

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:2014年8月25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。本公司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2014年8月20日对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。

本年度报告摘要摘录于半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014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	070909
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月18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	4,235,047,492.06份
基金份额净值	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	在具备成长性的行业表现突出,而煤炭、钢铁等传统板块表现落后。在主题方面,新能源汽车、信息安全等行业活跃。本组合基于对未来经济结构和相应行业景气度等因素的判断,一季度组合增加了对医药、计算机、电气设备等行业的配置比例,同时对于汽车、家电等受宏观经济影响较大的行业做出了适度的减持。
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	上海浦东发展银行股份有限公司
姓名	胡海鸥	廖军
信息披露负责人	(010)65155888	(021)61616888
电子邮箱	service@fund.cn	Liaoy@pdcb.com
客户服务电话	400-600-8880	95328
传真	(010)65182266	021-63605240

2.4 信息披露方式

报告期内基金所管理的所有开放式基金的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告置地	北京市建国门北大街8号华融大厦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

金额单位:人民币元

1.1 期间数据和指标		报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益		220,810,456.63	
本期利润	-463,276,908.67		
加权平均基金份额本期利润	-0.053		
本期末基金资产净值	-10.87%		
基金份额净值增长率	-9.70%		

1.2 期末数据和指标		报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配利润	-279,390,002.22		
期末可供分配基金份额利润	-0.0661		
期末基金资产净值	3,938,947,965.81		
基金份额净值	0.932		

1.3 本期利润指标		报告期末(2014年6月30日)	
基金份额净值增长率	-6.00%		

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本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括有人认购基金的交易费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字;(3)期末可供分配利润即期末可供分配的利润减去本期利润。

3.2 基金值表现

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	同期业绩比较基 准收益率	份额净值增 长率差	①-③	②-④
过去一个月	4.60%	0.97%	0.40%	0.74%	4.20%
过去三个月	1.97%	1.16%	0.90%	0.83%	1.07%
过去六个月	-70.70%	1.34%	-6.62%	0.99%	-3.08%
过去一年	-45.7%	1.33%	-1.32%	1.11%	-3.25%
过去三年	-2.39%	1.20%	-27.08%	1.23%	-24.69%
自基金合同生 效以来	-6.00%	1.46%	-54.03%	1.75%	-48.03%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300 指数×95% + 上证国债指数×5%。

本基金的业绩基准按照构造公式每交易日进行计算,计算方法如下:

Benchmark=1000×Return(t)=95%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)+5%×(上证国债指数(t)/上证国债指数(t-1))

其中t=1,2,3,..,n

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



图:嘉实优质企业股票型基金成立以来与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年12月8日至2014年6月30日)

注:本基金由嘉实浦安保定期开放型证券投资基金转型而成,自2007年12月8日(含当日起),本基金合同生效,嘉实浦安保基金基金合同失效。

注:按基金合同约定,本基金从基金成立之日起3个月内为建仓期。建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同第十八章(二)投资限制及(八)投资组合的规则:(1)本基金持有一家上市公司股票,不得高于基金资产净值的10%;(2)本基金是由基金管理人管理的其他基金共同持有同一家上市公司股票,不得超过该债券的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总资产的10%;(4)本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券,不得超过基金资产净值的5%;(5)本基金投资于股票的比例不低于基金资产净值的80%;(6)本基金投资于可转换债券、可分离债券、可交换债券的比例合计不得超过基金资产净值的20%;(7)本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%;(8)本基金投资于股指期货、国债期货、商品期货、商品期权的比例不得超过基金资产净值的10%;(9)本基金投资于境外市场的股票、基金等金融工具的比例不得超过基金资产净值的5%;(10)本基金投资于境外的股权、债权类资产的比例不得超过基金资产净值的20%;(11)本基金投资于境外的不动产、大宗商品类资产、黄金等贵金属的比例不得超过基金资产净值的10%;(12)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(13)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(14)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(15)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(16)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(17)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(18)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(19)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(20)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(21)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(22)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(23)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(24)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(25)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(26)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(27)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(28)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(29)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(30)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(31)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(32)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(33)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(34)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(35)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(36)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(37)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(38)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(39)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(40)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(41)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(42)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(43)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(44)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(45)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(46)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(47)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(48)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(49)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(50)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(51)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(52)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(53)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(54)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(55)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(56)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(57)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(58)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(59)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(60)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(61)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(62)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(63)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(64)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(65)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(66)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(67)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(68)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(69)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(70)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(71)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(72)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(73)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(74)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(75)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(76)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(77)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(78)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(79)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(80)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(81)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(82)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(83)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(84)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(85)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(86)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(87)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(88)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(89)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(90)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(91)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(92)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(93)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(94)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(95)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(96)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(97)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(98)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(99)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(100)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(101)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(102)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(103)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(104)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(105)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(106)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(107)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(108)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(109)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(110)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(111)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(112)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(113)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(114)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的10%;(115)本基金投资于境外的金融衍生品的比例不得超过基金资产净值的10%;(116)本基金投资于境外的金融产品,不得超过基金资产净值的10%;(117)本基金投资于境外的其他资产不得超过基金资产净值的