

嘉实优质企业股票型证券投资基金 2014 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：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

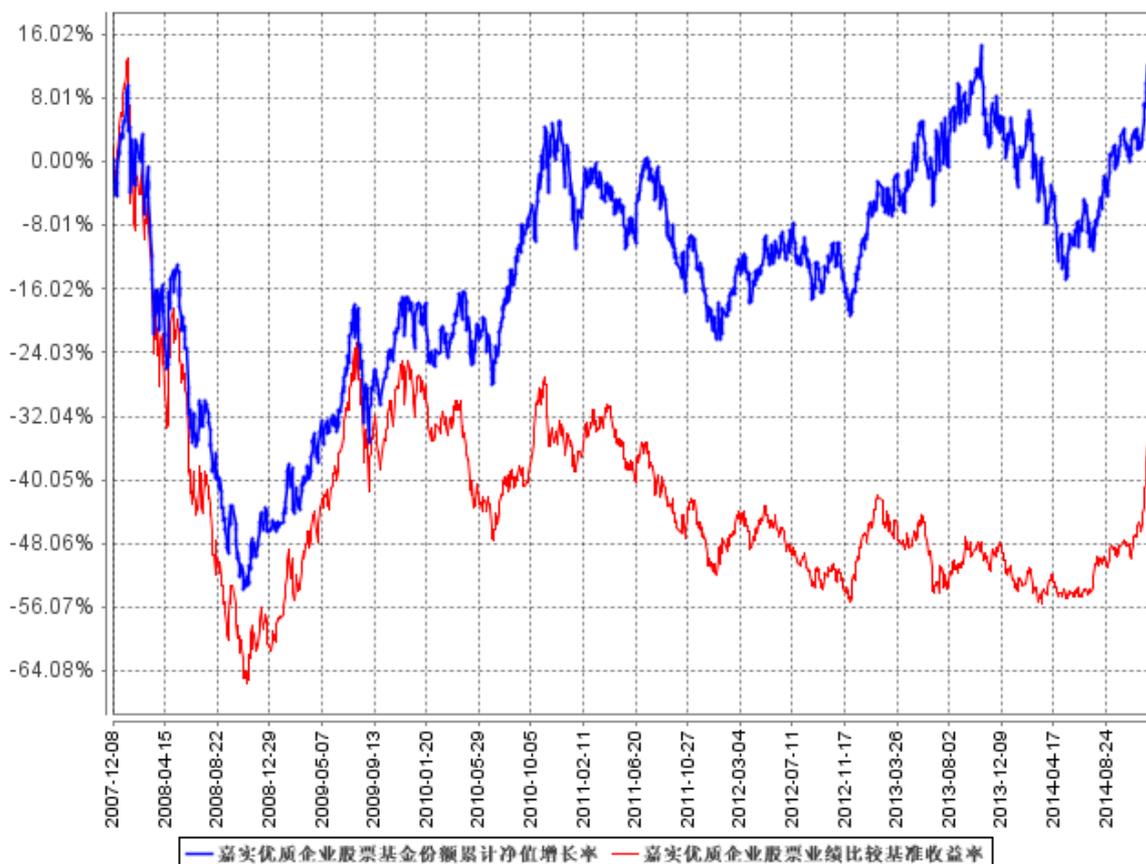
$$\text{Return}(t) = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{上证国债指数}(t) / \text{上证国债指数}(t-1) - 1)$$

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

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 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

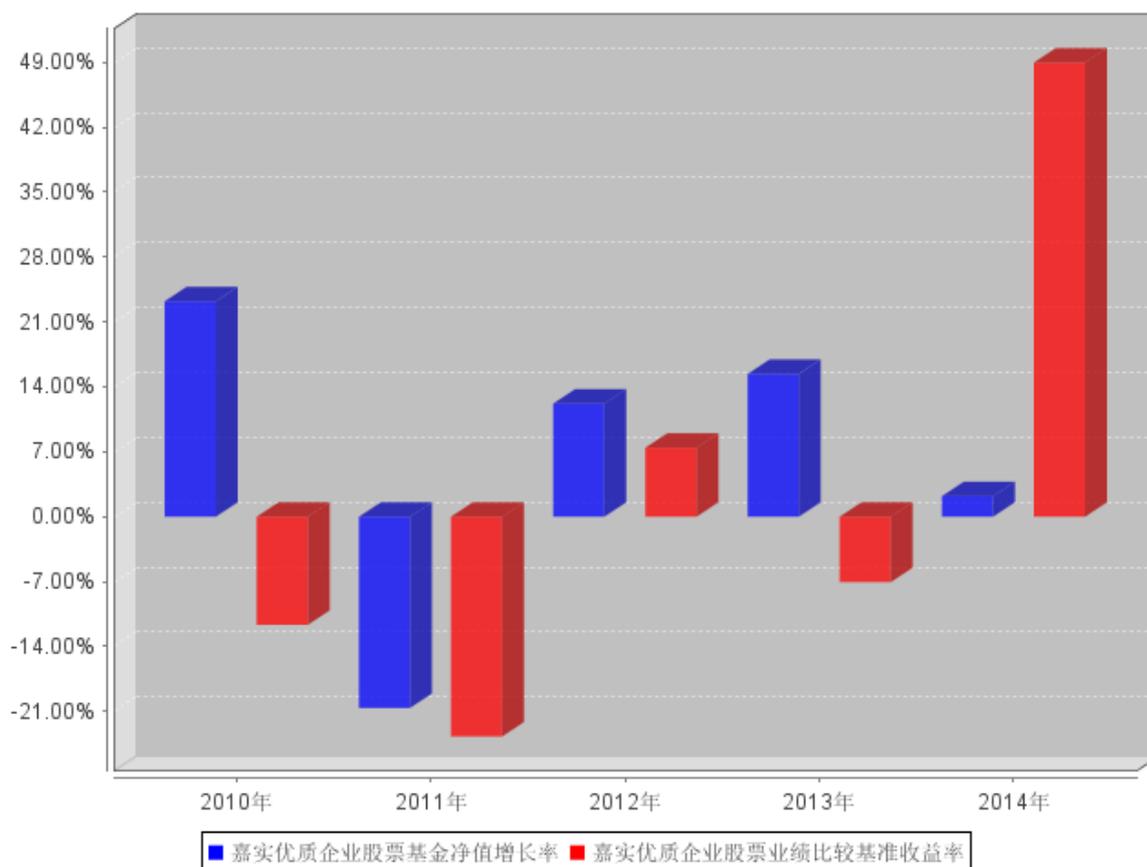
票公司本次发行股票的总量；(4)《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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

嘉实优质企业股票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图



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。

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	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	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
德意志资产管理（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（2014 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,803,889,999.42	91.88
	其中：股票	2,803,889,999.42	91.88
2	固定收益投资	80,039,000.00	2.62
	其中：债券	80,039,000.00	2.62
	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	142,428,863.49	4.67
7	其他各项资产	25,329,877.87	0.83
	合计	3,051,687,740.78	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	53,998,269.49	1.80
B	采矿业	50,467,862.76	1.68
C	制造业	1,416,236,510.27	47.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	65,811,948.06	2.19
F	批发和零售业	63,937,809.69	2.13
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	699,457,799.85	23.28
J	金融业	340,277,438.02	11.32
K	房地产业	63,516,477.52	2.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	50,185,883.76	1.67
S	综合	-	-
	合计	2,803,889,999.42	93.30

8.3 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	600570	恒生电子	2,940,583	161,026,325.08	5.36
2	002439	启明星辰	5,612,865	133,810,701.60	4.45
3	300017	网宿科技	2,382,299	114,826,811.80	3.82
4	002415	海康威视	5,030,482	112,531,882.34	3.74
5	300202	聚龙股份	3,288,362	101,577,502.18	3.38

6	002595	豪迈科技	3,749,082	92,977,233.60	3.09
7	002358	森源电气	2,373,899	83,086,465.00	2.76
8	300024	机器人	2,084,172	82,095,535.08	2.73
9	002065	东华软件	4,446,792	79,642,044.72	2.65
10	601555	东吴证券	3,501,309	78,499,347.78	2.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.jsfund.cn>) 的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600525	长园集团	221,721,328.00	4.22
2	002202	金风科技	202,942,632.91	3.87
3	002565	上海绿新	189,805,972.75	3.62
4	600517	置信电气	187,480,617.24	3.57
5	002358	森源电气	182,381,874.65	3.48
6	002065	东华软件	175,858,524.85	3.35
7	300020	银江股份	172,288,166.06	3.28
8	002219	恒康医疗	169,802,636.22	3.24
9	002551	尚荣医疗	164,963,692.26	3.14
10	300017	网宿科技	139,236,806.65	2.65
11	300212	易华录	125,811,452.12	2.40
12	300049	福瑞股份	122,349,110.43	2.33
13	300026	红日药业	121,552,067.79	2.32
14	601601	中国太保	118,978,490.91	2.27
15	300273	和佳股份	113,004,656.94	2.15
16	600703	三安光电	104,896,544.32	2.00
17	002415	海康威视	101,719,264.94	1.94
18	601318	中国平安	99,790,936.76	1.90
19	300070	碧水源	96,241,391.89	1.83
20	601933	永辉超市	94,853,461.25	1.81

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 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	002450	康得新	473,722,935.39	9.03
2	600518	康美药业	339,519,489.84	6.47
3	600887	伊利股份	321,017,456.57	6.12
4	300133	华策影视	279,117,462.13	5.32
5	600570	恒生电子	273,148,868.29	5.20
6	300104	乐视网	255,551,223.23	4.87
7	000651	格力电器	234,926,801.68	4.48
8	601633	长城汽车	226,722,310.73	4.32
9	000538	云南白药	210,509,872.04	4.01
10	002202	金风科技	200,982,108.97	3.83
11	300020	银江股份	171,664,634.88	3.27
12	600525	长园集团	171,247,040.78	3.26
13	600256	广汇能源	170,995,765.96	3.26
14	002241	歌尔声学	170,742,017.82	3.25
15	600535	天士力	167,369,309.70	3.19
16	600517	置信电气	156,044,760.84	2.97
17	002358	森源电气	153,015,017.85	2.92
18	002565	上海绿新	144,766,692.49	2.76
19	002551	尚荣医疗	141,620,363.85	2.70
20	600309	万华化学	136,685,093.92	2.60
21	601318	中国平安	136,331,025.53	2.60
22	600315	上海家化	126,795,773.44	2.42
23	002219	恒康医疗	126,481,394.68	2.41
24	300168	万达信息	120,221,105.34	2.29
25	300026	红日药业	118,488,300.67	2.26
26	300212	易华录	116,509,507.56	2.22
27	300273	和佳股份	113,889,769.19	2.17

8.4.3 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	8,470,313,405.14
卖出股票收入（成交）总额	10,580,640,272.91

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

8.5 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	80,039,000.00	2.66
	其中：政策性金融债	80,039,000.00	2.66
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	80,039,000.00	2.66

8.6 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	140213	14 国开 13	500,000	50,000,000.00	1.66
2	140320	14 进出 20	200,000	20,026,000.00	0.67
3	140436	14 农发 36	100,000	10,013,000.00	0.33

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,233,449.67
2	应收证券清算款	19,405,653.77
3	应收股利	-
4	应收利息	2,218,404.83
5	应收申购款	1,472,369.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	25,329,877.87

8.12.4 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。

8.12.5 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	002439	启明星辰	133,810,701.60	4.45	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
119,656	23,802.14	166,415,396.14	5.84%	2,681,653,411.22	94.16%

9.2 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	159,137.37	0.01%

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 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	569,718,764.92
减：本报告期基金总赎回份额	2,764,403,059.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,848,068,807.36

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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，与邵健先生共同担任本基金基金经理；

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，与现任基金经理刘辉先生共同管理本基金。

2014 年 10 月 10 日本基金管理人发布公告，聘请邵健先生、李松林先生担任公司副总经理职务。

2014 年 12 月 10 日本基金管理人发布公告，安奎先生因任期届满不再担任公司董事长，邓红国先生任公司董事长。

(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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 8 年提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中国银河证券股份有限公司	29,710,665,956.26	50.97%	7,603,230.58	53.31%	-	
中国国际金融有限公司	13,283,953,522.11	17.24%	2,298,767.41	16.12%	-	
长江证券股份有限公司	11,822,715,550.76	9.57%	1,275,900.86	8.95%	-	
招商证券股份有限公司	21,300,476,274.19	6.83%	910,336.21	6.38%	新增 1 个	
广州证券股份有限公司	1 819,183,064.99	4.30%	694,145.03	4.87%	-	
广发证券股份有限公司	1 749,064,480.22	3.93%	524,345.14	3.68%	-	
中信证券股份有限公司	1 662,862,424.91	3.48%	464,003.69	3.25%	-	
申银万国证券股份有限公司	1 471,890,264.21	2.48%	330,323.16	2.32%	-	
国泰君安证券股份有限公司	1 230,142,140.40	1.21%	161,099.48	1.13%	-	
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。

11.7.2 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%

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
2015 年 3 月 31 日