嘉实优质企业股票型证券投资基金

2014 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：2015年3月31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2015年3月26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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§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
基金主代码	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	2,848,068,807.36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类资产配置，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精选策略为主，结合行业配置适度均衡策略，构造和优化组合；通过新股申购、债券投资及衍生工具等投资策略，规避风险、增强收益。
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
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	廖原
	联系电话	(010)65215588	(021)61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Liaoy03@spdb.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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	462,334,879.00	1,138,877,340.87	-502,620,775.27
本期利润	14,079,036.79	1,278,697,653.03	884,203,452.84
加权平均基金份额本期利润	0.0034	0.1747	0.0967
本期加权平均净值利润率	0.36%	17.42%	11.21%
本期基金份额净值增长率	2.22%	15.41%	12.19%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	161,601,461.56	213,542,133.29	-1,139,927,478.89
期末可供分配基金份额利润	0.0567	0.0423	-0.1177
期末基金资产净值	3,005,182,168.20	5,248,172,873.87	8,736,800,608.49
期末基金份额净值	1.055	1.041	0.902
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	6.41%	4.10%	-9.80%

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中未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
过去三个月	3.23%	1.34%	41.72%	1.56%	-38.49%	-0.22%
过去六个月	13.20%	1.17%	59.55%	1.26%	-46.35%	-0.09%
过去一年	2.22%	1.25%	48.98%	1.15%	-46.76%	0.10%
过去三年	32.35%	1.21%	48.79%	1.23%	-16.44%	-0.02%
过去五年	29.45%	1.22%	0.29%	1.29%	29.16%	-0.07%
自基金合同生效起至今	6.41%	1.45%	-26.65%	1.72%	33.06%	-0.27%

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

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

Benchmark(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：嘉实优质企业股票累计份额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
（2007年12月8日至2014年12月31日）

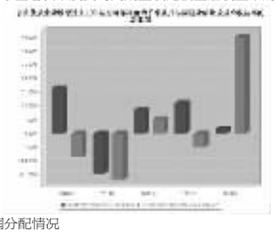
注1：本基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金转型而成，自2007年12月8日（含当日）起，本基金基金合同生效，嘉实浦安保本基金基金合同失效。

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发行的证券，不得超过该证券的10%；（3）基金财产参与股票发行申购，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3：2014年4月29日，本基金管理人发布《关于新增嘉实优质企业股票基金经理的公告》，聘请刘辉先生担任本基金基金经理职务，与现任基金经理邵健先生共同管理本基金。

注4：2014年8月20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》，邵健先生不再担任本基金基金经理；聘请胡涛先生担任本基金基金经理职务，与现任基金经理刘辉先生共同管理本基金。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	0.0850	24,558,487.18	16,650,803.56	41,209,290.74	
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
合计	0.0850	24,558,487.18	16,650,803.56	41,209,290.74	

§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批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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2014年12月31日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、66只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、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300指数(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、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、嘉实周期优选股票、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、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、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
		任职日期	离任日期		
刘辉	本基金基金经理	2014年4月29日	-	8年	曾任华泰证券股份有限公司研究员，东吴基金管理有限公司研究员，汇丰晋信基金管理有限公司研究员，基金经理。2013年12月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部。硕士研究生，具有基金从业资格。
胡涛	本基金基金经理	2014年8月20日	-	12年	曾任北京证券有限责任公司投资银行部经理，中国国际金融有限公司股票研究经理，长盛基金管理有限公司研究员，友邦华泰基金管理有限公司基金经理助理，泰达宏利基金管理有限公司专户投资部副总经理，研究部研究主管，基金经理等职务。2014年3月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，美国印第安纳大学凯利商学院MBA，具有基金从业资格，中国国籍。
邵健	本基金、嘉实增长混合基金经理，公司副总经理	2013年6月7日	2014年8月20日	16年	曾任国泰君安证券研究所研究员，行业投资策略组组长，行业公司部副总理，从事行业研究、行业比较研究及资产配置等工作。2003年7月进入嘉实基金管理有限公司投资部工作，经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期、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循了《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规定和约定，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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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，各投资组合按投资管理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；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、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；对投资交易行为进行监察稽核，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的，合计7次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

2014年市场表现很好，特别是权重大盘股表现好于中小盘成长股票。而2014年宏观经济仍然处于下行趋势中，货币供应总量也未出现明显的上升，市场的上涨更多是在融资、存量货币的大类资产转移和国企改革的预期推动下。2014年股票市场融资额出现大幅上升，达到1.2万亿规模。10万亿的信托资产随着理财收益的下降逐渐转移到股市，银行资金通过委托贷款等业务也逐渐流入股市。这是股市上涨的最重要的资金因素。上涨的基本面方面的因素主要是认为宏观方面金融违约大面积出现风险不大，风险偏好开始上升以及国企改革预期。而结构上的变化是以金融为代表的权重股大幅超越创业板的成长股票，主要是下半年特别是四季度涨幅巨大。而上半年的特征表现为市值较小的中小盘创业板股票表现较好。

在这种宏观状况和市场表现特征下，本基金的操作首先在仓位上基本维持在上限操作，认为2014年市场表现会不错，主要因为通胀不高，货币政策不紧，存在很多的结构性投资机会。经济下行不是决定股市涨跌的最重要因素，而是资金面和政策面。结构上的配置，本基金基本还是延续一贯的以成长股配置为主的操作策略。行业选择方面主要还是集中在互联网技术，网络安全，新材料，机器人，汽车电子化，新能源汽车等战略性新兴产业为主。认为宏观经济在未来数年的转型过程中主要还是这些行业更代表未来经济的发展方向，也相较传统行业更具成长性。另外，本基金也同时考虑到市场的结构风格变化特征，特别是在四季度也大幅增加了金融等权重股的配置，组合配置上更均衡化，一定程度上规避了中小盘成长股的回调风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.055元；本报告期基金份额净值增长率为2.22%，业绩比较基准收益率为48.98%。

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2015年，我们认为宏观经济层面会继续下行，GDP增长预计还会略低于2014年。宏观经济的风险主要表现在房地产投资方面。而基建随着政府财政收入的减少起到的对冲作用也会逐渐降低。出口方面也会面临欧洲以及其他一些发展中国家经济持续衰退的负面影响。因此宏观经济没有特别好的推动市场上升的因素。资金面我们认为基本还会延续2014年的格局，无风险利率会在降息推动下继续下降，大类资产配置会继续逐渐从信托理财等转移到股市中，融资仍会是市场上涨的重要资金推手，但是随着监管的逐渐规范作用会递减。通胀随着油价大幅下跌预计会继续下降并有一定的通缩风险。央行的货币政策还会延续稳定偏宽松的方向。因此综合这些因素考虑，市场在资金面略宽松以及低通胀的环境下预计仍会有较好的表现。

在这种宏观经济和市场环境的预期下，本基金仍会维持较高仓位的操作，市场的结构性机会仍会很多。但是我们认为市场的结构风格特征不会像2014年那样更多拘泥于大小盘的轮动上，我们认为会更多聚焦在股票的业绩和成长性上。2014年表现较好的小市值股票，如果没有业绩兑现会下跌；同样2014年表现好的金融权重股，如果业绩出现低于预期的情况预计，也不会有较好的市场表现。我们在投资上更会重视公司业绩的确定性和长期成长性。行业选择上我们会更青睐于战略性新兴产业，如互联网技术、网络安全、新材料、机器人、汽车电子化、新能源汽车等。认为这些行业代表宏观经济未来的发展方向，相关行业中的有核心竞争力的龙头公司会在今后的几年中表现出较好的成长性。传统行业中，我们对消费龙头还是比较看好，认为其通过不断推出新产品提高利润率从而保持持续稳定的增长。对中国企业在制造领域的核心竞争力非常看好，一些制造业企业已经通过研发和制造成本低的竞争优势，不断扩大自己在国际市场的份额，而且在国内市场也在不断提高进口替代的空间。最后在市场化的中小盘股投资机会很多的情况下，我们也高度重视低价高分红的国企大盘股在沪港通开通后以及改革预期下的投资机会，兼具大小盘的投资策略会使得组合投资风格更加均衡，兼具进攻和防范风险的能力。另外，本基金在选股中也更加注重估值的因素，重点选择成长性超过预期，而估值相对较低的公司。

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与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、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本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、监察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和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理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、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

（1）本基金的基金管理人于2014年1月15日发布《嘉实优质企业股票型证券投资基金2013年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2013年12月31日，每10份基金份额发放现金红利0.085元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

（2）本基金的基金管理人于2015年1月20日发布《嘉实优质企业股票型证券投资基金2014年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2014年12月31日，每10份基金份额发放现金红利0.114元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

本报告期内，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、托管协议的规定，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

本报告期内，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、托管协议的规定，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，对基金资产净值的计算、基金份额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。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为41,209,290.74元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

嘉实优质企业股票型证券投资基金2014年度财务会计报告已由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师李慧民、王珊珊签字出具了“无保留意见的审计报告”（安永华明（2015）审字第60468756_A02号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	136,770,642.02	268,160,263.51
结算备付金		5,658,221.47	3,742,280.81
存出保证金		2,233,449.67	2,790,853.65
交易性金融资产	7.4.7.2	2,883,928,999.42	5,000,693,190.79
其中：股票投资		2,803,889,999.42	4,830,320,980.79
基金投资		-	-
债券投资		80,039,000.00	170,372,210.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		19,405,653.77	-
应收利息	7.4.7.5	2,218,404.83	1,694,911.13
应收股利		-	-
应收申购款		1,472,369.60	4,126,418.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,051,687,740.78	5,281,207,918.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20,356,564.45	14,041,314.33
应付赎回款		18,196,524.30	8,528,784.44
应付管理人报酬		4,194,073.59	6,829,849.89
应付托管费		699,012.28	1,138,308.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,149,694.28	1,588,286.67
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	909,703.68	908,501.14
负债合计		46,505,572.58	33,035,044.80
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,843,580,706.64	5,034,630,740.58
未分配利润	7.4.7.10	161,601,461.56	213,542,133.29
所有者权益合计		3,005,182,168.20	5,248,172,873.87
负债和所有者权益总计		3,051,687,740.78	5,281,207,918.67

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.055元，基金份额总额2,848,068,807.36份。

7.2 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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		111,045,087.12	1,434,942,372.26
1.利息收入		9,681,800.82	18,646,233.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,755,930.23	3,692,862.05
债券利息收入		3,901,481.65	12,962,201.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,388.94	1,991,170.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益		548,176,672.63	1,271,801,900.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	531,469,488.61	1,182,894,278.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	686,618.08	6,495,689.76
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	16,020,565.94	82,411,932.66
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-448,255,842.21	139,820,312.16
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	1,442,455.88	4,673,925.46
减：二、费用		96,966,050.33	156,244,719.23
1.管理人报酬		59,579,958.70	110,622,607.73
2.托管费		9,929,993.15	18,437,101.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	27,003,172.14	26,722,189.35
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	452,926.34	462,820.82
三、利润总额		14,079,036.79	1,278,697,653.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润		14,079,036.79	1,278,697,653.03

7.3 所有者权益（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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,034,630,740.58	213,542,133.29	5,248,172,873.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,079,036.79	14,079,036.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,191,050,033.94	-24,810,417.78	-2,215,860,451.72
其中：1.基金申购款	568,823,977.62	-12,911,208.57	555,912,769.05
2.基金赎回款	-2,759,874,011.56	-11,899,209.21	-2,771,773,220.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-41,209,290.74	-41,209,290.74
五、期末所有者权益（基金净值）	2,843,580,706.64	161,601,461.56	3,005,182,168.20
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	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	8,736,800,608.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,278,697,653.03	1,278,697,653.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-4,638,464,091.89	-128,861,295.76	-4,767,325,387.65
其中：1.基金申购款	2,452,136,385.28	11,774,898.73	2,463,911,284.01
2.基金赎回款	-7,090,600,477.17	-140,636,194.49	-7,231,236,671.66
四、本期向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）	5,034,630,740.58	213,542,133.29	5,248,172,873.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》，在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

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	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
德嘉志资产管理（亚洲）有限公司	基金管理人股东

7.4.4 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。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	59,579,958.70	110,622,607.73
其中：支付销售机构的客户维护费	10,754,259.86	15,292,863.94

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,929,993.15	18,437,101.33

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＝前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年12月31日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年12月31日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2014年12月31日）及上年度末（2013年12月31日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	136,770,642.02	5,602,713.35	268,160,263.51	3,352,535.42

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2014年1月1日至2014年12月31日）及上年度可比期间(2013年1月1日至2013年12月31日)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2014年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002439	启明星辰	2014年12月8日	重大事项停牌	23.84	2015年3月12日	28.86	5,612,865	78,616,914.61	133,810,701.60	-
300168	万达信息	2014年12月31日	重大事项停牌	46.20	2015年1月8日	44.50	1,618,375	25,213,199.32	74,768,925.00	-
300144	宋城演艺	2014年12月18日	重大事项停牌	30.12	未知	未知	1,666,198	42,657,893.88	50,185,883.76	-
300296	利亚德	2014年9月29日	重大事项停牌	22.74	2015年1月5日	22.60	1,341,881	31,291,702.97	30,514,373.94	-
300136	信维通信	2014年12月25日	重大事项停牌	18.75	2015年2月11日	19.45	1,601,548	28,039,097.36	30,029,025.00	-
300073	当升科技	2014年12月11日	重大事项停牌	17.60	未知	未知	955,316	16,593,432.41	16,813,561.60	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2014年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末