



嘉实优质企业股票型证券投资基金 2010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
报告送出日期:2011年3月28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。

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2011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,保证投资报告真实、准确。

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。

本报告自2010年10月1日起至2010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。

2.1 基金基本情况
基金名称:嘉实优质企业股票
基金代码:070009

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年12月28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
基金合同生效日:2007年12月28日
基金管理人:嘉实基金管理有限公司

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

2.3 基金管理人和本基金托管人
名称: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

2.4 信息披露方式
基金年度报告原文的查询网站: http://www.jsfund.cn

§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

Table with 4 columns: 2010年, 2009年, 2008年, 2007年. Rows include 1.1.1 期间业绩指标, 1.1.2 本期实现收益, 1.1.3 本期利润, etc.

注:Q 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。

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

Table with 4 columns: 期间, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ①-③. Rows include 过去三个月, 过去六个月, etc.

注:本基金业绩比较基准为沪深300 指数*95%+上证国债指数*5%。本基金的业绩比较基准按照构建方式每日进行计算,计算公式如下:

Benchmark = 0.95x 沪深300指数 + 0.05x 上证国债指数

Return = 95% x (沪深300指数 t / 沪深300指数 t-1) - 1 + 5% x (上证国债指数 t / 上证国债指数 t-1) - 1

Benchmark = 0 + Return x Benchmark t-1

其中 t=1, 2, 3, ...

注:自基金合同生效以来基金基金份额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

注:1.本基金由嘉实沪深保混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日起,本基金基金合同生效,嘉实沪深保基金合同失效。

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)投资范围中(四)投资组合比例限制的规定;

注:3.本基金合同生效以来,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

注:4.本基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,对嘉实优质企业股票型证券投资基金的投资进行了监督,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,该基金本报告期内无进行利润分配。

注:5.托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

注:6.本基金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、财务会计报告(注:财务会计报告中的“公允价值”和“公允价值变动”部分未在托管人复核范围内),投资报告等内容真实、准确、完整。

注:7.本基金由嘉实沪深保混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日起,本基金基金合同生效,嘉实沪深保基金合同失效。

注:8.按基金合同约定,本基金自基金合同生效起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)投资范围中(四)投资组合比例限制的规定;

注:9.本基金合同生效以来,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

注:10.本基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,对嘉实优质企业股票型证券投资基金的投资进行了监督,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,该基金本报告期内无进行利润分配。

注:11.托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

注:12.本基金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、财务会计报告(注:财务会计报告中的“公允价值”和“公允价值变动”部分未在托管人复核范围内),投资报告等内容真实、准确、完整。

注:13.本基金由嘉实沪深保混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日起,本基金基金合同生效,嘉实沪深保基金合同失效。

注:14.按基金合同约定,本基金自基金合同生效起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)投资范围中(四)投资组合比例限制的规定;

注:15.本基金合同生效以来,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

注:16.本基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议的约定,对嘉实优质企业股票型证券投资基金的投资进行了监督,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,该基金本报告期内无进行利润分配。

注:17.托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

注:18.本基金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、财务会计报告(注:财务会计报告中的“公允价值”和“公允价值变动”部分未在托管人复核范围内),投资报告等内容真实、准确、完整。

注:19.本基金由嘉实沪深保混合型开放式证券投资基金转型而成,自2007年12月8日起,本基金基金合同生效,嘉实沪深保基金合同失效。

4.2.3 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内中国经济保持较高增速,但在高房价和通胀压力下政府逐步开始实施宏观调控,宽松货币政策逐步退出。

4.5 报告期内基金投资组合的表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2011年,中国经济将面临阶段性过热和高通胀并存的局面,因此宏观调控压力将持续存在。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.9 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.10 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.11 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.12 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.13 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.14 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.15 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.16 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.17 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.18 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.19 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.20 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.21 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.22 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.23 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.24 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.25 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.26 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.27 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.28 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.29 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.30 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.31 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.32 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.33 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.34 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.35 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.36 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.37 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.38 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.39 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.40 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.41 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.42 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.43 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.44 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.45 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

4.46 报告期内基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.013元;本报告期基金份额净值增长率为23.24%,业绩比较基准收益率为-11.66%。

4.47 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
Q 报告期内本基金未实施利润分配。

赵宇军 李松林 王虹
基金托管人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报告附注
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保持一致

7.4.2 差错更正的说明
7.4.3 关联方关系

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Rows include 嘉实基金管理有限公司, 上海浦东发展银行股份有限公司, etc.

注:下述关联方交易均在正常业务范围并按一般商业条件订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.2 关联方报酬
7.4.4.2.1 基金管理费

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付给托管机构的客户服务费, etc.

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。

7.4.4.2.2 基金托管费
注:支付基金管理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。

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
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
7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

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

Table with 3 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 上海浦东发展银行, etc.

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 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
7.4.4.7 报告期内,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(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发增发行证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票

Table with 10 columns: 证券代码, 证券名称, 流通受限日期, 可流通日期, 流通受限类型, 认购价格, 期末持仓数量(单位:股), 期末持仓金额, 期末持仓市值, 备注.

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券
报告期末(2010年12月31日),本基金未持有流通受限的债券。

7.4.5.1.3 受限证券类别:其他
报告期末(2010年12月31日),本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
7.4.5.3 期末债券正回购交易作为质押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
报告期末(2010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
报告期末(2010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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 权益投资, 其中:股票, 其中:沪市, etc.

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值. Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, etc.

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Rows include 1 000858 五粮液, 2 000243 天阿国际, etc.

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 累计买入金额超出期初基金资产净值2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%).

注:买入股票成本(成交金额)包括买入佣金和卖出股票的收入(成交金额)扣除卖出佣金后的净额。

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%).

注:卖出股票成本(成交金额)包括卖出佣金和买入股票的收入(成交金额)扣除买入佣金后的净额。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值. Rows include 1 000858 五粮液, 2 000243 天阿国际, etc.

注:买入债券成本(成交金额)包括买入佣金和卖出债券的收入(成交金额)扣除卖出佣金后的净额。

8.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.7 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.8 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.11 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%).

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交金额), 卖出股票收入(成交金额).

注:8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

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

Table with 5 columns: 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(%).

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

Table with 5 columns: 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(%).

8.8 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.9 投资组合报告附注
8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发生被监管部门立案调查,在本报告编制前一年

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

8.9.3 期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明.

§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

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户内持有的基金份额, 机构投资者持有户数, 个人投资者持有户数.

9.2 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: 基金管理人持有本基金基金份额, 占基金份额比例.

§10 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金份额变动, 基金份额.

注:报告期期间基金总申购份额含转换转入份额,基金总赎回份额含转换转出份额。

§11 重大事件提示
11.1 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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金业务活动的诉讼

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

11.6 管理人、托管人及其他高级管理人员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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例.

注:1.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给该券商的佣金合计。

注:2.交易单元的选择标准和程序

注:3.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。基金管理人将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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例.

注:1.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给该券商的佣金合计。

注:2.交易单元的选择标准和程序

注:3.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。基金管理人将与被选择的券商签订协议,并通知基金托管人。

11.7.3 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例.

注:1.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给该券商的佣金合计。

注:2.交易单元的选择标准和程序

注:3.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。基金管理人将与被选择的券商签订协议,并通知基金托管人。