1 查阅文件目录

- 1) 中国证监会核准基金量化阿尔法股票型证券投资基金募集的文件；
- 2) 睿实量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同；
- 3) 睿实量化阿尔法股票型证券投资基金招募说明书；
- 4) 睿实量化阿尔法股票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) 报告期内基金量化阿尔法股票型证券投资基金公告的各项原稿。

7.2 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

7.3 查阅方式

① 书面查询：查询时间为每工作日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。

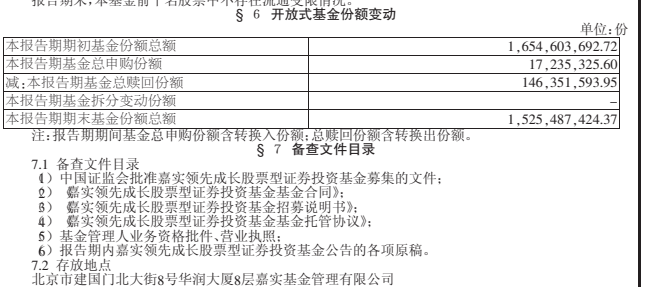
② 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有任何疑问，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

一 季 度 报 告

合计			93,120,259.10	6.74	
5.5 报告期内期末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	11011088	11央行票据88	900,000	87,057,000.00	6.30
2	110017	中海转债	64,730	6,063,259.10	0.44
5.6 报告期内本基金持有公允价值前五名的前十名支持证券投资明细					
本报告期末，本基金未持有公允价值前五名的前十名支持证券投资明细					
5.7 报告期内本基金未持有公允价值支持证券					
5.8 报告期内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					
本报告期末，本基金未持有权证。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况					
1)中国建设银行股份有限公司发布了《关于收到中国证监会<行政决定书决定>15的公告》、《中国银监会决定对五联债权资产管理公司投资管理违规行为处以60万元罚款的公告》、《中国银监会“银监罚〔2008〕第1号”处罚其他公告》，其中五联债权资产管理公司已被二级市场的判断，本基金本报告期内未参与该等公司的任何交易。					
2)报告期内本基金投资的前十名证券中其除九项证券发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年末本基金投资的前十名证券中其他九项证券发行主体未受到公开谴责、处罚。					
5.8.1.2 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。					
5.8.3 其他资产构成					
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	60,909.10			
2	应收证券清算款	7,407,000.00			
3	应收股利	—			
4	应收利息	1,186,595.83			
5	应收申购款	33,709.94			
6	其他应收款	—			
7	待摊费用	—			
8	其他	—			
合计		8,688,214.87			
5.8.4 报告期内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	110017	中海转债	6,063,259.10	0.44	
5.8.5 报告期内前十名股票中存在流通受限情况的说明					



600199	金种子酒	2,000,853	40,137,111.18	2.91
600750	江中药业	1,400,000	33,236,000.00	2.41
002304	洋河股份	225,698	33,211,460.70	2.40
000002	万科A	4,000,000	33,120,000.00	2.40

嘉实基金管理有限公司
2012年4月23日