

嘉实优质企业混合型证券投资基金 2018 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：2019 年 03 月 26 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 2019 年 3 月 22 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。

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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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	嘉实优质企业混合
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	1,538,987,878.92 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	胡波
	联系电话	(010)65215588	021-61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95528
传真		(010)65215588	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	2018 年	2017 年	2016 年
-------------	--------	--------	--------

指标			
本期已实现收益	31,504,022.22	260,951,681.41	-86,590,235.05
本期利润	-555,621,558.56	407,071,675.81	-503,069,054.01
加权平均基金份额 本期利润	-0.3804	0.2470	-0.2281
本期加权平均净值 利润率	-27.47%	16.54%	-15.66%
本期基金份额净值 增长率	-23.85%	17.73%	-16.35%
3.1.2 期末数据和 指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	217,758,413.51	844,716,254.36	637,233,466.00
期末可供分配基金 份额利润	0.1415	0.6215	0.3781
期末基金资产净值	1,754,134,153.81	2,201,463,549.21	2,319,595,047.97
期末基金份额净值	1.140	1.620	1.376
3.1.3 累计期末指 标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值 增长率	41.29%	85.55%	57.60%

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	-14.86%	2.11%	-11.76%	1.56%	-3.10%	0.55%
过去六个月	-23.08%	1.92%	-13.42%	1.42%	-9.66%	0.50%
过去一年	-23.85%	1.68%	-23.92%	1.27%	0.07%	0.41%
过去三年	-25.01%	1.53%	-17.85%	1.12%	-7.16%	0.41%
过去五年	35.72%	1.90%	29.73%	1.46%	5.99%	0.44%
自基金合同	41.29%	1.68%	-36.13%	1.65%	77.42%	0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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:

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

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

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

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

嘉实优质企业混合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

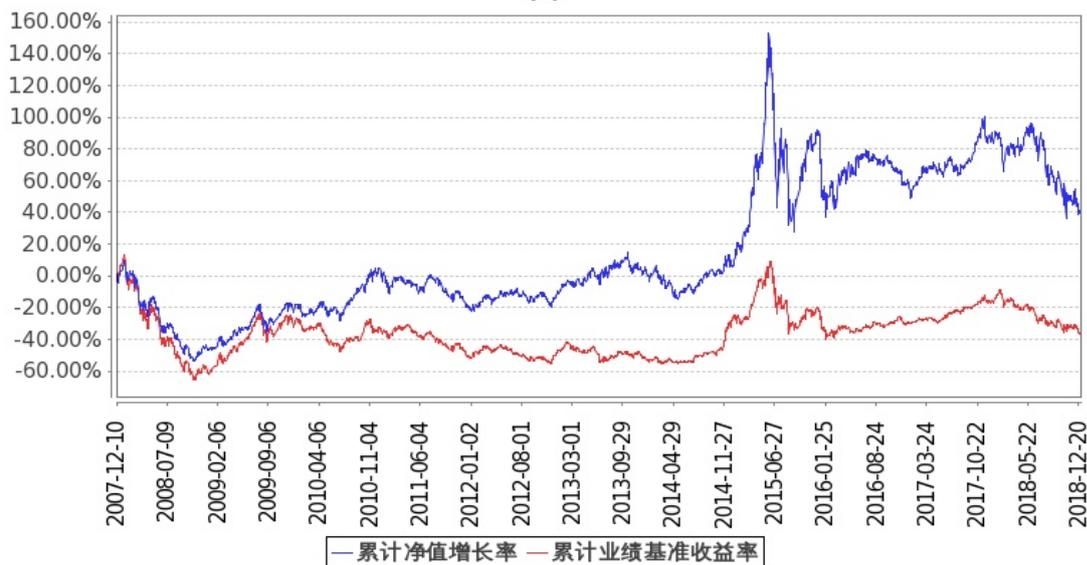


图: 嘉实优质企业混合基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007 年 12 月 8 日至 2018 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。

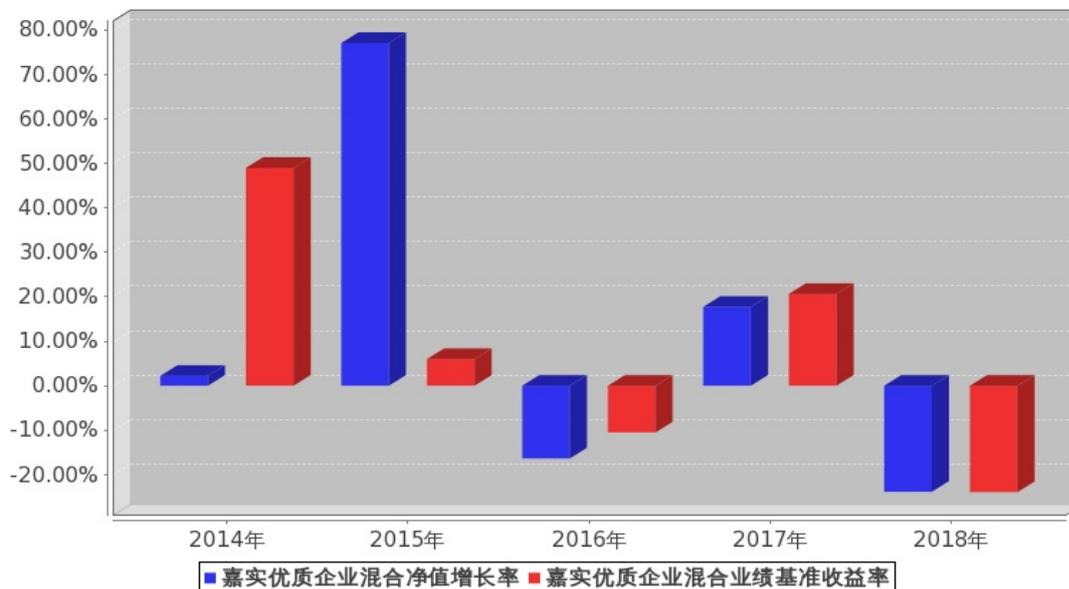
2: 按基金合同约定, 本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十八条 (二) 投资范围和 (八) 投资组合比例限制) 的规定:

(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上市公司发行的证券, 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。

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

嘉实优质企业混合基金每年净值增长率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：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
2018 年	1.2440	90,597,015.52	75,905,419.55	166,502,435.07	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	1.7040	223,067,669.07	135,672,740.80	358,740,409.87	-
合计	2.9480	313,664,684.59	211,578,160.35	525,242,844.94	-

§ 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、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、144 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、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) 混合、嘉实研究精选混合、

嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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 A/E、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、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、

嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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		
胡涛	本基金基金经理	2014年8月20日	-	16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，现任 GARP 策略组投资总监。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。

注：（1）任职日期、离职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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实优质企业混合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 12 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，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

2018 年度市场下跌较多，主要因为流动性在去杠杆背景下大幅收缩，表现为 M2，M1 同比增速大幅下降，主要宏观经济指标、汽车消费、房地产去化率以及投资增长均出现较大放缓，另外中美贸易战对市场产生了巨大影响，目前虽有好转，但还存在一定不确定性，海外经济也开始出现见顶回落，伴随美联储货币政策退出海外市场也开始出现较大调整，在这种全球宏观背景下，以及市场对国内明年宏观经济会出现更大压力的一致预期，市场调整较多。虽然上半年还存在医药，消费等行业的结构性投资机会，但下半年特别是三、四季度是泥沙俱下的局面，上半年的防御品种也出现了较大幅度的补跌，全市场能够有正收益的个股微乎其微。2018 年一些行业的政策调整也对市场产生了较大影响，如医药带量采购等。

本基金操作主要还是延续一贯的自下而上精选价值成长股风格，在市场弱势中不过度悲观，积极寻找被错杀的优质个股，主要基金资产仍然选择消费升级，创新驱动医药以及进口替代全球扩张的先进科技制造等行业作为长期配置方向。

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 1.140 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.85%，业绩比较基准收益率为-23.92%。

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 2019 年，我们认为宏观经济还是存在比较大的压力，投资，出口，消费增长都会继续放缓。但是政策面会有对冲政策出台，中央宏观经济工作会议已释放信号货币政策会微调，对经济的财政政策刺激力度会加大，会有更大规模的减税降费，我们预计在这种政策调整下，流动性会出现一定变化，从而经济也会在流动性好转带动下出现一定边际好转，预计会好于市场的过度悲观预期。

在这种宏观背景下，我们预计市场明年全年来看会存在一定的结构性投资机会，因为今年市场下跌反映了过度悲观预期，如果明年没有大家想象的那样差，则会出现反转机会。但从大的周期背景来看，全球处于经济下行阶段以及货币政策不能再有大规模释放空间，国内经济再从去杠杆到稳杠杆阶段应该是一个缓慢企稳的过程，预期市场大幅上涨的可能性也比较小。

另外我们预计明年在经济压力下通胀应该会下降较多，从而明年利率还有向下的空间，这对市场的反弹应该是有利因素。风险因素我们认为会是上游周期行业，会受到 PPI 下行的负面影响，下游消费反而因为成本下降会一定程度受益。配置上我们还是长期看好消费，医药，先进科技制造领域的具有核心竞争力的优质个股。

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、合规等部门负责人组成，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但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，

中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

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 2018 年 1 月 12 日发布《嘉实优质企业混合型证券投资基金 2017 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.2440 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 报告期内基金未实施利润分配。

(3) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-555,621,558.56 元，以及本基金基金合同（二十三（三）收益分配原则）约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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”）在对嘉实优质企业混合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，对嘉实优质企业混合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 166,502,435.07 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

嘉实优质企业混合型证券投资基金 2018 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、注册会计师王珊珊、贺耀签字出具了“无保留意见的审计报告”（安永华明（2019）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：嘉实优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	122,111,586.89	102,229,280.40
结算备付金		-	536,605.53
存出保证金		280,384.08	683,515.06
交易性金融资产	7.4.7.2	1,632,884,358.43	2,148,858,943.75
其中：股票投资		1,522,604,358.43	2,029,508,943.75
基金投资		-	-
债券投资		110,280,000.00	119,350,000.00
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		40,284.89	-
应收利息	7.4.7.5	2,652,719.78	1,710,281.27
应收股利		-	-
应收申购款		328,451.95	967,240.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,758,297,786.02	2,254,985,866.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		-	43,580,647.27
应付赎回款		554,804.59	5,009,550.09
应付管理人报酬		2,296,292.21	2,838,218.40
应付托管费		382,715.34	473,036.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	28,564.43	718,976.69
应交税费		5.88	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	901,249.76	901,888.66
负债合计		4,163,632.21	53,522,317.51
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,536,375,740.30	1,356,747,294.85
未分配利润	7.4.7.10	217,758,413.51	844,716,254.36
所有者权益合计		1,754,134,153.81	2,201,463,549.21
负债和所有者权益总计		1,758,297,786.02	2,254,985,866.72

注： 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.140 元，基金份额总额 1,538,987,878.92 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-516,119,967.11	455,306,810.56
1. 利息收入		5,169,866.79	2,865,276.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,150,952.10	2,481,550.84
债券利息收入		4,018,914.69	383,726.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		65,261,671.38	304,829,729.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	39,729,161.63	284,319,399.23

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	951,518.14	-
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	24,580,991.61	20,510,330.02
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.16	-587,125,580.78	146,119,994.40
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.17	574,075.50	1,491,810.04
减：二、费用		39,501,591.45	48,235,134.75
1. 管理人报酬		30,304,613.07	36,897,281.35
2. 托管费		5,050,768.78	6,149,546.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,716,086.83	4,749,987.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		2.09	-
7. 其他费用	7.4.7.19	430,120.68	438,319.17
三、利润总额(亏损总额以“- ”号填列)		-555,621,558.56	407,071,675.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)		-555,621,558.56	407,071,675.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	1,356,747,294.85	844,716,254.36	2,201,463,549.21
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	-555,621,558.56	-555,621,558.56
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变	179,628,445.45	95,166,152.78	274,794,598.23

动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	621,955,287.35	266,836,594.60	888,791,881.95
2. 基金赎回款	-442,326,841.90	-171,670,441.82	-613,997,283.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-166,502,435.07	-166,502,435.07
五、期末所有者权益(基金净值)	1,536,375,740.30	217,758,413.51	1,754,134,153.81
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	1,682,361,581.97	637,233,466.00	2,319,595,047.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	407,071,675.81	407,071,675.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-325,614,287.12	-199,588,887.45	-525,203,174.57
其中: 1. 基金申购款	730,880,255.44	347,092,647.06	1,077,972,902.50
2. 基金赎回款	-1,056,494,542.56	-546,681,534.51	-1,603,176,077.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,356,747,294.85	844,716,254.36	2,201,463,549.21

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:

经雷

基金管理人负责人

王红

主管会计工作负责人

张公允

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、会计估计与最近一期年度报告一致。

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（“浦发银行”）	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（2018年1月1日至2018年12月31日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	30,304,613.07	36,897,281.35
其中：支付销售机构的客户维护费	4,541,666.95	5,278,185.77

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 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至
----	-----------------------	-----------------------

	12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,050,768.78	6,149,546.92

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(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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自有资金投资本基金的情况

本报告期内(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日),基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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(2018年12月31日)及上年度末(2017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 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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_活期	122,111,586.89	1,105,389.60	102,229,280.40	2,443,618.03

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,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(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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(2018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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

601860	紫金银行	2018年 12月 20日	2019 年1月 3日	未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	网下申购
--------	------	---------------------	-------------------	-----	------	------	--------	-----------	-----------	------

注:以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上市公司公告为准。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2018年12月31日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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(2018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(2018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	1,522,604,358.43	86.60
	其中:股票	1,522,604,358.43	86.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,280,000.00	6.27
	其中:债券	110,280,000.00	6.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	122,111,586.89	6.94
8	其他各项资产	3,301,840.70	0.19
9	合计	1,758,297,786.02	100.00

8.2 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,245,688,281.61	71.01
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	98,872,473.42	5.64
G	交通运输、仓储和邮政业	84,790,011.60	4.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	93,203,446.00	5.31
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,522,604,358.43	86.80

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002311	海大集团	6,913,056	160,175,507.52	9.13
2	002507	涪陵榨菜	6,706,700	144,864,720.00	8.26
3	600298	安琪酵母	4,649,277	117,301,258.71	6.69
4	002415	海康威视	3,930,087	101,239,041.12	5.77
5	000963	华东医药	3,736,677	98,872,473.42	5.64
6	601888	中国国旅	1,548,230	93,203,446.00	5.31
7	600660	福耀玻璃	3,935,200	89,643,856.00	5.11
8	600519	贵州茅台	148,989	87,904,999.89	5.01
9	002179	中航光电	2,522,766	84,966,758.88	4.84
10	600009	上海机场	1,670,410	84,790,011.60	4.83

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	000858	五 粮 液	118,913,117.02	5.40
2	600276	恒瑞医药	111,324,249.98	5.06
3	600519	贵州茅台	107,976,872.44	4.90
4	000333	美的集团	107,416,473.75	4.88
5	601888	中国国旅	104,124,299.28	4.73
6	600036	招商银行	103,992,632.70	4.72
7	600566	济川药业	103,296,646.95	4.69
8	600009	上海机场	103,160,318.89	4.69
9	600809	山西汾酒	101,884,924.51	4.63
10	000002	万 科 A	96,883,432.52	4.40
11	002508	老板电器	94,096,190.83	4.27
12	603288	海天味业	63,141,924.69	2.87
13	002372	伟星新材	61,980,714.60	2.82
14	600660	福耀玻璃	61,560,788.63	2.80
15	601939	建设银行	50,163,336.41	2.28
16	600176	中国巨石	47,262,980.43	2.15
17	600887	伊利股份	29,129,009.58	1.32
18	300760	迈瑞医疗	312,661.60	0.01
19	002926	华西证券	282,324.24	0.01
20	300750	宁德时代	257,961.54	0.01

8.4.2 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	300296	利亚德	128,609,954.08	5.84
2	603111	康尼机电	119,327,405.64	5.42
3	002450	康得新	114,072,117.75	5.18
4	002572	索菲亚	95,414,628.94	4.33
5	600036	招商银行	89,929,706.46	4.08
6	002583	海能达	88,738,188.21	4.03
7	600176	中国巨石	83,523,441.50	3.79
8	000858	五 粮 液	79,473,968.79	3.61
9	002475	立讯精密	75,637,169.27	3.44
10	600887	伊利股份	71,971,942.29	3.27
11	000002	万 科 A	68,205,070.10	3.10
12	002508	老板电器	66,755,029.30	3.03
13	600885	宏发股份	63,753,698.48	2.90
14	600867	通化东宝	60,983,818.14	2.77
15	603868	飞科电器	57,533,945.51	2.61
16	002415	海康威视	40,967,743.01	1.86
17	601939	建设银行	38,782,123.76	1.76

18	002179	中航光电	25,910,722.19	1.18
19	002206	海利得	15,971,243.28	0.73
20	002311	海大集团	12,175,702.50	0.55

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	1,470,790,669.36
卖出股票收入（成交）总额	1,430,359,285.53

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	110,280,000.00	6.29
	其中：政策性金融债	110,280,000.00	6.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	110,280,000.00	6.29

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	180207	18 国开 07	900,000	90,216,000.00	5.14
2	180209	18 国开 09	200,000	20,064,000.00	1.14

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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	280,384.08
2	应收证券清算款	40,284.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,652,719.78
5	应收申购款	328,451.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,301,840.70

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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 (%)
70,469	21,839.22	326,480,978.98	21.21	1,212,506,899.94	78.79

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	843,731.69	0.05

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 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	320,378,337.00
本报告期期初基金份额总额	1,359,069,297.91
本报告期基金总申购份额	622,989,886.85
减：本报告期基金总赎回份额	443,071,305.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,538,987,878.92

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，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**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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**

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

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 11 年为本基金提供审计服务。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	1	1,588,390,368.91	54.84%	1,111,873.23	54.83%	-
招商证券股份有限公司	2	1,267,582,318.24	43.76%	887,316.07	43.76%	-
华泰证券股份有限公司	1	40,694,511.59	1.40%	28,486.37	1.40%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

江海证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券 股份有限 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。

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。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
华泰证券 股份有限 公司	4,540,942.48	100.00%	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2019年2月2日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年2月2日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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

2019年03月26日