

嘉实优质企业混合型证券投资基金

2017年年度报告摘要

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：2018年03月28日

§1重要提示
基金管理人承诺，基金管理人承诺不存在虚假记载、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基金合同规定，于2018年3月23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。

根据基金管理人2015年8月3日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，嘉实优质企业股票型证券投资基金自2015年8月3日起更名为嘉实优质企业混合型证券投资基金。

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，并不对基金净值和基金收益作出任何承诺。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2017年1月1日起至2017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	嘉实优质企业混合型证券投资基金
基金简称	嘉实优质混合
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	1,385,085,297.91
基金合同存续期限	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稳定增值。

投资策略：在具备投资条件、预期收益良好的投资标的优先选择股票资产配置，辅以配置于债券和现金等大类资产，根据以下自上而下的策略配置资产：首先分析宏观经济政策、金融政策、利率和汇率变化，判断新股申购、债券投资及衍生品工具等投资机会、风险和收益。

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：中高风险，权益投资。

2.3基金管理人及基金托管人

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	杨文辉	朱刚
信息披露负责人	曹佳佳	010-65215588
电子邮箱	service@jfund.com	021-61618888
客户服务电话	400-600-8880	95528
传真	010-65215588	021-63902540

2.4信息披露方式
信息披露年度与基金管理人官方网站：<http://www.jfund.com>
基金管理人官方网站：<http://www.jfund.com>

§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	2017年	2016年	2015年
1.11 期末基金份额总额	1,385,085,297.91	1,385,085,297.91	1,385,085,297.91
1.12 本期已实现收益	260,951,681.41	-85,980,250.05	1,623,604,500.26
1.13 本期公允价值变动收益	407,071,675.81	-503,089,054.01	2,112,991,983.90
1.14 本期加权平均净值增长率	0.2470	-0.2281	0.9154
1.15 期末加权平均净值增长率	16.54%	-1.580%	60.30%
1.16 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.17 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.18 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.19 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.20 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.21 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.22 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.23 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.24 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.25 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.26 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.27 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.28 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.29 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.30 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.31 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.32 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.33 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.34 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.35 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.36 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.37 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.38 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.39 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.40 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.41 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.42 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.43 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.44 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.45 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.46 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.47 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.48 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.49 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.50 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.51 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.52 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.53 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.54 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.55 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.56 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.57 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.58 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.59 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.60 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.61 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.62 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.63 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.64 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.65 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.66 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.67 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.68 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.69 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.70 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.71 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.72 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.73 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.74 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.75 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.76 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.77 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.78 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.79 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.80 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.81 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.82 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.83 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.84 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.85 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.86 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.87 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.88 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.89 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.90 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.91 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.92 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.93 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.94 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.95 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.96 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.97 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.98 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.99 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%
1.100 期末基金份额净值增长率	17.73%	-1.635%	77.05%

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(不含公允价值变动损益)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)所述基金份额持有人持有基金的各项费用，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已实现部分的孰低者。

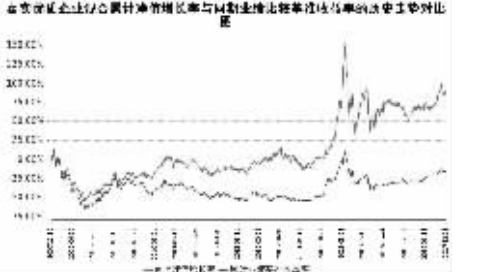
3.2基金净值表现
3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率差③	净值增长率差④	①-③	②-④
过去三个月	6.09%	1.22%	4.82%	0.76%	1.27%	0.47%
过去六个月	5.09%	0.89%	3.44%	0.86%	-1.33%	0.33%
过去一年	17.73%	0.94%	20.69%	0.80%	-2.26%	0.34%
过去三年	74.73%	2.13%	14.60%	1.00%	58.91%	0.52%
过去五年	105.70%	1.83%	58.50%	1.47%	47.22%	0.36%
基金合同生效以来最高收益	85.55%	1.68%	-1.640%	1.89%	101.59%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数×95%+1.8%上证国债指数×5%。本基金的业绩比较基准按照公式每日交易进行计算，计算方法如下：
Breturn=(95%×沪深300指数(R)+5%×(上证国债指数(R)+上证国债指数(R-1)))/Breturn(R-1)
注：R-1为T-2。

3.2.2自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实优质企业混合基金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

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

2.按基金合同约定，本基金基金合同生效日起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)投资组合限制(八)投资组合比例限制的规定；(1)本基金管理人有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的0%；(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上市公司发行的证券，不得超过该证券的0%；(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)本基金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。

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对比

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

2.按基金合同约定，本基金基金合同生效日起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)投资组合限制(八)投资组合比例限制的规定；(1)本基金管理人有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的0%；(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上市公司发行的证券，不得超过该证券的0%；(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)本基金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。

3.2.4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对比

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

2.按基金合同约定，本基金基金合同生效日起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)投资组合限制(八)投资组合比例限制的规定；(1)本基金管理人有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的0%；(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上市公司发行的证券，不得超过该证券的0%；(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)本基金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。

3.2.5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对比

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

2.按基金合同约定，本基金基金合同生效日起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)投资组合限制(八)投资组合比例限制的规定；(1)本基金管理人有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的0%；(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上市公司发行的证券，不得超过该证券的0%；(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)本基金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。

3.2.6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对比

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

2.按基金合同约定，本基金基金合同生效日起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)投资组合限制(八)投资组合比例限制的规定；(1)本基金管理人有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的0%；(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上市公司发行的证券，不得超过该证券的0%；(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)本基金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。

3.2.7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对比

注：1.本基金由嘉实安邦保本混合开放式证券投资基金转型而成，自2017年2月8日(含)日起，本基金基金合同生效，嘉实安邦保本混合基金合同失效。

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：2018年03月28日

§1重要提示
基金管理人承诺，基金管理人承诺不存在虚假记载、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基金合同规定，于2018年3月23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。

根据基金管理人2015年8月3日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，嘉实优质企业股票型证券投资基金自2015年8月3日起更名为嘉实优质企业混合型证券投资基金。

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，并不对基金净值和基金收益作出任何承诺。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2017年1月1日起至2017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	嘉实优质企业混合型证券投资基金
基金简称	嘉实优质混合
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	1,385,085,297.91
基金合同存续期限	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稳定增值。

投资策略：在具备投资条件、预期收益良好的投资标的优先选择股票资产配置，辅以配置于债券和现金等大类资产，根据以下自上而下的策略配置资产：首先分析宏观经济政策、金融政策、利率和汇率变化，判断新股申购、债券投资及衍生品工具等投资机会、风险和收益。

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：中高风险，权益投资。

2.3基金管理人及基金托管人

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	杨文辉	朱刚
信息披露负责人	曹佳佳	010-65215588
电子邮箱	service@jfund.com	021-61618888
客户服务电话	400-600-8880	95528
传真	010-65215588	021-63902540

2.4信息披露方式
信息披露年度与基金管理人官方网站：<http://www.jfund.com>
基金管理人官方网站：<http://www.jfund.com>

§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

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、内部控制和监督等方面入手，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝在不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者的合法权益。

公司公平交易管理制度主要相关内在于股票、债券的一级市场中，二级市场交易以投资管理过程中符合相关投资公平交易原则的需求要求，投资组合组合内成员的投资指令信息、投资集中，并由投资交易部统一的制度下统一设立决策，由交易部统一执行，所有交易均通过集中交易系统，交易指令由系统统一生成，必须经过公平交易员集中审核，所有交易有平等的交易执行，共享交易资源。对申购公开交易指令及申购市面交易、交易所公开交易等非集中竞价交易指令，对申购公开交易，保证投资组合获得公平的交易机会。对于部分非集中竞价执行的、非公开发行股票申购等以公允价执行的交易，严格遵循交易组合竞价前，确立交易策略、交易执行指令优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.32 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，各投资组合按照投资管理制度的规定独立决策，并执行投资指令，投资建设和实施投资业务方面享有公平的机会，通过完善制度和交易公平交易公平执行原则，严格的流程控制，通过系统的技术改进，确保公平交易原则的执行，对投资交易行为进行流程控制，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期评估并完善记录记录相关信息，及时完成每年度和每度公平交易专项考核。