# 嘉实优质企业股票型证券投资基金

## 2012 年度 报告摘要

2012年12月31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:2013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。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2013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2012年1月1日起至2012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 | 9,688,307,053.30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 | 周倩芝 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | (021)61618888 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | zhouqz@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<br>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 | 2012年 | 2011年 | 2010年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -502,620,775.27 | 70,601,233.79 | 535,748,218.09 |
| 本期利润 | 884,203,452.84 | -1,641,544,507.91 | 1,101,106,148.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0967 | -0.2271 | 0.1945 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.21% | -24.57% | 22.78% |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.19% | -20.63% | 23.24% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配利润 | -1,139,927,478.89 | -1,699,192,975.04 | -494,918,655.19 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1177 | -0.1946 | -0.0800 |
| 期末基金资产净值 | 8,736,800,608.49 | 7,019,583,435.53 | 6,269,327,183.24 |
| 期末基金份额净值 | 0.902 | 0.804 | 1.013 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -9.80% | -19.60% | 1.30% |

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 | 3.92% | 1.00% | 9.56% | 1.22% | -5.64% | -0.22% |
| 过去六个月 | 1.12% | 1.06% | 2.49% | 1.18% | -1.37% | -0.12% |
| 过去一年 | 12.19% | 1.08% | 7.44% | 1.22% | 4.75% | -0.14% |
| 过去三年 | 9.73% | 1.19% | -27.58% | 1.32% | 37.31% | -0.13% |
| 过去五年 | -12.34% | 1.51% | -49.86% | 1.88% | 37.52% | -0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.80% | 1.51% | -47.03% | 1.88% | 37.23% | -0.37% |

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%×(沪深300指数 (t)/沪深300指数(t-1)-1)+5%×(上证国债指数(t)/上证国债指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,…。

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

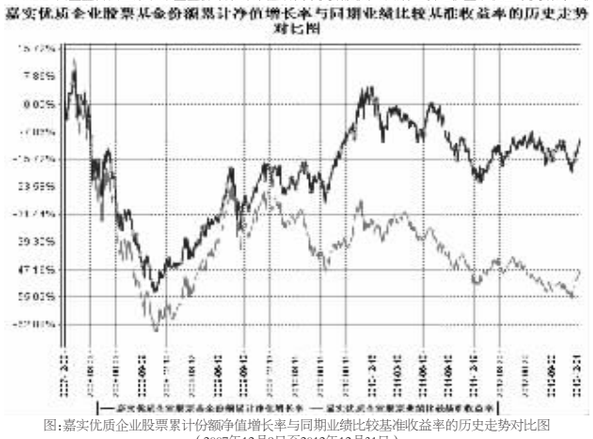


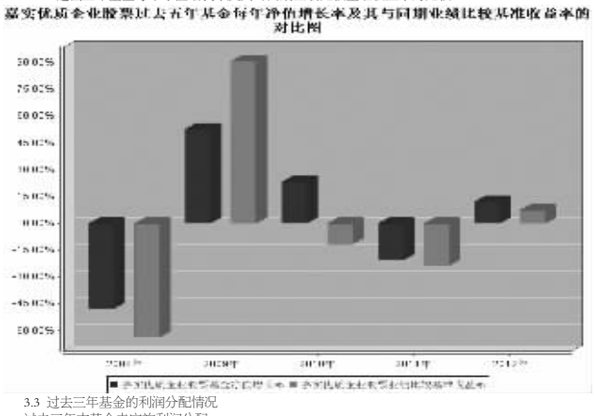
图:嘉实优质企业股票累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年12月8日至2012年12月31日)

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

过去三年本基金未实施利润分配。

### §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2012年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、37只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘天君 | 本基金基金经理,嘉实成长收益混合基金经理,公司股票投资部总监 | 2007年12月8日 | - | 11年 | 曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副总监、嘉实泰和封闭、嘉实成长收益混合基金经理。北京大学光华管理学院经济学硕士,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 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。

4.3.1 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,每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

公司采用基金业通用的公平交易模块,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,统计数据显示,正、负溢价次数和零溢价次数符合随机分布的特征,平均溢价率趋近于0。

报告期内,公司旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

2012年中国宏观经济增速有所放缓,同时通胀压力有所缓解。A股市场在年初表现较好,但两会之后随着经济增速下降超预期,以及理财产品、信托产品等大量发行导致"无风险利率"高企,同时中小企业融资成本维持高位运行,导致股票市场资金出现持续外流,市场持续下行。进入四季度后期,国内经济初步显示出触底迹象,美国经济持续数个季度复苏、欧债问题告一段落,加上十八大之后领导层提出一些改革举措,资本市场信心得以提振,以银行为代表的周期行业股票估值得以快速修复。

本基金在年初制定的优选行业内优质龙头企业的投资策略获得了比较好的收益,本基金在家电、汽车、电子、医药等行业内集中持有竞争力强、业绩持续超预期的优质企业股票,获得了业绩超预期和相对估值提升的双重回报,取得了较好的超额收益。年底周期类股票估值快速修复,同时白酒行业配置比例过高,对本基金四季度业绩有一定负面影响,但全年而言仍取得了较高的超额收益。

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0.902元;本报告期基金份额净值增长率为12.19%,业绩比较基准收益率为7.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,中国经济有望维持企稳回升的态势,主要拉动力仍将来自于政府主导的相关投资,短期内难以看到新的经济增长点,经济转型进展缓慢。美元仍将呈现弱势特征,从而助推全球流动性泛滥和资产价格上升,国内外CPI和PPI可能于年内明显反弹。

展望全年,A股市场有望延续去年年底的强势表现, 尤其要关注影子银行的演变和社会资金成本的变化,国内外资金有望同时对市场形成正面因素。同时,地产价格反弹和物价上升也可能引致紧缩政策,对市场形成阶段性冲击。

本基金将适当提升股票仓位,行业配置适度均衡,重点投资于兼具估值优势和成长空间的优质企业,同时积极投资于景气度较高的细分行业。展望全年,本基金仍将以医药、食品饮料、汽车、家电等大消费行业为核心资产,适度配置金融地产、中游制造业等传统周期性行业,力争继续取得较好收益。

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、法律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历。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)报告期内本基金未实施利润分配;

(2)根据本报告3.1.1"本期利润"为884,203,452.84元、3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为-0.1177元、3.1.2"期末基金份额净值"为0.902元,以及本基金基金合同(二十三(三)收益分配原则)"2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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2012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(2013)审字第60468756_A02号)。

### §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:2012年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 189,792,334.91 | 108,791,401.80 |
| 结算备付金 | | 27,741,975.71 | 43,417,234.17 |
| 存出保证金 | | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 7,993,600,996.17 | 6,540,922,438.82 |
| 其中:股票投资 | | 7,320,566,153.57 | 5,758,416,810.02 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 673,034,842.60 | 782,505,628.80 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 660,000,000.00 | 299,550,769.33 |
| 应收证券清算款 | | - | 37,281,156.55 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 3,931,343.83 | 6,887,505.92 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 32,584,928.06 | 975,682.09 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 8,908,651,578.68 | 7,038,826,188.68 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011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 | | 138,430,464.11 | 2,749,530.33 |
| 应付赎回款 | | 16,726,332.11 | 2,024,267.53 |
| 应付管理人报酬 | | 10,314,213.95 | 9,063,473.28 |
| 应付托管费 | | 1,719,035.66 | 1,510,578.88 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 3,314,942.44 | 2,790,086.80 |
| 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 | 1,345,981.92 | 1,104,816.33 |
| 负债合计 | | 171,850,970.19 | 19,242,753.15 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 9,673,094,832.47 | 8,718,776,410.57 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -936,294,223.98 | -1,699,192,975.04 |
| 所有者权益合计 | | 8,736,800,608.49 | 7,019,583,435.53 |
| 负债和所有者权益总计 | | 8,908,651,578.68 | 7,038,826,188.68 |

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.902元,基金份额总额9,688,307,053.30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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 1,045,177,553.12 | -1,501,805,827.15 |
| 1.利息收入 | | 32,133,221.19 | 24,080,730.01 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 6,591,531.62 | 6,481,113.74 |
| 债券利息收入 | | 17,405,402.42 | 14,840,314.66 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 8,136,287.15 | 2,759,301.61 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 | | -374,996,589.94 | 183,902,744.21 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | -488,052,391.23 | 164,892,774.95 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 1,222,884.40 | -24,456,557.31 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 111,832,916.89 | 43,466,526.57 |
| 3.公允价值变动收益 | 7.4.7.16 | 1,386,824,228.11 | -1,712,145,741.70 |
| 4.汇兑收益 | | - | - |
| 5.其他收入 | 7.4.7.17 | 1,216,693.76 | 2,356,440.33 |
| 减:二、费用 | | 160,974,100.28 | 139,738,680.76 |
| 1. 管理人报酬 | | 118,047,798.67 | 100,004,989.45 |
| 2. 托管费 | | 19,674,633.00 | 16,667,498.32 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 22,809,438.49 | 21,783,997.48 |
| 5. 利息支出 | | - | 821,617.34 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | 821,617.34 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 442,230.12 | 460,578.17 |
| 三、利润总额 | | 884,203,452.84 | -1,641,544,507.91 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 | | 884,203,452.84 | -1,641,544,507.91 |

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012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) | 8,718,776,410.57 | -1,699,192,975.04 | 7,019,583,435.53 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 884,203,452.84 | 884,203,452.84 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 954,318,421.90 | -121,304,701.78 | 833,013,720.12 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,615,425,561.73 | -348,262,369.50 | 2,267,163,192.23 |
| 2.基金赎回款 | -1,661,107,139.83 | 226,957,667.72 | -1,434,149,472.11 |
| 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) | 9,673,094,832.47 | -936,294,223.98 | 8,736,800,608.49 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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) | 6,177,614,055.03 | 91,713,128.21 | 6,269,327,183.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,641,544,507.91 | -1,641,544,507.91 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 2,541,162,355.54 | -149,361,595.34 | 2,391,800,760.20 |
| 其中:1.基金申购款 | 5,162,035,874.24 | -291,667,958.25 | 4,870,367,915.99 |
| 2.基金赎回款 | -2,620,873,518.70 | 142,306,362.91 | -2,478,567,155.79 |
| 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) | 8,718,776,410.57 | -1,699,192,975.04 | 7,019,583,435.53 |

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 |
|---|---|---|
| 基金管理公司负责人 | 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 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。

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(2012年1月1日至2012年12月31日)及上年度可比期间(2011年1月1日至2011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 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 118,047,798.67 | 100,004,989.45 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 15,440,544.06 | 17,397,116.58 |

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 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,674,633.00 | 16,667,498.32 |

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

单位:人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | - | - | 98,000,000.00 | 133,979.58 | - | - |

注:本报告期(2012年1月1日至2012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(2012年1月1日至2012年12月31日)及上年度可比期间(2011年1月1日至2011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(2012年12月31日)及上年度末(2011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 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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 | 189,792,334.91 | 6,086,143.19 | 108,791,401.80 | 6,209,653.44 |

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(2012年1月1日至2012年12月31日)及上年度可比期间(2011年1月1日至2011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( 2012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(2012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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000527 | 美的电器 | 2012年8月27日 | 重大资产重组停牌 | 9.69 | 未知 | 未知 | 7,466,795 | 104,340,597.06 | 72,353,243.55 | - |

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(2012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(2012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 | 7,320,566,153.57 | 82.17 |
| | 其中:股票 | 7,320,566,153.57 | 82.17 |
| 2 | 固定收益投资 | 673,034,842.60 | 7.55 |
| | 其中:债券 | 673,034,842.60 | 7.55 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 660,000,000.00 | 7.41 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 217,534,310.62 | 2.44 |
| 6 | 其他各项资产 | 37,516,271.89 | 0.42 |
| | 合计 | 8,908,651,578.68 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 258,521,456.10 | 2.96 |
| C | 制造业 | 5,961,673,424.17 | 68.24 |
| C0 | 食品、饮料 | 1,474,770,193.98 | 16.88 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 215,860,426.06 | 2.47 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 72,404,454.70 | 0.83 |
| C5 | 电子 | 902,799,685.65 | 10.33 |
| C6 | 金属、非金属 | 214,390,289.50 | 2.45 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,998,992,164.92 | 22.88 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,082,456,209.36 | 12.39 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 173,198,390.30 | 1.98 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 15,900,000.00 | 0.18 |
| H | 批发和零售贸易 | 47,920,000.00 | 0.55 |
| I | 金融、保险业 | 484,790,970.00 | 5.55 |
| J | 房地产业 | 283,522,525.00 | 3.25 |
| K | 社会服务业 | 45,000,000.00 | 0.52 |
| L | 传播与文化产业 | 50,039,388.00 | 0.57 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 7,320,566,153.57 | 83.79 |

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 | 000651 | 格力电器 | 30,000,000 | 765,000,000.00 | 8.76 |
| 2 | 002241 | 歌尔声学 | 12,993,661 | 489,861,019.70 | 5.61 |
| 3 | 000568 | 泸州老窖 | 12,000,000 | 424,800,000.00 | 4.86 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 17,875,917 | 423,659,232.90 | 4.85 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 2,000,000 | 418,040,000.00 | 4.78 |
| 6 | 000538 | 云南白药 | 6,032,433 | 410,205,444.00 | 4.70 |
| 7 | 000423 | 东阿阿胶 | 8,659,331 | 349,923,565.71 | 4.01 |
| 8 | 002236 | 大华股份 | 6,633,063 | 307,442,470.05 | 3.52 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 20,000,000 | 272,000,000.00 | 3.11 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 12,031,401 | 264,450,193.98 | 3.03 |

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

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 | 000568 | 泸州老窖 | 527,027,995.26 | 7.51 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 438,784,089.00 | 6.25 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 428,697,590.18 | 6.11 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 349,774,422.90 | 4.98 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 269,970,093.41 | 3.85 |
| 6 | 601633 | 长城汽车 | 267,163,425.66 | 3.81 |
| 7 | 600518 | 康美药业 | 264,472,211.72 | 3.77 |
| 8 | 600199 | 金种子酒 | 260,063,365.65 | 3.70 |
| 9 | 000527 | 美的电器 | 254,177,835.16 | 3.62 |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 249,452,322.14 | 3.55 |
| 11 | 000538 | 云南白药 | 227,027,422.49 | 3.23 |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 212,196,048.29 | 3.02 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 209,335,984.32 | 2.98 |
| 14 | 000157 | 中联重科 | 201,846,940.14 | 2.88 |
| 15 | 002304 | 洋河股份 | 201,556,770.37 | 2.87 |
| 16 | 000970 | 中科三环 | 198,111,330.31 | 2.82 |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 185,667,639.65 | 2.64 |
| 18 | 002236 | 大华股份 | 175,661,520.16 | 2.50 |
| 19 | 002223 | 鱼跃医疗 | 165,204,501.72 | 2.35 |
| 20 | 000423 | 东阿阿胶 | 164,017,901.98 | 2.34 |
| 21 | 600