

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

§ 1 重要提示

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2014年3月26日

§ 1.1 基金概况

基金管理人的董事会、董事会对本基金的合规性负责，不虚假记载、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。本年度报告未经独立董事签字同意，但以其董事签发。

基金托管人对本基金的合规性负有监督责任，勤勉尽责的履行托管职责和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资人风险，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。

本报告期内自2013年1月1日起至2013年12月31日。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基本简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金 |
| 基金代码 | 070017 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金资产净值 | 672,102,647.19份 |
| 基金份额净值 | 1.00元 |

2.2 基金产品说明

| 投资目标 | 追求长期稳定高于业绩比较基准的回报 |
|--------|--|
| 投资策略 | 从宏观经济、政策和基本面四个方面角度进行分析，根据市场变化情况，适时调整投资组合，以期获得超额收益。本基金主要投资于股票资产，通过量化模型，嘉实Alpha因素模型以及嘉实卖方研究部提供的研究报告，精选具有成长性的股票进行配置。同时，本基金将根据宏观经济环境的变化，适时以“定投+策略”策略，使基金投资更贴近“买入并长期持有”的策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×75%+货币基金指数×25% |
| 风险收益特征 | 较高风险，较高收益 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---------------------|-----------------|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 法定代表人 | 傅强 | 赵军 |
| 信息披露负责人 | 赵晓明 | 王军 |
| 联系电话 | (010)65215588 | 010666105799 |
| 电子邮箱 | service@jrjf.com.cn | csd@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | 400-600-8800 | 95588 |
| 传真 | (010)58122266 | (010)66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jrfund.cn |
| 基金年度报告备查目录 | 北京市建国门北大街8号华润大厦嘉实基金管理有限公司 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

| 项目 | 2013年 | 2012年 | 2011年 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期末所有者权益 | 7,816,737.72 | -154,400,778.53 | -158,003,663.74 |
| 本期末总资产 | 38,669,180.80 | 9,105,795.38 | -452,449,078.91 |
| 本期末所有者权益占总资产比例 | 20.46% | 0.00% | -0.47% |
| 本期末资产负债率(%) | 5.53% | 1.05% | -38.46% |
| 本期末资产利润率(%) | 5.30% | 1.10% | -34.27% |
| 3.1.2 本期利润和净利润 | 2013年年 | 2012年年 | 2011年年 |
| 本期利润 | -107,901,420.88 | -160,224,371.19 | -186,390,566.49 |
| 期末可供分配利润 | -0.165 | -0.173 | -0.1788 |
| 期末基金资产净值 | 587,217,577.77 | 780,649,809.25 | 855,778,210.36 |
| 期末基金份额净值 | 0.874 | 0.830 | 0.821 |
| 3.1.3 会计差错指正 | 2013年年 | 2012年年 | 2011年年 |
| 基金净值增长率为 | -6.91% | -11.60% | -12.56% |

注：本期基金业绩比较基准为：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%。

采用该业绩比较基准主要基于：①沪深300指数和上证国债指数均符合编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性；②作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置和风格风险特征。

本基金的业绩比较基准指按照约定公式每日交易日进行计算，计算方法如下：

Benchmark(t)=1000×Return(t)/Return(t-1)

Return(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,..。

3.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，本期利润为本期公允价值变动收益（2.2）所含基金业绩报酬不包括持有人认购或申购本基金时支付的费用，计算后实际可供分配利润不列于所列示；（3）期末可供分配利润未充分考虑货币市场基金的各项费用，计算后实际可供分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.3 基金净值表现

3.3.1 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 | 份额净值增长率为 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率差额 | ①-③ | ②-④ |
|--------|----------|-----------|-------------|-------|---------|
| 过去三个月 | -1.13% | 1.20% | -2.35% | 0.04% | 1.12% |
| 过去六个月 | 1.19% | 4.85% | 0.97% | 7.63% | 0.22% |
| 过去一年 | 5.30% | 1.26% | -4.73% | 1.04% | 10.03% |
| 过去三年 | -30.02% | 1.29% | -16.80% | 0.99% | -13.22% |
| 成立以来至今 | -6.91% | 1.44% | -4.49% | 1.13% | -11.40% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%。

采用该业绩比较基准主要基于：①沪深300指数和上证国债指数均符合编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性；②作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置和风格风险特征。

本基金的业绩比较基准指按照约定公式每日交易日进行计算，计算方法如下：

Benchmark(t)=1000×Return(t)/Return(t-1)

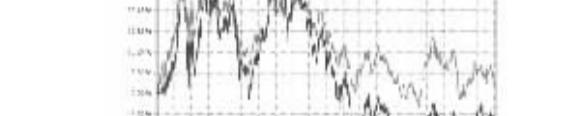
Return(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.4 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.10 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.12 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.13 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.14 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.15 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.16 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.17 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.18 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之（二）、（五）（二）投资组合限制的规定。

3.2.19 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的基本份额由成立日起6个月内建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分之