

嘉实优质企业股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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
送出日期:2013年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实优质企业股票型证券投资基金
基金简称	嘉实优质企业股票
基金代码	070099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月8日
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
报告期末基金份额总额	6,886,164,148.33份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	力争为基金份额持有人创造长期超额收益
投资策略	在具备足够多、预期收益率良好的投资标的时优先考虑股票资产配置,剩余配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资以自下而上的个股选择策略为主,结合行业配置适度均衡策略,构造和优化组合,通过个股申购、债券转股及衍生品工具等投资策略,规避风险,增加收益。
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。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
姓名	胡勇钦	周清志
联系电话	(010)65215588	(021)61618888
电子邮箱	service@jfund.cn	zhongq@spdl.com.cn
客户服务电话	400-600-8800	95528
传真	(010)65182266	(021)63602540

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门内大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	340,570,972.48
本期利润	848,989,101.59
加权平均基金份额本期利润	0.0958
本期加权平均净值增长率	9.92%
本期基金份额净值增长率	9.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-510,733,865.06
期末可供分配基金份额利润	-0.0742
期末基金资产净值	6,786,029,216.71
期末基金份额净值	0.985
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.50%

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公允价值变动收益;②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期末可供分配利润采用期末资产负债表末中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-4.46%	1.58%	-14.82%	1.77%	10.36%	-0.19%
过去三个月	2.18%	1.26%	-11.18%	1.38%	13.36%	-0.12%
过去六个月	9.20%	1.24%	-12.05%	1.42%	21.25%	-0.18%
过去一年	10.43%	1.14%	-9.86%	1.30%	20.29%	-0.16%
自基金合同生效起至今	32.93%	1.18%	-12.79%	1.30%	45.72%	-0.12%
注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数×95%+上证国债指数×5%。						

本基金业绩比较基准按照构建组合每交易日进行计算,计算方式如下:
Benchmark 0=1000
Return 0=95%×沪深300指数+(1-1)×5%×(上证国债指数/上证国债指数(1-1))

其中1=2,3,...

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:嘉实优质企业股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2007年12月8日至2013年6月30日)

注1:本基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日(含)日起,本基金基金合同生效,嘉实浦安保本基金合同失效。

注2:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十八条(二)投资范围和(八)投资组合比例限制的规定;①本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;②本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的10%;③本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;④《基金法》及其他有关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。

注3:2013年6月7日,本基金管理人发布《关于嘉实优质企业股票基金经理变更的公告》,刘天君先生不再担任本基金基金经理,聘请邵健先生担任本基金基金经理职务。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一家基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、南京、青岛、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2013年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实稳健混合、嘉实货币、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混、嘉实策略混、嘉实海外中国股票(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳健收益债券、嘉实H股指数、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实定期开放股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证全指中国国债ETF联接、嘉实中证纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意定增债券、嘉实美国成长股票(QDII)等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实货币为开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多只全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
邵健	本基金、嘉实增长混合基金基金经理、公司基金经理助理	2013年6月3日	15年	曾任国泰君安证券研究所研究员、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月加入嘉实基金管理有限公司,曾任研究员、经济金融部,具有基金从业资格,中国国籍。
刘天君	本基金基金经理、嘉实成长收益混合基金基金经理、公司股票投资部总监	2007年12月8日至2013年6月7日	11年	曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副经理、嘉实泰和封闭、嘉实成长收益混合基金基金经理、北京大学工商管理专业经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①基金经理刘天君的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理邵健的任职日期是指公司作出决定公告之日,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守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实优质企业股票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,在严格控制投资风险的基础上,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约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
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,各投资组合投资决策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;通过完善交易流程控制内幕交易的公平交易信息,投资、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
报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年,在巨量流动性投放情况下,中国经济增长并未出现明显回升,显示传统经济效率降低,高投入、低收益的经济增长模式难以维系。同时政策对于经济下滑并未采取粗放式刺激方式,而是着重控制风险与调结构,在经济增长不触底的情况下逐步转变经济增长方式。在此期间下,A股市场整体下跌,同时呈现大幅分化的局面,代表新经济、未来转型方向的电子、传媒、信息服务、医药、食品等行业指数表现均较好,而传统周期类行业煤炭、有色、钢铁、机械、交运、金融等行业表现较差。

本基金基于对经济结构性变化的判断,上半年进一步增加转型受益、长期空间相对较大的电子、传媒、医药等行业个股的配置,同时降低了有色金属、工程机械、地产、金融等传统周期类行业的配置,取得了良好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为0.985元;本报告期基金份额净值增长率为9.20%,业绩比较基准收益率为-12.05%。

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,我们判断中长期中国经济面临债务危机积累和产能过剩问题,经济转型较为缓慢,政策稳增长,但不会出整体性较强的刺激政策,短期经济增速将逐步稳定在合理区间;国内流动性处于紧平衡状态,而美国的量化宽松也将逐步收敛。因此,A股市场指数的整体空间有限,转型将是股票市场的主要方向,资本市场的分化行情可能继续。我们总体将保持在电子、食品、医药、传媒、天然气等行业超配,在其中优选质地优秀、长期空间较大、动态估值偏低的公司进行配置,力争为投资人取得良好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值核算与基金会计账目的核对同时进行。

4.6 基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金估值、估值委员会、基金核算参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易,中国证券登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
① 报告期内本基金未实施利润分配;
② 根据本报告3.1.1“本期利润”为848,989,101.59元,3.1.2“期末可供分配基金份额利润”为-0.0742元,3.1.2“期末基金份额净值”为0.985元,以及本基金基金合同“十三、三、收益分配原则”2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;③ 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合基金合同的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对嘉实优质企业股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的约定,对嘉实优质企业股票型证券投资基金的投资运作进行了监督,基金资产净值的管理,基金申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见
本报告期内,由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:嘉实优质企业股票型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	104,007,509.18	189,792,334.91
结算备付金		26,910,116.35	27,741,975.71
存出保证金		4,098,166.63	1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	6,702,966,521.90	7,993,600,996.17
其中:股票投资		6,384,463,521.90	7,320,566,153.57
基金投资		-	-
债券投资		318,503,000.00	673,034,842.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	660,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,662,011.33	3,931,343.83
应收股利		427,500.00	-
应收申购款		13,747,886.03	32,584,928.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,858,819,711.42	8,908,651,578.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
应付金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		45,742,476.23	138,430,464.11
应付赎回款		10,961,601.60	16,726,332.11
应付管理人报酬		8,567,737.81	10,314,213.95
应付托管费		1,427,956.30	1,719,035.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,117,054.93	3,314,942.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	973,667.84	1,345,981.92
负债合计		72,790,494.71	171,850,970.19
所有者权益:			
实收资本	6.4.7.9	6,875,365,777.93	9,673,094,832.47
未分配利润	6.4.7.10	-89,356,061.22	-936,294,223.98
所有者权益合计		6,786,029,216.71	8,736,800,608.49
负债和所有者权益总计		6,858,819,711.42	8,908,651,578.68

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.985元,基金份额总额6,886,164,148.33份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实优质企业股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日
一、收入		942,280,179.76	857,379,705.84
1.利息收入		12,362,719.63	16,650,444.52
其中:存款利息收入	6.4.7.11	2,700,173.62	3,145,328.92
债券利息收入		7,672,653.99	10,011,356.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,989,892.02	3,493,759.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益		418,650,050.54	-189,572,900.07
其中:股票投资收益	6.4.7.12	352,276,454.14	-239,399,188.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,554,319.76	613,790.31
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	59,819,276.64	49,752,498.13
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	508,418,129.11	1,029,624,714.45
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	2,849,280.48	677,446.94
其中:公允价值变动收益		93,291,071.17	78,228,169.05
1.管理人报酬		63,712,430.65	56,649,341.79
2.托管费		10,618,738.63	9,441,556.84
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	18,730,106.68	11,917,351.94
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
三、利润总额	6.4.7.19	229,802.41	219,918.88
减:所得税费用		848,989,101.59	779,151,536.79
减:所得税费用		-	-
四、净利润		848,989,101.59	779,151,536.79

6.3 所有者权益(或基金净值)变动表

会计主体:嘉实优质企业股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,673,094,832.47	-936,294,223.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-848,989,101.59	848,989,101.59
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数	-2,797,729,054.54	-2,031,438.83
其中:1.基金申购款	1,367,357,176.47	-47,962,514.54
2.基金赎回款	-4,165,086,231.01	45,931,075.71
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,875,365,777.93	-89,356,061.22

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,718,776,410.57	-1,699,192,975.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	779,151,536.79
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数	368,987,270.39	-49,697,268.21
其中:1.基金申购款	1,216,025,168.01	-167,368,084.26
2.基金赎回款	-847,037,897.62	117,670,816.05
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	9,087,763,680.96	-969,738,706.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

赵学军	李松林	王红
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.2 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.3 本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(浦发银行)	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期 2013年1月1日至2013年6月30日 及上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日

本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方交易

6.4.4.2.1 基金管理费

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	63,712,430.65	56,649,341.39
其中:支付销售机构的客户维护费	8,039,822.25	7,661,592.67

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,618,738.43	9,441,556.84

注:支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日