### 基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司 送出日期:2014年3月26日

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、外国银行股份有限公司根据本基金合同规定、于2014年3月20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。

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 明节及其更新。 本报告期自2013年1月1日起至2013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	S 2 基金简介
基金名称	嘉实优化红利股票型证券投资基金
基金简称	嘉实优化红利股票
基金主代码	070032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份額总額	52,990,590.62(/)
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票,通过严格执行投资风险管理固 (化和罗斯基金的风格特征,追求稳定的股息收入和长期的资本增值,同时,以 债券和短期金配工具作为降低进合风险的策略性投资工具,通过适当的资产 配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,本基金属于较高风险,较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
	姓名	胡勇钦	唐州徽
信息披露负责人	联系电话	010 )65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		010 )65182266	010)66594942
2.4 信自地震主	试		

北京市建国厂北大街8号年间大 多 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

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年6月26日(基金合同生效日)-2012 年12月31日
本期已实现收益	2,493,725.76	933,377.13
本期利润	2,303,597.35	2,256,307.60
加权平均基金份額本期利润	0.0452	0.0089
本期加权平均净值利润率	4.43%	0.90%
本期基金份额净值增长率	-1.18%	1.70%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	117,090.61	-1,200,548.09
期末可供分配基金份額利润	0.0022	-0.0087
期末基金资产净值	53,242,194.48	140,885,164.46
期末基金份额净值	1.005	1.017
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
基金份額累计净值增长率	0.50%	1.70%

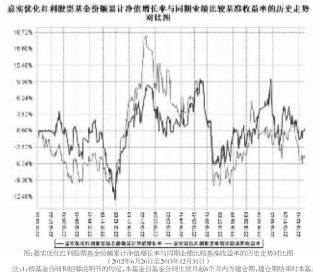
后的余额,本期升润为本期已实现收益自基金车期利息取入,投资收益,其他収入(不含公允价值变动收益)和除相关资用后的余额,本期升润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;(3)期末可供分配利润实用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.1 基立仿领中国指长羊及共一问州业坝LFX基件以置竿的LFX						
阶段	份额争值增长 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	-3.55%	1.27%	-3.76%	1.04%	0.21%	0.23%
过去六个月	7.26%	1.19%	4.05%	1.28%	3.21%	-0.09%
过去一年	-1.18%	1.22%	-9.43%	1.41%	8.25%	-0.19%
自基金合同生效 起至今	0.50%	1.16%	-4.40%	1.32%	4.90%	-0.16%
7 7 4 7 1	A サイト・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・イナ・	ようてんご子は出る場	della Marketti como e	. I Section Advantage Auto-	Hade de	

注:本基金业绩比较基准为:中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。 中证红利指数挑选在上海证券交易所和原则证券交易所上市的现金股息率高,分红比较稳定,具有一定规 模及流动性的10只股票作分样本,指数加定方式同产深的相数,以反映战市场高红利股票的整体状况和走势。 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%×中证红利指数收益率(t)+5%×上证国债指数收益率(t)

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



图,嘉实优化红利股票基金份额聚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 (2012年6月26日至2013年12月31日) 注:1:按基金合同和招募说明书的约定、本基金自基金合同生效日起6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"第十二部分"一、投资范围和四、投资限制"的有关约定。 注:2013年7月20日、本基金管理人发布《关于嘉实优化红和股票基金经理变更的公告》,郭志喜先生不再担任本基金基金经理,则请处为先担任任本基金基金经理,则请公司

### 暴实优化红利股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业额比较基 准收益率的对比图 5.00% 201% 2.00% 1.01% 100% -1.01% 9.01% -102% 11176 -902%

■ 蓝宝GC电影和图图架会沙生中打干 ■ 亚安佐托利利拉斯拉纳拉拉基件准备于 注:本基金基金合同生效日为2012年6月26日,2012年度的相关数据根据当年实际存续期(2012年6月26日至

注:中華歌歌歌上中一一 201年12月31日)计算。 3.3 过去三年基金的利润分配情况 本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。 \$4 **管理人报告** 

7100%

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1. 基金管理人及基金经理情况
4.1. 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,总部设在北京并设承训,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2013年12月31日,基金管理人对管理卫只封闭江海券投资基金。54只开放江海券投资基金。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、嘉实路稳混合、嘉实债务。 追求债金。是实所全企业股票。塞实所公惠实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实结验信债。嘉实债券企业股票。塞实货币、惠实产级3000FTF联体(10F)。嘉实生量处产的企业股票。塞实的经规,是实研究300FTF联体(10F)。惠实生量化阿尔法股票,嘉实回根混合、嘉实基本而50倍数(10F)、嘉实生间优先势聚,嘉实等的指数(20FIF陈核、嘉实普及64年级),第实条价值均分股票,嘉实全成价值,基实保证基本面120年TF 高实产的特效(20FIF陈核、嘉实有资金额等等。第实等还有一个企业,第实全域方式,第实产证基本的120年TF 高实产时间的CFTF联核、嘉实市位约1400至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间约00至TF 高实中间均00至TF 高实中间均00至TF 高实中间均00至TF 高实中间均00至TF 高实中间均00至TF 高实中间均10至TF 高实中间10至TF 高实于10至TF 高实中间10至TF 高实于间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实于间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高实于间10至TF 高实中间10至TF 高实中间10至TF 高生中间10至TF 有实际的10至TF 高实于间10至TF 高实中间10至TF 高生中间10至TF 有实际的10至TF 高生中间10至TF 有实际的10至TF 高生中间10至TF 有实际的10至TF 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

尸贤严投货					
4.1.2	基金经理(或基金经	空理小组)及基金	金经理助理简介	7	
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
XEAS	H/1.35	任职日期	离任日期	III-9F/9CIE-T-PK	12093
赵勇	本基金基金经理, 嘉实回报混合基 金经理	2013年7月20日	-	12年	曾任大成基金管理公司基金经理助理,泰康 资产管理公司权益投资经理。2008年3月加入 嘉实基金管理公司。北京大学光华管理学院 工商管理硕士,具有基金从业资格,中国国籍。
郭志喜	本基金基金经理	2012年6月26日	2013年7月20日	6年	曾任加拿大安省教师退休金计划金融分析 师,加拿大道明院产管理公司助理基金经理。 基金经理。2010年1月加入嘉实基金、曾任机 构投资部投资经理。量化投资部投资经理。金 融经济硕士、CFA、具有基金从业资格、加拿大 国籍。
注:(1	)基金经理郭志喜	的任职日期是指	本基金基金合	同生效之日,表	甚金经理赵勇的任职日期是指公司作品
<b>山戸に八</b> 4	- 스 디 - whe / 로 디 - HRLLE.	A = 1/6 D + ++=	5 / A -> - / -	A STREAM LITTLE AND A PARTY OF A	C 0.14 (1.4. A A.

# 嘉实优化红利股票型证券投资基金

## **2013** 年度 报告摘要

#### 2013年12月31日

向交易,但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
13年市场整体模荡下线、虽然上半年市场对经济复苏和新领导班于倡导的改革充满预期,市场出现了一轮快速上涨。但随后的经济数据表明经济复苏的势头明显低于预期,并在二季度开始再次出现下滑的面头。三季度观有所符其、卫增加值和投业量等超预期回升,减离了市场对经济的担忧情绪,加上新领导班于的改革措施逐步推出,市场出现反弹。但由于经济结构中存在的长期间题无法在短期内解决,政府债务问题的影响开始出现。全年上正下跌6.78%,结核水香中小盘市创业收表现强劲。注集创业级、企作从市场大场,企作从市场大场、电线、企作、平均、178%。 即输上证指数。鉴于红利股表现比较差,上证红利指数全年下跌11.78%。 即输上证指数。鉴于红利股表现比较差,下半年本基金调整了策略。在红利股中选择相对高成长的个股集中配置,下半年取得不错的表现。
4.4.2 报告期内基金份额净值为1.005元;本报告期基金份额净值增长率为一1.18%,业绩比较基准收益率为一9.43%。

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。
1 管理人材档告期内基金利润分配付据风的说明
(1)报告期内本基金补误选相阅分配;
(2)根据本基金基金台国(十六(三)取益分配原则)"1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数量多力20%。每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%,如本基金当季度末每份基金份额可供分配利润的50元,以出本基金管理人应在下季度第一个月进行收益分配",报告期内每季度末每份基金份额可供分配利润均未超过0.05元,以出本基金报告期内未来施利润分配。报告期内每季度末每份基金份额可供分配利润均未超过0.05元,以出本基金报告期内未来施利润分配。将合基金台同约约定。
5.1报告期内本基金托管人递规守信情况声明
本根告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对基实优化红利股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守(证券投资基金法)及其他有关法律法规 基金台同和托管协议的有关规定、不存在损害基金份额持有人利益的行为、完全尽职尽护地履行了应户的少务。5.2 托管人对指与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根告期内。本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金台同和托管协议的规定、对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督、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产等方面进行了认规矩度核、未发现本基金管理人存在把带基金份额持有人利益的行为。
5.3 托管人对本年度报告中勤务信息等内各的真实、准确和完整交意见。本报告中的财务指标、净值表观、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,投资组合报告等数据束实、准确和完整。

7。 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。 **87 年度财务报表** 

7.1 资产负债表 会计主体:嘉实优化红利股票型证券投资基金 报告截止日: 2013年12月31日

			单位:人民币元
资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,099,014.31	3,636,736.00
结算备付金		122,041.73	1,222,520.21
存出保证金		31,987.28	81,280.42
交易性金融资产	7.4.7.2	34,705,980.31	136,611,851.33
其中:股票投资		32,666,966.51	129,587,351.33
基金投资		-	-
债券投资		2,039,013.80	7,024,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	=
买人返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,443,287.88	165,221.05
应收利息	7.4.7.5	43,106.37	62,257.81
应收股利		-	=
应收申购款		13,171,578.84	76,531.11
递延所得税资产		-	_
其他资产	7.4.7.6	-	=
资产总计		54,616,996.72	141,856,397.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		898,256.58	=
应付赎回款		4,919.11	401,528.27
应付管理人报酬		46,394.11	172,427.92
应付托管费		7,732.38	28,738.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	67,490.82	207,026.05
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	350,009.24	161,513.23
负债合计		1,374,802.24	971,233.47
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	52,990,590.62	138,541,930.64
未分配利润	7.4.7.10	251,603.86	2,343,233.82
所有者权益合计		53,242,194.48	140,885,164.46
负债和所有者权益总计		54,616,996.72	141,856,397.93
→ 田本樹 L □ accept to	David H A March	+ + + + \ // ## \/ #### = = -	

24.报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.005元,基金份额总额52,990,590.62份

本报告期: 2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 218,997.82 17,243.5 1,159,701.27 511,882.83 571,830.86 3,414,236.42 313,251.69 4,096.94 2,256,307.60

<del>,</del>			单位:人民币
项目		本期 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 旣金净值)	138,541,930.64	2,343,233.82	140,885,164.46
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润)	=	2,303,597.35	2,303,597.35
三、本期基金份额交易产生的基金净 直变动数	-85,551,340.02	-4,395,227.31	-89,946,567.33
其中:1.基金申购款	74,795,381.82	158,423.77	74,953,805.59
基金赎回款	-160,346,721.84	-4,553,651.08	-164,900,372.92
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 旣金净值)	52,990,590.62	251,603.86	53,242,194.48
项目	2012年6月	上年度可比期间 月26日(基金合同生效日)至2012年12	2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 健金净值)	588,616,310.91		588,616,310.91
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润)	=	2,256,307.60	2,256,307.60
三、本期基金份额交易产生的基金净 直变动数	-450,074,380.27	86,926.22	-449,987,454.05
其中:1.基金申购款	7,540,642.58	-63,040.86	7,477,601.72
基金赎回款	-457,615,022.85	149,967.08	-457,465,055.77
四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动	-	=	-
F.、期末所有者权益 (基金净值)	138,541,930,64	2.343.233.82	140.885.164.46

7.4.3 关联方关系	谷州史止壶侧。	
关联方名称	与本基金的关系	
实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构	
国银行股份有限公司(中国银行")	基金托管人、基金代销机构	
诚信托有限责任公司	基金管理人的股东	
信投资有限责任公司	基金管理人的股东	
:意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东	

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(2013年1月1日至2013年12月1日)及上年度可比期间(2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月 31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

			单位:人民币:
	项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	799,463.28	1,879,510.05
	其中:支付销售机构的客户维护费	251,964.33	632,760.60
ì		金管理有限公司的管理人报酬按前一 算公式为:日管理人报酬=前一日基金	·日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日 资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费 上年度可比期间 2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31 本期 2013年1月1日至2013年12月31日

当取生的基金应交付的托管费 133.251.69
注: 交付基金托管 人中国银行的托管费核前一日基金资产净值 25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按 月安付,基计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 20.25% / 当年天数。
7.4.4.3 与关联方进行银行间回业市场的债券(各回购)交易 本期 (2013年1月19至2013年1月19日)及上年度可比期间(2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日),本基金未与关联方进行银行间间业市场的债券(各回购)交易。
7.4.4.4 各关联方进行银行间间业市场的债券(各回购)交易。
7.4.4.4 格关联方进行银行间间业市场的债券(各回购)交易。
7.4.4.1 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 (2013年1月日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日),基金管理人无运用固有资金投资本基金。
7.4.4.2 报告期本基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本期末(2013年12月31日)及上年度末(2012年12月31日),其他关联方未持有本基金。
7.4.4.2 报告期末保险银行金款金融及当期产生的和息收入

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 上年度可比期间 2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日 2013年1月1日至2013年12月31日

 
 期末余額
 当期利息收入
 期末余額

 4,099,014.31
 36,053.19
 3,6

 银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。
 3,6
 3,6
 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(2013年1月1日至2013年12月31日)及上年度可比期间(2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月

31日),本基金未在承销期内参与1/购关联方承销的证券。 7.4.5 期末(2013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(2013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

								\$	验额单位:人	民币ラ
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 般)	期末 成本总額	期末估值总 额	备注
000625	长安汽车	2013年12月31日	重大 事项 停牌	11.45	2014年1月 3日	11.72	64,934	754,875.21	743,494.30	-
7.4.	5.3 其	用末债券正回则	校易	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(2013年12月31日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 66)
1	权益投资	32,666,966.51	59.81
	其中:股票	32,666,966.51	59.81
2	固定收益投资	2,039,013.80	3.73
	其中:债券	2,039,013.80	3.73
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,221,056.04	7.73
7	其他各项资产	15,689,960.37	28.73
	合计	54,616,996.72	100.00

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	1,217,650.00	2.29
В	采矿业	=	-
С	制造业	25,613,966.51	48.11
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	-	=
G	交通运输、仓储和邮政业	=	-
Н	住宿和餐饮业	-	=
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,379,900.00	4.47
J	金融业	2,839,200.00	5.33
K	房地产业	616,250.00	1.16
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	-	-
0	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	32,666,966,51	61.36

0.0 /,	17143247001	DEL [12536.94)	争值比例大小排序的前	11-1402-14-25-7-7-10	金额单位:人民币:
序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	601166	兴业银行	280,000	2,839,200.00	5.33
2	000651	格力电器	77,000	2,514,820.00	4.72
3	601766	中国南车	400,000	2,004,000.00	3.76
4	600085	同仁堂	85,000	1,819,000.00	3.42
5	000333	美的集团	33,121	1,656,050.00	3.11
6	600315	上海家化	38,782	1,637,763.86	3.08
7	002049	同方国芯	33,000	1,629,540.00	3.06
8	002410	广联达	49,800	1,568,700.00	2.95
9	600887	伊利股份	40,000	1,563,200.00	2.94
10	000039	中集集团	103,000	1,530,580.00	2.87

8.4.1 累计买人金额前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 66)
1	601166	兴业银行	6,782,838.58	4.8
2	600315	上海家化	5,334,988.65	3.7
3	000333	美的集团	4,703,710.46	3.3
4	600011	华能国际	3,927,509.15	2.7
5	601766	中国南车	3,720,977.00	2.0
6	600887	伊利股份	3,696,487.80	2.0
7	600016	民生银行	3,639,475.70	2.5
8	000651	格力电器	3,597,595.33	2.5
9	600104	上汽集团	3,356,326.00	2.3
10	600597	光明乳业	3,210,847.26	2.2
11	600518	康美药业	3,084,528.24	2.1
12	600376	首开股份	2,989,755.00	2.1
13	600309	万华化学	2,961,617.94	2.1
14	300017	网宿科技	2,885,752.73	2.0
15	601328	交通银行	2,842,000.00	2.0
16	002317	众生药业	2,676,586.10	1.9
17	000527	美的电器	2,585,653.28	1.8
18	000028	国药一致	2,535,267.00	1.8
19	000625	长安汽车	2,525,341.65	1.5
20	002400	省广股份	2,321,349.80	1.6

占期初基金资产净值比例 %)	本期累计卖出金额	股票名称	股票代码	序号
6.97	9,819,520.47	美的电器	000527	1
4.05	5,707,712.89	首开股份	600376	2
3.75	5,278,207.93	复星医药	600196	3
3.74	5,267,300.00	海南航空	600221	4
3.69	5,193,525.20	交通银行	601328	5
3.67	5,164,990.93	上海医药	601607	6
3.52	4,953,433.11	阳光照明	600261	7
3.42	4,821,718.57	兴业银行	601166	8
3.17	4,469,698.55	友谊股份	600827	9
3.17	4,461,278.71	中国石化	600028	10
3.13	4,406,947.00	中国太保	601601	11
2.98	4,195,442.68	国投新集	601918	12
2.87	4,039,000.00	招商银行	600036	13
2.81	3,957,192.48	华能国际	600011	14
2.79	3,935,530.00	雅戈尔	600177	15
2.74	3,855,829.90	王府井	600859	16
2.73	3,846,992.02	民生银行	600016	17
2.59	3,648,924.54	上海家化	600315	18
2.44	3,438,524.37	上汽集团	600104	19
2.40	3,381,459.53	光明乳业	600597	20
2.37	3,340,385.07	合肥百货	000417	21
2.35	3,314,341.98	华域汽车	600741	22
2.32	3,263,667.32	鲁 泰A	000726	23
2.29	3,223,205.14	网宿科技	300017	24
2.20	3,099,404.03	美的集团	000333	25
2.09	2,949,891.00	康美药业	600518	26
2.05	2,894,354.28	张 裕A	000869	27

		平位:人民用元
	买人股票成本 绒交 )总额	188,165,726.17
	卖出股票收入 成交 )总额	288,315,961.91
	注:8.4.1项 "买人金额" 、8.4.2项 "卖出金额	"及8.4.3项"买人股票成本"、"卖出股票收入"均按买人或卖出
j.	成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考局	息相关交易费用。
	0 = thr +++++++++++++++++++++++++++++++++++	

金额单位:人民币			
占基金资产净值比例 66)	公允价值	债券品种	序号
3.8	2,039,013.80	国家债券	1
	=	央行票据	2
	-	金融债券	3
	-	其中:政策性金融债	
	-	企业债券	4
	-	企业短期融资券	5
	-	中期票据	6
	-	可转债	7
	-	其他	8
3.8	2,039,013.80	合计	

뵷	月木按公允价值占。	弘金贷产净值比	:例大小排序的#	五名惯券投货明细	
					金额单位:人民币元
	债券代码	债券名称	数量 张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
	019302	13国债02	10,460	1,046,313.80	1.97
	090018	09附息国债18	10,000	992,700.00	1.86
	1 4- Hrt - + - 1 - 1 - 1 - 1 - 1 - 1 - 1 - 1 - 1	++ 1 \4 = 1 /4 :	I4		

2 090018 09附昆団暦18 10,000 992,700.
注:报告期末本基金仅持有上述2只债券。
8.7 期末按公允价值占基金资产等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按公允价值占基金资产等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。

8.12.1 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

年內受到公开通费,处罚的价值形。
(1)上海家化联合股份有限公司发布了《关于收到中国证监会《调查通知书》的公告》,因公司涉嫌违反
(1)上海家化联合股份有限公司发布了《关于收到中国证监会《调查通知书》的公告》,因公司涉嫌违反
(中华人民共和国证券法》及相关法规,中国证监会、定对公司立案稽查。本基金投资于"上海家化化600315)"的
决策程序说明:基于上海家化基本面研究以及一级市场的判断,本基金投资于"上海家化"股票的决策流程,符合

公司投资管理制度的相关规定。 (2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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中,其他九名证券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	金額
1	存出保证金	31,987.28
2	应收证券清算款	2,443,287.88
3	应收股利	=
4	应收利息	43,106.37
5	应收申购款	13,171,578.84
6	其他应收款	=
7	待摊费用	=
8	其他	-

台计 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.本基金末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

8.9 基金份额持有人信息 9.1 期末其全份额持有人户数及持有人结构

					DATE - DE		
		持有人结构					
持有人户数(户)	户均持有的基金份	机构投资者		个人投资者			
	額	持有份额	占总份额比例	持有份額	占总份额比 例		
636	83,318.54	7,961,908.67	15.03%	45,028,681.95	84.97%		
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况							
担生期主 甘久經理   毎日ル   日土は右末甘久							

§ 10 开放式基金份额变动

4报告期期末基金份额总数 5期期间基金总申购份额含转换人份额,基金总赎回份额含转换出份额

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 重大事件揭示

0 基金管理人的重大人事变动情况 2013年7月20日,未基金管理人发布 长于嘉实优化互利股票基金经理变更的公告》,郭志喜先生不再担任本基金基金经理,聘请起勇 但基金社管人的专机。基合性管制了的重大人事变动情况 0 基金社管人的专机等与 1基金社管部门工业于人事变动。 2014年3月17日中国银行经价有限公司会。在《海长生医共中国银行股份有限公司董事长职务。 2014年3月17日中国银行经价有限公司会。在《海长生医共中国银行股份有限公司董事长职务。 2014年3月17日中国银行投价有限公司公告。自2013年5月31日起,田园立先生放任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主

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

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北审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所、鹤珠普遍合伙 的审计赞50.0 审计机构已建统2年提供审计服务。

			曾查或处罚等情况	1		
		其高級管理人员无受				
			票投资及佣金支付	计情况		
	ı	*0.77				位:人民
券商名称	交易单元数量		(交易 占当期股票	应支付该券	商的佣金 占当期佣金	备注
22 144-1214	).007   7 UNCHE	成交金額	成交总额的比例	佣金	总量的比例	514 5.2
中信证券股份有 限公司	3	117,786,441.07	25.04%	85,777.02	21.91%	-
中信建投证券股 份有限公司	2	92,251,593.71	19.61%	83,986.13	21.45%	-
民生证券股份有 限公司	2	64,220,050.67	13.65%	54,098.04	13.82%	-
北京高华证券有 限责任公司	1	47,184,028.25	10.03%	33,028.82	8.44%	-
兴业证券股份有 限公司	3	46,864,892.44	9.96%	42,666.15	10.90%	-
安信证券股份有 限公司	3	25,996,739.65	5.53%	23,301.51	5.95%	-
东北证券股份有 限公司	2	21,688,368.99	4.61%	19,192.18	4.90%	-
国泰君安证券股 份有限公司	4	18,576,020.63	3.95%	16,876.99	4.31%	-
国信证券股份有 限公司	1	16,513,552.25	3.51%	15,033.73	3.84%	-
东兴证券股份有 限公司	1	13,462,714.48	2.86%	12,256.25	3.13%	-
光大证券股份有 限公司	1	4,181,350.39	0.89%	3,806.68	0.97%	-
东方证券股份有 限公司	2	1,612,002.75	0.34%	1,467.58	0.37%	-
渤海证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
大通证券股份有 限公司	1	-	=	=	=	-
东吴证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有 限公司	5	-	-	-	-	新增
广州证券有限责 任公司	2	-	-	-	-	新
国金证券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
宏源证券股份有 限公司	1	-	1	-	-	-
华宝证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责 任公司	2	-	-	-	-	新均
华福证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
化确证类股份有	<b>—</b>					

ド泰证券股份 限公司

银万国证明

法证券股份 限公司 英大证券有限

长城证券有限

会江证券股份 限公司

中航证券有限2 中信证券 (断江 有限责任公司 计。 注2:交易单元的选择标准和程序

(2)有良好的内控制度,在业内有良好的声誉; (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,据帐户门的研究报告; (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 注3:报告期内,本基金退租以下交易单元:华泰证券股份有限公司深圳交易单元1个、财富证券有限责任公司

(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;

深圳交易单元1个和广发证券股份有限公司上海交易单元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	
	债券交易	易	债券回购交易		
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回购 成交总额的比例	
中信证券股份有限公司	1,399,474.80	16.31%	10,000,000.00	13.39%	
中信建投证券股份有限 公司	1,642,570.60	19.14%	39,900,000.00	53.41%	
民生证券股份有限公司	1,851,850.00	21.58%	-	-	
北京高华证券有限责任 公司	-	-	15,000,000.00	20.08%	
兴业证券股份有限公司	1,702,760.00	19.84%	2,500,000.00	3.35%	
国信证券股份有限公司	651,805.00	7.60%	4,300,000.00	5.76%	
东兴证券股份有限公司	922,512.00	10.75%	-	-	
光大证券股份有限公司	-	-	2,000,000.00	2.68%	
东方证券股份有限公司	409,549.00	4.77%	1,000,000.00	1.34%	

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