

(上接B217版)

住所、办公地址	深圳市福田区益田路888号招商银行大厦40-42层	联系人	方文
法定代表人	张勇	联系电话	(0755)36319939
电话	(0755)32832852	传真	(0755)36319940
网址	www.cscs.com.cn	客服电话	(0755)36319951

(113) 第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市福田区益田路12号民生时代广场南座26、28层	联系人	
法定代表人	刘学军	联系电话	(0755)32685081
电话	(0755)32685282	传真	
网址	www.fdc.com	客服电话	4008881888

(114) 金元证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路36号金元大厦401	联系人	
法定代表人	林海云	联系电话	(0755)36319939
电话	(0755)36319939	传真	(0755)36319940
网址	www.jysec.com	客服电话	400-888-228

(115) 中航证券有限公司

住所、办公地址	南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼	联系人	戴雷
法定代表人	杜松	联系电话	(0791)86760881
电话	(0791)86760881	传真	(0791)86770178
网址	www.atsec.com.cn	客服电话	400-886-567

(116) 德邦证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市普陀区曹杨路510号南华世纪楼9楼	联系人	
法定代表人	姚文平	联系电话	(021)68761616
电话	(021)68761616	传真	(021)68767981
网址	www.dbsec.com.cn	客服电话	400888120

(117) 西部证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市东大街232号西部证券大厦16-17楼	联系人	刘莹
法定代表人	刘建武	联系电话	(029)87417012
电话	(029)87417027	传真	(029)87417012
网址	www.westsec.com	客服电话	95582

(118) 华福证券有限责任公司

住所、办公地址	福州市五四路157号新天光大厦7、8层	联系人	
法定代表人	黄金堂	联系电话	(0591)87863623
电话	(0591)87863623	传真	(0591)87863610
网址	www.hfsc.com.cn	客服电话	(0591)796326

(119) 华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路63号财富中心	联系人	李昕田
法定代表人	李俊宏	联系电话	(0931)4899208
电话	(0931)4899208	传真	(0931)4899268
网址	www.hlzq.com	客服电话	(0931)666688

(120) 中国国际金融有限公司

住所、办公地址	北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	联系人	
法定代表人	李剑阁	联系电话	(010)85679533
电话	(010)85679533	传真	(010)85679228
网址	www.cicc.com.cn	客服电话	(010)85679169

(121) 财通证券股份有限公司

住所、办公地址	杭州中庆路15号嘉华国际商务中心	联系人	开亚
法定代表人	沈卫平	联系电话	(0571)87925129
电话	(0571)87925129	传真	(0571)86336, 96236
网址	www.ctsec.com	客服电话	(上海地区)

(122) 上海华信证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼	联系人	
法定代表人	罗奇	联系电话	021-38784818
电话	021-38784818	传真	021-38787587
网址	www.hxsec.com	客服电话	68777877

(123) 华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路4018号华鑫大厦28层A01、A02单元	联系人	孔亮
法定代表人	陈春明	联系电话	(0755)36263788
电话	(0755)36263788	传真	(0755)36263400
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	(021)31019999、(029)40618888

(124) 瑞银证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街7号英商国际金融中心12层、13层	联系人	辛华
法定代表人	程实	联系电话	(010)58326748
电话	(010)58326112	传真	(010)58326748
网址	www.ubschina.com	客服电话	400-887-8827

(125) 中国中投证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路与福中路交界东南角财富中心A座18层-21层及30层	联系人	
法定代表人	高涛	联系电话	(0755)82032442
电话	(0755)82032442	传真	(0755)8206539
网址	www.china-sec.com	客服电话	400-600-8088

(126) 中山证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	联系人	李静
法定代表人	李伟	联系电话	(0755)82670886
电话	(0755)82670886	传真	(0755)82690582
网址	www.zsq.com	客服电话	4001022011

(127) 日信证券有限责任公司

住所、办公地址	呼和浩特市新城区德林街18号	联系人	
法定代表人	孔松	联系电话	(010)66412537
电话	(010)66412537	传真	(010)66412537
网址	www.rxtz.com.cn	客服电话	4006698939

(128) 江海证券有限公司

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	联系人	刘刚
法定代表人	孙名扬	联系电话	0451-83863719
电话	0451-83863719	传真	0451-83827111
网址	www.jhsec.com.cn	客服电话	400-666-2288

(129) 国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街95号	联系人	金静
法定代表人	冉云	联系电话	(028)86669126
电话	(028)86669126	传真	(028)86669126
网址	www.gjsec.com	客服电话	4006660109

(130) 中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街新盛大厦A座6-9层	联系人	李霞
法定代表人	赵大伟	联系电话	(010)9353941
电话	(010)9353941	传真	(010)96653791
网址	www.mzsc.com	客服电话	400-889-3618

(131) 华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层	联系人	夏元
法定代表人	陈林	联系电话	(021)68777222
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	www.cwbstock.com	客服电话	4008209898

(132) 长城国瑞证券有限公司

住所、办公地址	厦门市湖里区湖里大道19号大厦十七楼	联系人	尹金文
法定代表人	王勇	联系电话	(0592)5516162
电话	(0592)5516162	传真	(0592)5516180
网址	www.wqsc.com	客服电话	(0592)5516158

(133) 爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼	联系人	陈敏
法定代表人	袁奇云	联系电话	(021)32229888
电话	(021)32229888	传真	021- 68726782
网址	www.gjsec.com	客服电话	(021)36340628

(134) 英大证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区福民路9号英大证券大厦十二、十三层	联系人	陈敏
法定代表人	陈敏	联系电话	(0755)83007159
电话	(0755)83007159	传真	(0755)83007159
网址	www.ydsec.com	客服电话	4000-188-688

(135) 华融证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街9号	联系人	
法定代表人	宋广文	联系电话	(010)58568628
电话	(010)58568628	传真	(010)58568611
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	(010)58568119

(136) 天风证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼	联系人	熊成
法定代表人	余劲	联系电话	(027)87610052
电话	(027)87610052	传真	(027)87618963
网址	www.tfsc.com	客服电话	4008050000

(137) 宏信证券有限责任公司

住所、办公地址	四川省成都市人民南路2段18号川信大厦10楼	联系人	刘建雄
法定代表人	张明	联系电话	(028-86190278
电话	(028-86190278	传真	(028-86190382
网址	www.hxsc.com	客服电话	400806366

(二) 注册登记机构

嘉实基金管理有限公司(同上)

(三) 律师事务所和经办律师

名称	国浩律师集团(北京)事务所	联系人	王卫良
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康大厦9层	联系人	王卫良
负责人	王卫良	联系电话	(010)65689064
电话	(010)65689064	传真	(010)65617681
经办律师	熊茂民		

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	联系人	王卫良
住所、办公地址	北京市海淀区东长安街1号东方广场安永华明会计师事务所三楼16层	联系人	王卫良
负责人	葛明	联系电话	(010)65636688
电话	(010)65636688	传真	(010)65618298
经办会计师	李慧民、王卫良		

四、基金的名称

本基金名称:嘉实优质企业股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

力争为基金份额持有人创造长期超额收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括:股票资产、衍生工具(权证、资产支持证券等)、债券资产(政府债券、金融债券;企业(公司)债券、可转债等)、债券回购、现金资产,以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票等权益类资产占基金资产的比例为60-95%;现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5-40%;现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证占基金资产净值的比例不超过3%。若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定,适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

(一) 基金投资策略

本基金在大类资产配置上,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的配置,剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

除主要的股票投资策略外,本基金还可通过新股申购策略、债券投资策略、及衍生工具投资策略,如:可转债投资策略、权证及其他金融工具投资策略等辅助投资策略,进一步为基金组合规避风险、增强收益。

1、新股投资策略

本基金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,精选和优化组合,力争为基金份额持有人创造长期超额收益。

首先,在个股选择上,本基金采用自下而上的个股精选策略,通过滚动“投资备选库流程”,强化投资纪律,保护组合质量,生成作为主要买入备选股票的“优质企业群”。

进而,在行业配置上,本基金采用行业配置适度均衡策略,通过滚动执行“行业配置流程”,确定或调整整个配置比例,从而构建组合、优化组合。

(二) 个股选择

本基金采取自下而上的个股精选策略。自下而上的投资策略相信,无论经济环境或行业环境如何变化,总有一些优质企业能超越其竞争,获得高于市场平均水平的回报。因而,自下而上的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。

在个股选择上,本基金执行“投资备选库流程”,包括:第一步,在内部和外部的研究范围内,通过估值筛选和特殊环境分析,建立投资备选库;

估值筛选:分析PE、PB、PCF、EV/EBITDA、ROE、ROA等指标,选择估值水

平较低或合理公司的公司;特殊环境分析:分析经济周期或经济结构趋势、管理变化、经营环境变化,寻找从中受益的公司。

第二步,从公司层面和股票层面,深度分析投资备选库内的股票,精选“优质企业群”作为本基金组合的主要买入备选股票;

从公司层面看,

一般情况下,“优质企业群”应覆盖所有影响国民经济的重点行业和具备成长潜力的新兴行业,并具备较强的行业代表性;主要通过过了初创期、具有较好业绩记录的公司组成;其中的大部分公司从事专业化经营,在“优质企业群”的公司通常具备以下特征:

具备完善的企业治理结构和有效的激励机制;

拥有优秀的企业家或管理层,具有良好的业绩记录,管理层对所属行业有深刻理解和较强的前瞻性,形成了清晰的发展战略及有利于提升投资者价值的盈利模式;

基本面向正在改善;

比较包括ROIC、企业加权平均资本成本(WACC)、企业成长(C)等核心指标,具有中长期成长性;

从股票层面看,

进入“优质企业群”的个股,

比较动态市盈率、PEG等指标,目前的估值水平明显偏低或相对合理,或

具有中短期市场表现的催化因素。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

在个股调整上,本基金将动态跟踪研究优质企业的基本面,结合行业配置比例和个股动态估值水平,进行组合层面的优化配置。

8、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

九、基金的业绩比较基准

业绩比较基准 = 沪深300 指数×95% + 上证国债指数×5%

十、基金的风险收益特征

较高风险,较高收益。

十一、基金的投资组合报告

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个别及连带责任。

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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,321,040,238.31	91.47
2	固定收益	3,321,040,238.31	91.47
3	货币资金	79,594,000.00	2.20
4	债券资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其中:买入返售金融资产	-	-
11	其中:买入返售金融资产	-	-
12	其中:买入返售金融资产	-	-
13	其中:买入返售金融资产	-	-
14	其中:买入返售金融资产	-	-
15	其中:买入返售金融资产	-	-
16	其中:买入返售金融资产	-	-
17	其中:买入返售金融资产	-	-
18	其中:买入返售金融资产	-	-
19	其中:买入返售金融资产	-	-
20	其中:买入返售金融资产	-	-
21	其中:买入返售金融资产	-	-
22	其中:买入返售金融资产	-	-
23	其中:买入返售金融资产	-	-
24	其中:买入返售金融资产	-	-
25	其中:买入返售金融资产	-	-
26	其中:买入返售金融资产	-	-
27	其中:买入返售金融资产	-	-
28	其中:买入返售金融资产	-	-
29	其中:买入返售金融资产	-	-
30	其中:买入返售金融资产	-	-
31	其中:买入返售金融资产	-	-
32	其中:买入返售金融资产	-	-
33	其中:买入返售金融资产	-	-
34	其中:买入返售金融资产	-	-
35	其中:买入返售金融资产	-	-
36	其中:买入返售金融资产	-	-
37	其中:买入返售金融资产	-	-