

嘉实优质企业股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 备查文件目录.....	41
11.1 备查文件目录.....	41
11.2 存放地点.....	41
11.3 查阅方式.....	41

§ 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	4,225,047,492.26 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
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	上海市中山东一路 12 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		100005	200120
法定代表人		安奎	吉晓辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 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	-0.1033
本期加权平均净值利润率	-10.87%
本期基金份额净值增长率	-9.70%
3.1.2 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
期末基金份额净值	0.932
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-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
过去一个月	4.60%	0.97%	0.40%	0.74%	4.20%	0.23%

过去三个月	1.97%	1.16%	0.90%	0.83%	1.07%	0.33%
过去六个月	-9.70%	1.34%	-6.62%	0.99%	-3.08%	0.35%
过去一年	-4.57%	1.33%	-1.32%	1.11%	-3.25%	0.22%
过去三年	-2.39%	1.20%	-27.08%	1.23%	24.69%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-6.00%	1.46%	-54.03%	1.75%	48.03%	-0.29%

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

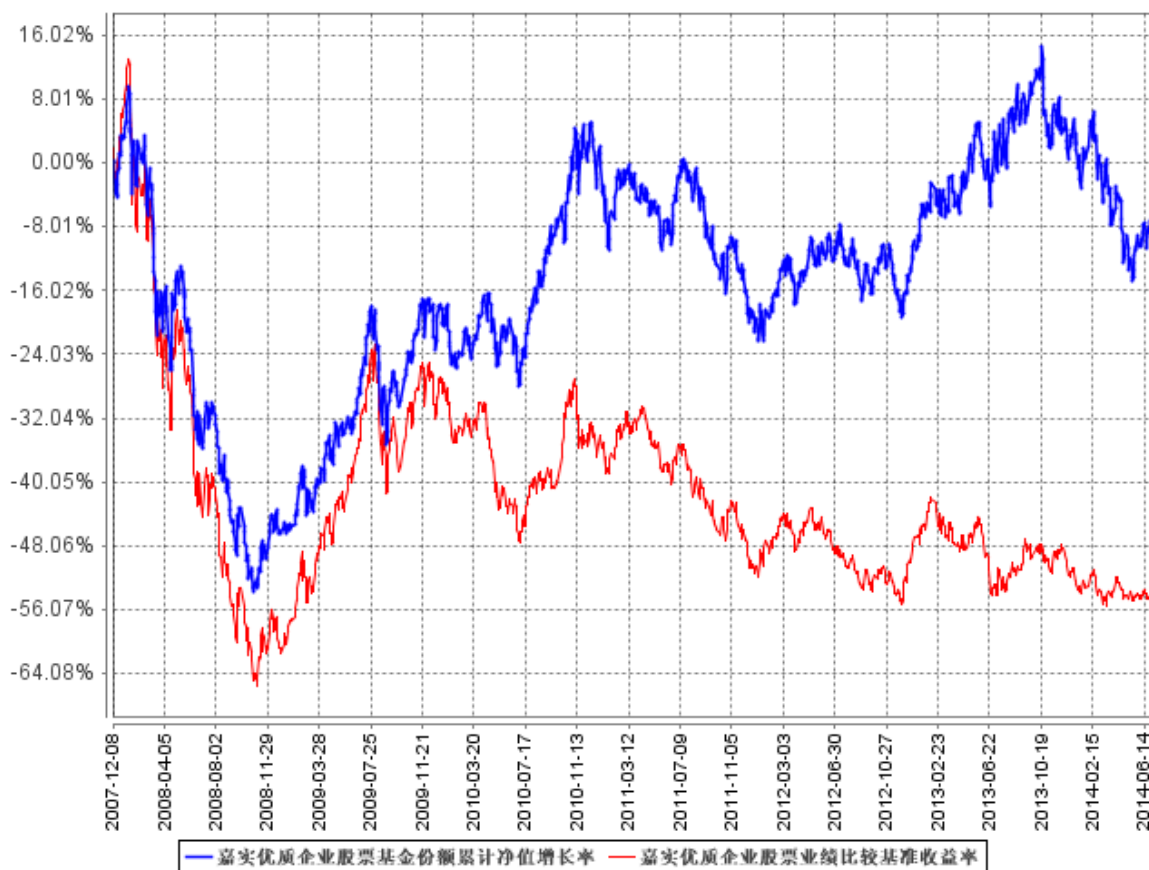
$Return(t) = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{上证国债指数}(t) / \text{上证国债指数}(t-1) - 1)$

$Benchmark(t) = (1 + Return(t)) \times Benchmark(t-1)$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实优质企业股票基金份额累计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



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 6 月 30 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。

§ 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。公司注册地上海, 公司总部设在北京, 在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。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 6 月 30 日, 基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、62 只开放式证券投资基金, 具体包括嘉实丰和价值封闭、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 300ETF 联接 (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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券等证券投资基金。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		
邵健	本基金、嘉实增长混合基金经理, 公司总经理助理	2013 年 6 月 7 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、行业公司部副经理, 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。
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。

注: (1) 任职日期、离任日期是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; (3) 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, 增聘胡涛先生为本基金基金经理, 与现任基金经理刘辉先生共同管理本基金。

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 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 3 次，均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，但不存在利益输送行为。

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

上半年资本市场表现出了明显的震荡行情。一季度市场的担心主要来自于对宏观经济层面的悲观与谨慎。这表现在以下几个方面：首先，政策层面强调调整经济发展结构，弱化投资对于旧有发展模式的依赖，因此导致市场对于 GDP 的增长速度判断趋于悲观，尤其对于房地产产业链相关行业的发展前景持有负面的看法。其次，流动性层面来看，无论是央行控制流动性的表态，还是人民币贬值的预期，以及互联网金融发展对于存款利率的被动提高过程，市场无风险利率的提升都在持续。因此，综合上述宏观面带来的隐忧，市场估值层面体现为持续的收缩。但是一季度中，市场依然呈现出结构性行情，代表转型方向的医疗服务及器械、计算机应用软件等行业表现突出，而煤炭、钢铁等传统板块则表现落后。在主题方面，新能源汽车、信息安全等最为活跃。本组合基于对未来经济结构与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。

二季度，在经济下滑与政策托底预期的相互作用下，市场体现出了震荡的走势。房地产行业由于需求的疲弱以及价格的高企，导致了房屋销售量以及后续的地产投资增长率都在继续下滑，

进而形成了对于经济增长的拖累。在此背景下，国家出台了一些稳定经济增长的政策措施，来对冲地产下滑带来的经济下行压力。与此对应，资本市场还是体现出了一定的结构性行情特征，代表新经济的板块如信息安全、国产化替代等细分领域涨幅较大，而权重板块则表现相对平稳。

本组合基于对未来经济结构与相应行业景气度等因素的判断，在二季度对医药、通信设备、计算机以及其它一些具备较好业绩增长前景的细分领域，进行了积极增持，并进一步优化了组合的持仓结构。

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 0.932 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.70%，业绩比较基准收益率为-6.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断经济特征相对平稳，市场的结构性分化将会愈发明显。其中三季度，我们预期仍会有一些稳定经济增长预期的措施出台，可能会来自于阶段性的加大局部投资力度，继续扩大信息消费等措施。此外，从流动性层面来看，为配合稳定经济增长的预期，流动性则可能会出现恢复性好转。因此，综合上述因素判断，三季度宏观经济可能会阶段性企稳，市场的整体估值水平可能会出现进一步的修复，在沪港通、国企改革等因素共同催化下，低估值的大盘股迎来阶段性的投资机会。

四季度预计宏观经济增长仍将会略显平稳，而优质成长股将会迎来估值的修复和切换。在此背景下，我们判断证券市场的投资机会仍将以结构性为主，符合经济转型方向、估值合理、业绩增长确定的上市公司将具备相对较好的投资吸引力。在行业方面，我们将继续对医疗服务和器械、信息技术、通信产业以及新材料等行业保持重点的关注。

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验。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证券业协会等。

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“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-463,276,908.67 元，3.1.2 “期末可供分配利润”为-279,390,002.22 元，3.1.2 “期末可供分配基金份额利润”-0.0661 元，以及本基金基金合同（二十三（三）收益分配原则）“4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值”，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	306,420,252.62	268,160,263.51
结算备付金		6,207,073.10	3,742,280.81
存出保证金		3,592,812.42	2,790,853.65
交易性金融资产	6.4.7.2	3,666,696,357.94	5,000,693,190.79
其中：股票投资		3,586,519,357.94	4,830,320,980.79
基金投资		-	-
债券投资		80,177,000.00	170,372,210.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,933,137.49	-
应收利息	6.4.7.5	2,336,068.14	1,694,911.13
应收股利		-	-
应收申购款		355,638.78	4,126,418.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,988,541,340.49	5,281,207,918.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,959,383.30	14,041,314.33
应付赎回款		6,401,416.43	8,528,784.44
应付管理人报酬		4,745,277.64	6,829,849.89
应付托管费		790,879.59	1,138,308.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,989,924.68	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	6.4.7.8	706,493.04	908,501.14
负债合计		49,593,374.68	33,035,044.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,218,337,968.03	5,034,630,740.58
未分配利润	6.4.7.10	-279,390,002.22	213,542,133.29
所有者权益合计		3,938,947,965.81	5,248,172,873.87
负债和所有者权益总计		3,988,541,340.49	5,281,207,918.67

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.932 元，基金份额总额 4,225,047,492.26 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-408,700,361.81	942,280,179.76
1.利息收入		6,198,046.86	12,362,719.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,150,343.29	2,700,173.62
债券利息收入		2,047,703.57	7,672,653.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,989,892.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益		268,288,360.16	418,650,050.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	255,804,574.31	352,276,454.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	610,204.74	6,554,319.76
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	11,873,581.11	59,819,276.64
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-684,087,365.30	508,418,129.11
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	900,596.47	2,849,280.48
减：二、费用		54,576,546.86	93,291,078.17
1. 管理人报酬		31,753,184.94	63,712,430.65
2. 托管费		5,292,197.49	10,618,738.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	17,310,249.72	18,730,106.68

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	220,914.71	229,802.41
三、利润总额		-463,276,908.67	848,989,101.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-463,276,908.67	848,989,101.59

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	-	-463,276,908.67	-463,276,908.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-816,292,772.55	11,554,063.90	-804,738,708.65
其中：1.基金申购款	361,490,826.08	-12,269,674.64	349,221,151.44
2.基金赎回款	-1,177,783,598.63	23,823,738.54	-1,153,959,860.09
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）	4,218,337,968.03	-279,390,002.22	3,938,947,965.81
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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）	-	848,989,101.59	848,989,101.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,797,729,054.54	-2,031,438.83	-2,799,760,493.37
其中：1.基金申购款	1,367,357,176.47	-47,962,514.54	1,319,394,661.93

2. 基金赎回款	-4,165,086,231.01	45,931,075.71	-4,119,155,155.30
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)	6,875,365,777.93	-89,336,561.22	6,786,029,216.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实优质企业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金（以下简称“嘉实保本基金”）转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2007 年 11 月 22 日证监基金字[2007]320 号文《关于核准嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，嘉实保本基金到期日后由保本基金投资转型变更转为股票型基金，修改的内容包括但不限于调整基金名称、投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、业绩比较基准、分红条款等事项，并更名为“嘉实优质企业股票型证券投资基金”。自 2007 年 12 月 8 日起，本基金基金合同生效，嘉实保本基金基金合同失效。本基金是契约型开放式股票型基金，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据上述证监基金字[2007]320 号文的核准，基金管理人于 2007 年 11 月 26 日至 2007 年 12 月 5 日向社会开放集中申购，集中申购扣除认购费后的净申购金额为人民币 2,365,172,140.95 元，在集中申购期间产生的利息为人民币 179,811.51 元，以上实际收到申购款合计为人民币 2,365,351,952.46 元，折合 2,365,351,952.46 份基金份额。另外，嘉实基金管理有限公司于 2007 年 12 月 7 日对嘉实保本基金进行了基金份额拆分操作，基金份额拆分比例为 1:1.001508985（保留到小数点后 9 位），基金份额数计算结果保留到小数点后 2 位，由此产生的误差归入基金财产。相应地，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元。根据上述拆分比例，基金管理人对各基金份额持有人所持有的基金份额进行了计算。拆分后持有人持有的嘉实保本基金基金份额并入本基金。

本基金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他金融工具。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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×95%+上证国债指数×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	306,420,252.62
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	306,420,252.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,355,980,176.13	3,586,519,357.94	230,539,181.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	79,959,206.66	80,177,000.00	217,793.34
	合计	79,959,206.66	80,177,000.00	217,793.34
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,435,939,382.79	3,666,696,357.94	230,756,975.15	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2014年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	154,044.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,513.88
应收债券利息	2,178,038.36
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	15.96
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,455.12
合计	2,336,068.14

6.4.7.6 其他资产

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,989,724.68
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	2,989,924.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	8,138.76
预提费用	198,354.28
合计	706,493.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,042,753,101.52	5,034,630,740.58
本期申购	362,078,560.91	361,490,826.08
本期赎回	-1,179,784,170.17	-1,177,783,598.63
本期末	4,225,047,492.26	4,218,337,968.03

注：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,247,552.88	-95,705,419.59	213,542,133.29
本期利润	220,810,456.63	-684,087,365.30	-463,276,908.67
本期基金份额交易产生的变动数	-82,070,400.61	93,624,464.51	11,554,063.90
其中：基金申购款	40,686,787.89	-52,956,462.53	-12,269,674.64
基金赎回款	-122,757,188.50	146,580,927.04	23,823,738.54
本期已分配利润	-41,209,290.74	-	-41,209,290.74
本期末	406,778,318.16	-686,168,320.38	-279,390,002.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	4,064,267.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	61,298.78
其他	24,777.50
合计	4,150,343.29

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	6,492,312,158.59
减：卖出股票成本总额	6,236,507,584.28
买卖股票差价收入	255,804,574.31

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券、债券到期兑付成交总额	111,988,941.32

减：卖出债券、债券到期兑付成本总额	109,877,253.34
减：应收利息总额	1,501,483.24
债券投资收益	610,204.74

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,873,581.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,873,581.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-684,087,365.30
——股票投资	-683,733,788.64
——债券投资	-353,576.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-684,087,365.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	806,627.02
基金转出费收入	93,969.45
合计	900,596.47

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	17,309,099.72

银行间市场交易费用	1,150.00
合计	17,310,249.72

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
其他	400.00
银行划款手续费	13,160.43
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	220,914.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（浦发银行）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 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6月30日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	31,753,184.94	63,712,430.65
其中：支付销售机构的客户维护费	5,629,385.05	8,039,822.25

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,292,197.49	10,618,738.43

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。

6.4.10.3 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 6 月 30 日）及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 6 月 30 日）及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金投资本产品。

6.4.10.4.2 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 06 月 30 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	306,420,252.62	4,064,267.01	104,007,509.18	2,429,780.49

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。

6.4.10.6 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6月30日）及上年度可比期间（2013年1月1日至2013年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2014年1月17日	-	2014年1月17日	0.0850	24,558,487.18	16,650,803.56	41,209,290.74	注：2013年年度收益分配于2014年实施
合计	-	-	-	0.0850	24,558,487.18	16,650,803.56	41,209,290.74	

6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
002551	尚荣医疗	2014年6月12日	重大事项停牌	34.01	未知	未知	3,060,317	127,207,188.89	104,081,381.17	-
300369	绿盟科技	2014年6月26日	重大事项停牌	61.27	未知	未知	974,408	60,588,125.10	59,701,978.16	-
002565	上海绿新	2014年6月	重大事项	8.64	2014年7月	9.10	4,103,505	46,557,039.77	35,454,283.20	-

		16 日	停牌		7 日					
300253	卫宁软件	2014 年 5 月 28 日	重大事项停牌	40.53	2014 年 8 月 1 日	37.50	224,573	9,168,812.08	9,101,943.69	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的本基金管理人治理结构与内部控制体系，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部

和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	306,420,252.62	-	-	-	306,420,252.62
结算备付金	6,207,073.10	-	-	-	6,207,073.10
存出保证金	3,592,812.42	-	-	-	3,592,812.42
交易性金融资产	80,177,000.00	-	-	3,586,519,357.94	3,666,696,357.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,933,137.49	2,933,137.49
应收利息	-	-	-	2,336,068.14	2,336,068.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	24,156.77	-	-	331,482.01	355,638.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	396,421,294.91	-	-	3,592,120,045.58	3,988,541,340.49
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	33,959,383.30	33,959,383.30
应付赎回款	-	-	-	6,401,416.43	6,401,416.43
应付管理人报酬	-	-	-	4,745,277.64	4,745,277.64
应付托管费	-	-	-	790,879.59	790,879.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,989,924.68	2,989,924.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	706,493.04	706,493.04
负债总计	-	-	-	49,593,374.68	49,593,374.68
利率敏感度缺口	396,421,294.91	-	-	3,542,526,670.90	3,938,947,965.81
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	268,160,263.51	-	-	-	268,160,263.51
结算备付金	3,742,280.81	-	-	-	3,742,280.81
存出保证金	2,790,853.65	-	-	-	2,790,853.65
交易性金融资产	159,008,000.00	-	11,364,210.00	4,830,320,980.79	5,000,693,190.79

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,694,911.13	1,694,911.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	81,254.94	-	-	4,045,163.84	4,126,418.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	433,782,652.91	-	11,364,210.00	4,836,061,055.76	5,281,207,918.67
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	14,041,314.33	14,041,314.33
应付赎回款	-	-	-	8,528,784.44	8,528,784.44
应付管理人报酬	-	-	-	6,829,849.89	6,829,849.89
应付托管费	-	-	-	1,138,308.33	1,138,308.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,588,286.67	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	-	-	-	908,501.14	908,501.14
负债总计	-	-	-	33,035,044.80	33,035,044.80
利率敏感度缺口	433,782,652.91	-	11,364,210.00	4,803,026,010.96	5,248,172,873.87

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	84,821.73	448,946.39
市场利率上升 25 个基点	-84,613.62	-445,139.39	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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%。于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,586,519,357.94	91.05	4,830,320,980.79	92.04
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,586,519,357.94	91.05	4,830,320,980.79	92.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	174,095,936.90	185,164,771.38

	业绩比较基准下降 5%	-174,095,936.90	-185,164,771.38
--	-------------	-----------------	-----------------

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,586,519,357.94	89.92
	其中：股票	3,586,519,357.94	89.92
2	固定收益投资	80,177,000.00	2.01
	其中：债券	80,177,000.00	2.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	312,627,325.72	7.84
7	其他各项资产	9,217,656.83	0.23
	合计	3,988,541,340.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	43,141,044.36	1.10
B	采矿业	10,880,445.60	0.28
C	制造业	2,330,876,475.63	59.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	179,410,972.55	4.55
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	907,377,827.79	23.04
J	金融业	44,186,320.17	1.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	27,554,696.10	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	43,091,575.74	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,586,519,357.94	91.05

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002358	森源电气	6,453,713	160,439,305.18	4.07
2	002450	康得新	6,030,409	137,191,804.75	3.48
3	002065	东华软件	6,332,760	127,415,131.20	3.23
4	300017	网宿科技	1,898,936	121,152,116.80	3.08
5	300020	银江股份	3,431,001	104,988,630.60	2.67
6	600570	恒生电子	3,548,505	104,326,047.00	2.65
7	002551	尚荣医疗	3,060,317	104,081,381.17	2.64
8	300273	和佳股份	3,159,283	96,989,988.10	2.46
9	002595	豪迈科技	2,042,041	96,282,233.15	2.44
10	002439	启明星辰	4,313,527	92,266,342.53	2.34
11	300202	聚龙股份	3,157,462	88,282,637.52	2.24
12	300168	万达信息	4,646,669	85,266,376.15	2.16
13	002475	立讯精密	2,537,350	83,174,333.00	2.11
14	300026	红日药业	2,763,473	80,969,758.90	2.06
15	600594	益佰制药	1,907,635	78,461,027.55	1.99
16	002241	歌尔声学	2,796,759	74,561,594.94	1.89
17	300124	汇川技术	2,206,012	68,827,574.40	1.75
18	600557	康缘药业	2,396,376	68,775,991.20	1.75
19	002415	海康威视	4,007,482	67,886,745.08	1.72
20	002020	京新药业	3,690,523	66,429,414.00	1.69

21	000028	国药一致	1,616,090	64,562,795.50	1.64
22	000963	华东医药	1,187,004	64,098,216.00	1.63
23	002022	科华生物	2,743,858	63,245,926.90	1.61
24	600517	置信电气	6,218,632	63,181,301.12	1.60
25	600525	长园集团	5,703,105	62,962,279.20	1.60
26	300369	绿盟科技	974,408	59,701,978.16	1.52
27	300075	数字政通	1,795,348	58,043,600.84	1.47
28	002465	海格通信	3,561,600	56,736,288.00	1.44
29	002690	美亚光电	1,546,959	54,561,243.93	1.39
30	300177	中海达	3,468,053	53,928,224.15	1.37
31	002262	恩华药业	2,285,005	50,749,961.05	1.29
32	002250	联化科技	3,487,409	49,521,207.80	1.26
33	002202	金风科技	5,158,581	48,954,933.69	1.24
34	300303	聚飞光电	2,647,477	48,687,102.03	1.24
35	300024	机器人	1,647,005	48,421,947.00	1.23
36	600587	新华医疗	622,694	46,421,837.70	1.18
37	300326	凯利泰	1,191,414	44,654,196.72	1.13
38	300049	福瑞股份	1,538,520	44,309,376.00	1.12
39	002664	信质电机	849,521	43,622,903.35	1.11
40	002104	恒宝股份	2,218,504	43,482,678.40	1.10
41	000998	隆平高科	1,569,907	43,141,044.36	1.10
42	300144	宋城演艺	1,621,203	43,091,575.74	1.09
43	603000	人民网	1,013,838	39,732,311.22	1.01
44	002230	科大讯飞	1,474,837	39,230,664.20	1.00
45	600699	均胜电子	1,508,369	37,905,312.97	0.96
46	002565	上海绿新	4,103,505	35,454,283.20	0.90
47	603288	海天味业	1,004,812	34,002,838.08	0.86
48	300212	易华录	988,984	30,974,978.88	0.79
49	300071	华谊嘉信	1,769,730	27,554,696.10	0.70
50	600867	通化东宝	1,788,806	23,308,142.18	0.59
51	601601	中国太保	1,262,233	22,455,125.07	0.57
52	600837	海通证券	2,374,994	21,731,195.10	0.55
53	600416	湘电股份	2,215,448	21,201,837.36	0.54
54	600422	昆明制药	989,058	20,780,108.58	0.53
55	600261	阳光照明	2,099,152	20,739,621.76	0.53
56	300037	新宙邦	521,833	18,942,537.90	0.48
57	600535	天士力	476,455	18,472,160.35	0.47
58	002437	誉衡药业	345,441	17,790,211.50	0.45
59	002649	博彦科技	505,167	16,771,544.40	0.43

60	300073	当升科技	651,400	12,246,320.00	0.31
61	002349	精华制药	590,624	10,902,919.04	0.28
62	300164	通源石油	667,512	10,880,445.60	0.28
63	300287	飞利信	375,948	10,443,835.44	0.27
64	600580	卧龙电气	1,340,600	10,282,402.00	0.26
65	300253	卫宁软件	224,573	9,101,943.69	0.23
66	002410	广联达	301,147	7,962,326.68	0.20
67	002023	海特高新	116,400	2,223,240.00	0.06
68	300101	振芯科技	69,819	1,579,305.78	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002202	金风科技	202,942,632.91	3.87
2	002565	上海绿新	189,805,972.75	3.62
3	600517	置信电气	187,480,617.24	3.57
4	002358	森源电气	182,381,874.65	3.48
5	300020	银江股份	172,288,166.06	3.28
6	002219	恒康医疗	169,802,636.22	3.24
7	002551	尚荣医疗	164,963,692.26	3.14
8	002065	东华软件	156,035,898.68	2.97
9	600525	长园集团	129,115,065.53	2.46
10	300212	易华录	125,811,452.12	2.40
11	300049	福瑞股份	122,349,110.43	2.33
12	300026	红日药业	110,936,413.44	2.11
13	600703	三安光电	104,896,544.32	2.00
14	300017	网宿科技	98,902,310.97	1.88
15	300070	碧水源	96,241,391.89	1.83
16	601933	永辉超市	94,853,461.25	1.81
17	600872	中炬高新	93,389,882.93	1.78
18	300273	和佳股份	92,840,313.59	1.77
19	600594	益佰制药	92,194,417.69	1.76
20	002456	欧菲光	91,318,221.85	1.74

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600518	康美药业	339,519,489.84	6.47
2	300133	华策影视	279,117,462.13	5.32
3	002450	康得新	278,810,893.79	5.31
4	300104	乐视网	252,097,742.05	4.80
5	600887	伊利股份	235,783,139.46	4.49
6	600570	恒生电子	231,711,937.06	4.42
7	601633	长城汽车	226,722,310.73	4.32
8	000651	格力电器	225,924,008.14	4.30
9	000538	云南白药	210,509,872.04	4.01
10	600256	广汇能源	170,995,765.96	3.26
11	002241	歌尔声学	170,742,017.82	3.25
12	002202	金风科技	153,501,482.10	2.92
13	600309	万华化学	136,685,093.92	2.60
14	600315	上海家化	126,795,773.44	2.42
15	002219	恒康医疗	126,481,394.68	2.41
16	600517	置信电气	115,380,275.28	2.20
17	002565	上海绿新	109,770,355.98	2.09
18	600535	天士力	108,387,507.50	2.07
19	002081	金螳螂	101,645,466.14	1.94
20	002610	爱康科技	96,149,454.58	1.83

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,676,439,750.07
卖出股票收入（成交）总额	6,492,312,158.59

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,177,000.00	2.04

	其中：政策性金融债	80,177,000.00	2.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	80,177,000.00	2.04

7.6 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明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130428	13 农发 28	500,000	50,090,000.00	1.27
2	140320	14 进出 20	200,000	20,076,000.00	0.51
3	130243	13 国开 43	100,000	10,011,000.00	0.25

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,592,812.42
2	应收证券清算款	2,933,137.49
3	应收股利	-
4	应收利息	2,336,068.14
5	应收申购款	355,638.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	9,217,656.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002551	尚荣医疗	104,081,381.17	2.64	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
162,123	26,060.75	180,241,356.45	4.27%	4,044,806,135.81	95.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	555,285.23	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年12月8日）基金份额总额	320,378,336.97
本报告期期初基金份额总额	5,042,753,101.52
本报告期基金总申购份额	362,078,560.91
减：本报告期基金总赎回份额	1,179,784,170.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,225,047,492.26

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额、红利再投份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**（1）基金管理人的重大人事变动情况**

2014年4月29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》，聘请刘辉先生担任本基金基金经理，与现任基金经理邵健先生共同管理本基金。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，其资产托管与养老金业务部原总经理李桦同志自2014年4月起不再担任其资产托管与养老金业务部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国银河证券股份有限公司	2	6,787,510,743.65	55.78%	5,556,998.87	58.84%	-
中国国际金融有限公司	1	3,178,277,821.35	26.12%	2,224,794.42	23.56%	-
广州证券有限责任公司	1	819,183,064.99	6.73%	694,145.03	7.35%	-
长江证券股份有限公司	1	514,781,857.25	4.23%	360,347.28	3.82%	-
中信证券股份有限公司	1	324,796,204.89	2.67%	227,357.34	2.41%	-
广发证券股份有限公司	1	269,980,802.53	2.22%	188,986.56	2.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	212,345,310.72	1.75%	148,641.70	1.57%	-
申银万国证券股份有限公司	1	33,868,407.20	0.28%	23,707.88	0.25%	-
招商证券股份有限公司	1	28,007,696.08	0.23%	19,605.39	0.21%	-

华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
江海证券有限 公司	1	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：山西证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中国国际金融有限公司	10,767,292.00	100.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 1 月 15 日
2	嘉实基金管理有限公司关于北京高华证券有限责任公司终止代理销售旗下部分开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 15 日
3	关于调整嘉实旗下部分开放式基金的日常转换费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 16 日
4	关于增加苏州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 17 日

5	关于增加和讯信息科技为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 28 日
6	关于新增嘉实优质企业股票基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 29 日
7	关于增加上海银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 5 日
8	关于增加温州龙湾农商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与温州龙湾农商银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 12 日
9	关于增加吉林银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 22 日
10	关于增加瑞丰银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与瑞丰银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 6 月 16 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

(1) 中国证监会《关于核准嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》；

(2) 《嘉实优质企业股票型证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实优质企业股票型证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实优质企业股票型证券投资基金招募说明书》；

(5) 《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；

(6) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(7) 报告期内嘉实优质企业股票型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司, 咨询电话 400-600-8800, 或发 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2014 年 8 月 25 日