

嘉实优质企业股票型证券投资基金

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:2012年3月30日

8.1 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2012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。

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,基金管理人不对基金资产的增值或亏损作出任何保证。

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。

8.2 基金简介
基金名称:嘉实优质企业股票证券投资基金
基金代码:070099

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金存续期限.

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:在具备充分、超额收益预期的前提下,综合考虑股票类资产配置,剩余资产配置于债券和现金类等大类资产。

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 基金管理人及基金托管人
项目:基金管理人, 基金托管人
名称:嘉实基金管理有限公司, 上海浦东发展银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文的网址: http://www.jsfund.cn

8.3 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
单位:人民币元

Table with 2 columns: 会计期间和指标, 2011年, 2010年, 2009年

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 2 columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数*95% + 上证国债指数*5%

3.2.3 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

图:嘉实优质企业股票基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金由嘉实沪深300增强型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,嘉实沪深300增强型证券投资基金合同失效。

3.2.3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实沪深300增强型证券投资基金业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基金合同生效日为2007年12月8日,2007年度的相关数据根据当年实际存续期间(2007年12月8日至2007年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

4.1 基金管理人及基金经理简介

4.1.1 基金管理人及其基金经理简介

4.1.2 基金经理简介

4.1.3 基金经理的任免程序

4.1.4 基金经理的承诺

4.1.5 基金经理的声明

4.1.6 基金经理的承诺

4.1.7 基金经理的承诺

4.1.8 基金经理的承诺

4.1.9 基金经理的承诺

4.1.10 基金经理的承诺

4.1.11 基金经理的承诺

4.1.12 基金经理的承诺

4.1.13 基金经理的承诺

4.1.14 基金经理的承诺

4.1.15 基金经理的承诺

4.1.16 基金经理的承诺

4.1.17 基金经理的承诺

4.1.18 基金经理的承诺

4.1.19 基金经理的承诺

4.1.20 基金经理的承诺

4.1.21 基金经理的承诺

4.1.22 基金经理的承诺

4.1.23 基金经理的承诺

4.1.24 基金经理的承诺

4.1.25 基金经理的承诺

4.1.26 基金经理的承诺

4.1.27 基金经理的承诺

4.1.28 基金经理的承诺

4.1.29 基金经理的承诺

4.1.30 基金经理的承诺

4.1.31 基金经理的承诺

4.1.32 基金经理的承诺

4.1.33 基金经理的承诺

4.1.34 基金经理的承诺

4.1.35 基金经理的承诺

4.1.36 基金经理的承诺

4.1.37 基金经理的承诺

4.1.38 基金经理的承诺

4.1.39 基金经理的承诺

4.1.40 基金经理的承诺

4.1.41 基金经理的承诺

4.1.42 基金经理的承诺

4.1.43 基金经理的承诺

4.1.44 基金经理的承诺

4.1.45 基金经理的承诺

4.1.46 基金经理的承诺

4.1.47 基金经理的承诺

4.1.48 基金经理的承诺

4.1.49 基金经理的承诺

4.1.50 基金经理的承诺

4.1.51 基金经理的承诺

4.1.52 基金经理的承诺

4.1.53 基金经理的承诺

4.1.54 基金经理的承诺

4.1.55 基金经理的承诺

4.1.56 基金经理的承诺

2011年度 报告摘要

一、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) - 1,101,106,148.65

二、本期公允价值变动损益(公允价值变动) 460,545,112.23

三、本期投资收益(含公允价值变动) 2,850,666,574.19

四、本期公允价值变动损益(公允价值变动) -2,900,121,461.96

五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

二十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

三十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

四十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

五十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

六十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

七十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十一、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十二、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十三、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十四、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十五、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十六、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十七、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十八、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

八十九、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

九十、本期其他综合收益 6,177,614,055.03

8.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

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

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, 卖出股票收入

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价款乘以成交数量、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

Table with 4 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名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

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券名称, 数量(元), 公允价值

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.4 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.5 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.6 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.7 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.8 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.9 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.10 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.11 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.12 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.13 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.14 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.15 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.16 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.17 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.18 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.19 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.20 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.21 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.22 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.23 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.24 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.25 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.26 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.27 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.28 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.29 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.30 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.31 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.32 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.33 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.34 声明本基金投资的前十名证券中,是否存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。