

## 嘉实优质企业股票型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

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

报告送出日期：2015年7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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

承担法律责任。基金托管人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

承担法律责任。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未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金经中国证监会2010年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

嘉实优质企业股票型证券投资基金

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1月28日

报告期末基金份额总额：1,782,642,527.18份

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、预期收益率相对较高的投资标的前提下优先考虑股票类资产配置，剩余资金配置债券类和现金类等大类资产。

基金经理：王亚伟

风险收益特征：高风险、较高收益。

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

报告期期末至下一报告期期末的定期报告日期：2015年6月30日止。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日—2015年6月30日)

1.本期已实现收益 1,518,759,967.26

2.本期利润 B13,468,009.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.03466

4.期末基金份额净值 3,210,420.2790

5.期末可供分配基金份额 1,801

注：(1)本期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)扣除必要的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额所产生的费用，计算费用后实际收益水平低于未扣除费用前的情况。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长(%) 净值增长(%) 超额回报率(%) 业绩比较基准(%)

过去三个月 106.1% 34.8% 71.3% 9.4%

3.2.2 百分比基金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

序号 代码 基金名称

1 国家债券 嘉实国债

2 行业股票 飞利信

3 金融债券 顺鑫农业

4 其他债券 东方财富

5 买入返售金融资产 蒙银科技

6 银行存款 10,010,906

7 其他资产 129,715,351

8 合计 4,04

注：4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 6,492,594 9.06

2 行业股票 6,196,606 8.96

3 金融债券 4,464,890 5.25

4 立讯精密 4,769,622 5.02

5 顺鑫农业 3,932,440 4.72

6 飞利信 4,059,610 4.72

7 东方财富 3,966,462 4.38

8 东方财富 3,0111 4.32

9 航天信息 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 2,937,240 4.04

注：4.5 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 002415 美盈森 290,067 290,967,732.00

2 300017 网宿科技 287,646 404,110

3 002303 美锦能源 161,360 919,82

4 002475 立讯精密 161,260 919,82

5 300287 飞利信 151,151 351,520

6 300292 航天信息 151,382 896,90

7 300011 顺鑫农业 140,456 309,84

8 300011 顺鑫农业 134,261 084,52

9 300011 顺鑫农业 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 6,010,906 129,715,351

注：4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 6,492,594 9.06

2 行业股票 6,196,606 8.96

3 金融债券 4,464,890 5.25

4 立讯精密 4,769,622 5.02

5 顺鑫农业 3,932,440 4.72

6 飞利信 4,059,610 4.72

7 东方财富 3,966,462 4.38

8 东方财富 3,0111 4.32

9 航天信息 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 6,010,906 129,715,351

注：4.7 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 002415 美盈森 290,067 290,967,732.00

2 300017 网宿科技 287,646 404,110

3 002303 美锦能源 161,360 919,82

4 002475 立讯精密 161,260 919,82

5 300287 飞利信 151,151 351,520

6 300011 顺鑫农业 151,382 896,90

7 300011 顺鑫农业 140,456 309,84

8 300011 顺鑫农业 2,074,812 4.18

9 300011 顺鑫农业 6,010,906 129,715,351

注：4.8 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债券明细

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 6,492,594 9.06

2 行业股票 6,196,606 8.96

3 金融债券 4,464,890 5.25

4 立讯精密 4,769,622 5.02

5 顺鑫农业 3,932,440 4.72

6 飞利信 4,059,610 4.72

7 东方财富 3,966,462 4.38

8 东方财富 3,0111 4.32

9 航天信息 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 6,010,906 129,715,351

注：4.9 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 002415 美盈森 290,067 290,967,732.00

2 300017 网宿科技 287,646 404,110

3 002303 美锦能源 161,360 919,82

4 002475 立讯精密 161,260 919,82

5 300287 飞利信 151,151 351,520

6 300011 顺鑫农业 151,382 896,90

7 300011 顺鑫农业 140,456 309,84

8 300011 顺鑫农业 2,074,812 4.18

9 300011 顺鑫农业 6,010,906 129,715,351

注：4.10 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债券明细

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 6,492,594 9.06

2 行业股票 6,196,606 8.96

3 金融债券 4,464,890 5.25

4 立讯精密 4,769,622 5.02

5 顺鑫农业 3,932,440 4.72

6 飞利信 4,059,610 4.72

7 东方财富 3,966,462 4.38

8 东方财富 3,0111 4.32

9 航天信息 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 6,010,906 129,715,351

注：4.11 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 002415 美盈森 290,067 290,967,732.00

2 300017 网宿科技 287,646 404,110

3 002303 美锦能源 161,360 919,82

4 002475 立讯精密 161,260 919,82

5 300287 飞利信 151,151 351,520

6 300011 顺鑫农业 151,382 896,90

7 300011 顺鑫农业 140,456 309,84

8 300011 顺鑫农业 2,074,812 4.18

9 300011 顺鑫农业 6,010,906 129,715,351

注：4.12 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债券明细

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 6,492,594 9.06

2 行业股票 6,196,606 8.96

3 金融债券 4,464,890 5.25

4 立讯精密 4,769,622 5.02

5 顺鑫农业 3,932,440 4.72

6 飞利信 4,059,610 4.72

7 东方财富 3,966,462 4.38

8 东方财富 3,0111 4.32

9 航天信息 2,074,812 4.18

10 蒙银科技 6,010,906 129,715,351

注：4.13 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明细