

# 嘉实稳健开放式证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 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.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 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.....	54
7.9 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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 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的情况.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
11.1 备查文件目录.....	64

11.2 存放地点.....	64
11.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 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
报告期末基金份额总额	3,189,334,163.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

## 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
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市建国门北大街8号华润大厦8层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		邓红国	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街8号华润大厦8层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-29,722,502.08
本期利润	352,507,277.05
加权平均基金份额本期利润	0.1074
本期加权平均净值利润率	9.67%
本期基金份额净值增长率	10.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	2,173,214,299.28
期末可供分配基金份额利润	0.6814
期末基金资产净值	3,749,407,286.70
期末基金份额净值	1.176
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	347.86%

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
过去一个月	6.33%	0.62%	3.35%	0.41%	2.98%	0.21%
过去三个月	4.91%	0.67%	3.94%	0.38%	0.97%	0.29%
过去六个月	10.11%	0.60%	6.51%	0.35%	3.60%	0.25%

过去一年	9.80%	0.62%	9.41%	0.41%	0.39%	0.21%
过去三年	61.46%	1.51%	78.76%	1.47%	-17.30%	0.04%
自基金合同 生效起至今	347.86%	1.27%	245.64%	1.67%	102.22%	-0.40%

注：本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200(大盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

巨潮大盘指数的总市值相对于 A 股市场覆盖率约为 52%，具有良好的市场代表性，用以反映 A 股市场大盘市值股票的运行情况，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

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

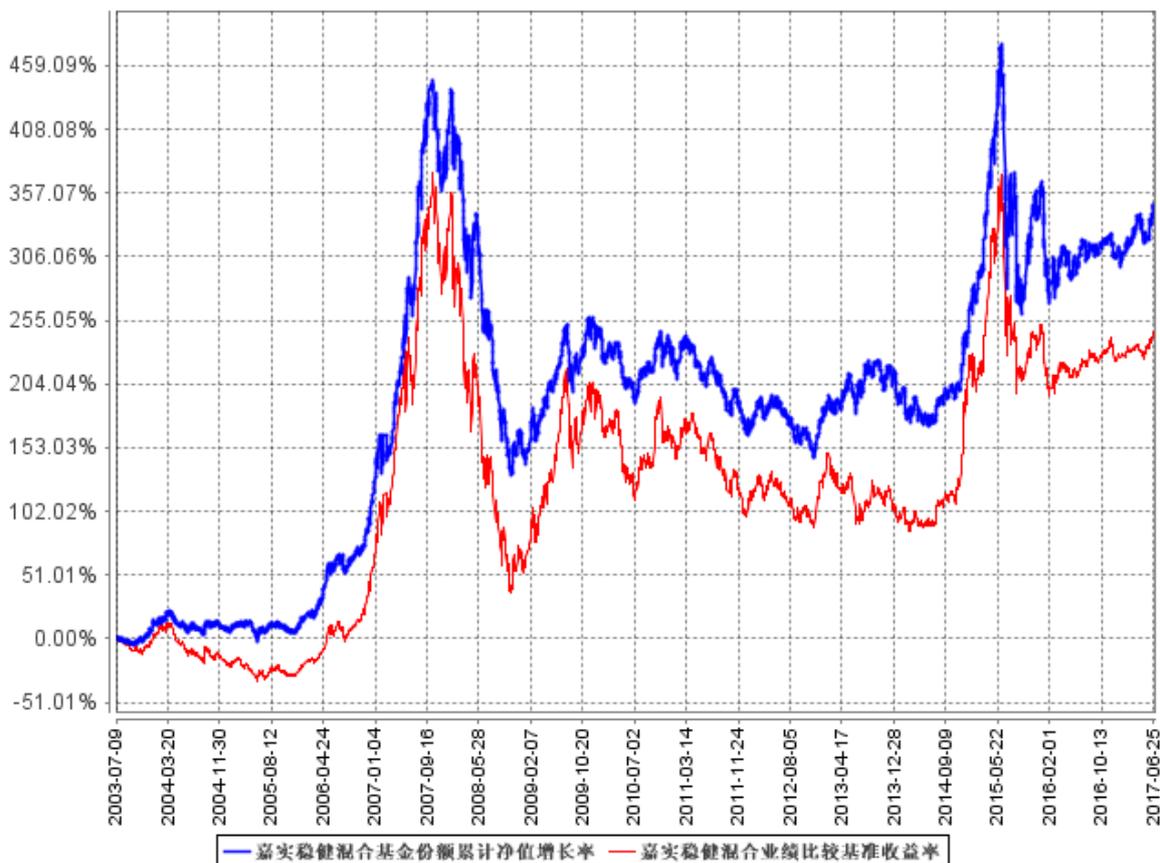
$$\text{Return}(t) = 60\% * (\text{巨潮 200(大盘)指数}(t) / \text{巨潮 200(大盘)指数}(t-1) - 1) + 40\% * (\text{中国债券总指数}(t) / \text{中国债券总指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实稳健混合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：嘉实稳健混合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

(2003 年 7 月 9 日至 2017 年 6 月 30 日)

注：按基金合同规定，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三部分（四（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（5）本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）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。

## § 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 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 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、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、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-LOF)、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、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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债

券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、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、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、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、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原由 (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、嘉实稳康纯债债券、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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟琳琳	本基金、嘉实价值优势混合基金经理	2015 年 2 月 17 日	-	12 年	2005 年 7 月加入嘉实基金，先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。
张淼	本基金、嘉实先进制造股票基金经理	2015 年 2 月 17 日	-	12 年	曾就职于东方基金管理有限公司研究部。2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，先后担任研究员、研究部副总监和基金经理助理职务。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）任职日期、离任日期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。（3）本基金基金经理张淼女士因休产假超过 30 日，在

其休假期间，本基金暂由我公司基金经理李帅先生代为履行基金经理职责。该事项已于 2017 年 3 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

## 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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 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 6 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

本报告期内市场整体温和上涨，一季度市场主要围绕 PPI 快速上涨带来的周期股的盈利修复、低估值蓝筹的估值修复以及 19 大带来的改革预期的主题投资三条主线展开，二季度在经济增长阶段性见顶和流动性边际收紧的背景下，市场结束了春季躁动，二八分化明显，只有家电、非银金融、食品饮料和银行四个行业取得了正收益；整体看今年上半年沪深 300 上涨 10.78%，上证 50 上涨 11.5%，创业板指数下跌 7.52%；分行业看，家用电器、食品饮料、有色金属、钢铁和银行取

得了较好的绝对收益和相对收益，而传媒、农林牧渔、纺织服装和计算机则产生了较大的负的绝对收益和相对收益。

回顾本组合的操作，一季度在经济较好和流动性充裕的背景下维持了较高的仓位，二季度在政策上控杠杆的背景下，下调了权益的配置到 60%左右；在行业配置上，增加了估值较低且增长确定的保险和银行的配置，以及集中度较高且估值较低的造纸和建材的配置，保持了医药、家电和通讯设备的龙头品种的配置；减持了景气度有所下降的汽车、估值较高的军工和苹果产业链的配置。

#### 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 1.176 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.11%，业绩比较基准收益率为 6.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为：一是，三四线房地产销售增长带来房地产投资的持续性和强度好于预期，海外经济的恢复带动出口增速也好于预期，因此整个经济预计能够保持平稳的态势；二是流动性仍处于偏紧的状态，政府继续强化金融去杠杆的决心，同时也强调防范地方政府债务风险；三是，整体市场的风险偏好受政策的打压并没有提高的迹象；因此，我们判断下半年整体市场依然维持平稳，更多的收益仍来自于行业和个股的精选，我们看好的方向主要是：一是，受益于供给侧改革和环保约束的造纸、水泥和电解铝行业；二是，受益于经济小幅改善且估值较低的银行和保险；三是，增长确定且估值合理的医药和家电的龙头企业；四是，政策友好且有较大增长空间的新能源汽车和通讯设备。

#### 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**

根据本基金基金合同（十一（二）基金收益分配原则）约定，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 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实稳健开放式证券投资基金（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、基金合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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合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支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	430,753,988.85	180,973,999.75
结算备付金		3,872,377.89	4,658,493.48
存出保证金		661,070.21	573,636.12
交易性金融资产	6.4.7.2	3,348,583,737.11	3,399,332,150.42
其中：股票投资		2,478,217,263.81	2,518,526,050.12
基金投资		-	-
债券投资		870,366,473.30	880,806,100.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	65,631.26
应收利息	6.4.7.5	11,333,815.75	15,477,166.96
应收股利		-	-
应收申购款		119,667.35	66,825.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,795,324,657.16	3,601,147,903.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		32,107,390.04	3,467,032.09
应付赎回款		6,382,768.92	1,776,570.66
应付管理人报酬		4,507,415.38	4,629,909.32
应付托管费		751,235.92	771,651.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,775,116.40	1,434,627.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	393,443.80	450,509.69
负债合计		45,917,370.46	12,530,300.53
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,576,192,987.42	1,660,905,913.87
未分配利润	6.4.7.10	2,173,214,299.28	1,927,711,689.30
所有者权益合计		3,749,407,286.70	3,588,617,603.17
负债和所有者权益总计		3,795,324,657.16	3,601,147,903.70

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.176 元，基金份额总额 3,189,334,163.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>		389,828,071.72	-438,692,736.75
1.利息收入		15,719,623.23	16,505,431.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	794,509.42	854,771.65
债券利息收入		14,904,295.45	15,650,660.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,818.36	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,147,721.58	-160,304,406.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-27,978,052.08	-171,539,554.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-154,990.00	-2,181,240.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	19,985,320.50	13,416,387.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	382,229,779.13	-294,925,915.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,390.94	32,153.78
<b>减：二、费用</b>		37,320,794.67	37,879,236.09
1. 管理人报酬		27,082,988.71	27,998,571.41
2. 托管费		4,513,831.50	4,666,428.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,604,342.30	5,097,170.56
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	119,632.16	117,065.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		352,507,277.05	-476,571,972.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		352,507,277.05	-476,571,972.84

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,660,905,913.87	1,927,711,689.30	3,588,617,603.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	352,507,277.05	352,507,277.05
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）	-84,712,926.45	-107,004,667.07	-191,717,593.52
其中：1.基金申购款	17,100,397.60	21,446,026.07	38,546,423.67
2.基金赎回款	-101,813,324.05	-128,450,693.14	-230,264,017.19
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）	1,576,192,987.42	2,173,214,299.28	3,749,407,286.70
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30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）	1,772,456,287.97	2,580,272,282.98	4,352,728,570.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-476,571,972.84	-476,571,972.84
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）	-22,772,283.22	-27,241,771.89	-50,014,055.11
其中：1.基金申购款	36,612,736.90	40,476,361.81	77,089,098.71
2.基金赎回款	-59,385,020.12	-67,718,133.70	-127,103,153.82
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）	-	-35,813,111.75	-35,813,111.75
五、期末所有者权益（基金净值）	1,749,684,004.75	2,040,645,426.50	3,790,329,431.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>张公允</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 1,030,248,511.17 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2007 年 5 月 30 日进行了基金份额拆分操作，当日本基金拆分前基金份额净值为人民币 2.024 元，本基金管理人按照 1:2.023867075 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。拆分后，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.023867075 份。本基金于 2007 年 5 月 31 日进行了变更登记。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%，债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核

算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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。

### 6.4.5 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。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	430,753,988.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	430,753,988.85

注：定期存款的存款期限指票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,129,666,970.53	2,478,217,263.81	348,550,293.28
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	93,000.00	97,473.30
	银行间市场	870,979,358.90	870,269,000.00
	合计	871,072,358.90	870,366,473.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,000,739,329.43	3,348,583,737.11	347,844,407.68

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	72,078.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	1,560.19
应收债券利息	11,259,907.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.51
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	267.75
合计	11,333,815.75

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2017年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,774,897.52
银行间市场应付交易费用	218.88
合计	1,775,116.40

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	4,264.85
预提费用	139,178.95
应付指数使用费	-
其他	-
合计	393,443.80

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,360,747,642.92	1,660,905,913.87
本期申购	34,600,895.96	17,100,397.60
本期赎回(以“-”号填列)	-206,014,375.01	-101,813,324.05
本期末	3,189,334,163.87	1,576,192,987.42

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,519,473,406.47	-591,761,717.17	1,927,711,689.30
本期利润	-29,722,502.08	382,229,779.13	352,507,277.05
本期基金份额交易产生的变动数	-126,264,382.56	19,259,715.49	-107,004,667.07
其中：基金申购款	25,518,011.29	-4,071,985.22	21,446,026.07
基金赎回款	-151,782,393.85	23,331,700.71	-128,450,693.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,363,486,521.83	-190,272,222.55	2,173,214,299.28

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,404.51
其他	4,075.44
合计	794,509.42

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	2,307,380,236.12
减：卖出股票成本总额	2,335,358,288.20
买卖股票差价收入	-27,978,052.08

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	620,376,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	600,154,990.00
减：应收利息总额	20,376,000.00
买卖债券差价收入	-154,990.00

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,985,320.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,985,320.50

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	382,229,779.13
——股票投资	392,831,726.13
——债券投资	-10,601,947.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	382,229,779.13

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	24,004.65
基金转出费收入	2,386.29

债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	26,390.94

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	5,601,942.30
银行间市场交易费用	2,400.00
合计	5,604,342.30

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	11,453.21
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	-
合计	119,632.16

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

## 6.4.10 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。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,082,988.71	27,998,571.41
其中：支付销售机构的客	2,973,354.11	3,055,874.96

户维护费		
------	--	--

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,513,831.50	4,666,428.59

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 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

本期						
2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国银行	220,388,164.10	-	-	-	-	-

注：上年度可比期间（2016年1月1日至2016年6月30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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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（2017 年 6 月 30 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

##### 6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	430,753,988.85	766,029.47	254,069,924.61	818,921.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

###### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	网下申购
002882	金龙	2017 年 6	2017 年 7	未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	网下

	羽	月 15 日	月 17 日							申购
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	网下申购
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	网下申购
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	网下申购
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	网下申购
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	网下申购
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	网下申购
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	网下申购

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

#### 6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

#### 6.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	928,774	42,209,949.74	28,624,814.68	-

			停牌							
300065	海兰信	2016 年 12 月 8 日	重大事项停牌	25.63	2017 年 7 月 6 日	23.07	179,850	4,484,826.74	4,609,555.50	-
603501	韦尔股份	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	20.15	-	-	829	5,819.58	16,704.35	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金

管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	430,753,988.85	-	-	-	430,753,988.85
结算备付金	3,872,377.89	-	-	-	3,872,377.89
存出保证金	661,070.21	-	-	-	661,070.21
交易性金融资产	519,934,000.00	350,432,473.30	-	-2,478,217,263.81	3,348,583,737.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	11,333,815.75	11,333,815.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	11,950.00	-	-	107,717.35	119,667.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	955,233,386.95	350,432,473.30	-	2,489,658,796.91	3,795,324,657.16
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	32,107,390.04	32,107,390.04
应付赎回款	-	-	-	6,382,768.92	6,382,768.92
应付管理人报酬	-	-	-	4,507,415.38	4,507,415.38
应付托管费	-	-	-	751,235.92	751,235.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,775,116.40	1,775,116.40
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	393,443.80	393,443.80
负债总计	-	-	-	45,917,370.46	45,917,370.46
利率敏感度缺口	955,233,386.95	350,432,473.30	-	-2,443,741,426.45	3,749,407,286.70
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	180,973,999.75	-	-	-	180,973,999.75
结算备付金	4,658,493.48	-	-	-	4,658,493.48

存出保证金	573,636.12	-	-	-	573,636.12
交易性金融资产	419,685,000.00	205,121,100.30	256,000,000.00	2,518,526,050.12	3,399,332,150.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	65,631.26	65,631.26
应收利息	-	-	-	15,477,166.96	15,477,166.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	449.86	-	-	66,375.85	66,825.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	605,891,579.21	205,121,100.30	256,000,000.00	2,534,135,224.19	3,601,147,903.70
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,467,032.09	3,467,032.09
应付赎回款	-	-	-	1,776,570.66	1,776,570.66
应付管理人报酬	-	-	-	4,629,909.32	4,629,909.32
应付托管费	-	-	-	771,651.55	771,651.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,434,627.22	1,434,627.22
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	450,509.69	450,509.69
负债总计	-	-	-	12,530,300.53	12,530,300.53
利率敏感度缺口	605,891,579.21	205,121,100.30	256,000,000.00	2,521,604,923.66	3,588,617,603.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	4,151,727.22	4,553,236.13
	市场利率上升 25 个基点	-4,105,241.60	-4,495,730.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。于 2017 年 06 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,478,217,263.81	66.10	2,518,526,050.12	70.18
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,478,217,263.81	66.10	2,518,526,050.12	70.18

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	249,363,622.60	249,100,620.60
	业绩比较基准下降 5%	-249,363,622.60	-249,100,620.60

## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,444,956,683.83 元，属于第二层次的余额为 903,627,053.28 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,414,482,872.98 元，第二层次 984,849,277.44 元，无属于第三层次的余额）。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非

保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	2,478,217,263.81	65.30
	其中：股票	2,478,217,263.81	65.30
2	固定收益投资	870,366,473.30	22.93
	其中：债券	870,366,473.30	22.93
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	434,626,366.74	11.45
7	其他各项资产	12,114,553.31	0.32
8	合计	3,795,324,657.16	100.00

### 7.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,483.85	0.00
C	制造业	1,227,024,830.22	32.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,680,000.00	0.74
E	建筑业	170,421,362.26	4.55

F	批发和零售业	393,506,158.74	10.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,329.55	0.00
J	金融业	455,731,613.45	12.15
K	房地产业	41,074,249.60	1.10
L	租赁和商务服务业	118,133,576.68	3.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	40,400,718.56	1.08
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	4,162,940.90	0.11
S	综合	-	-
	合计	2,478,217,263.81	66.10

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000028	国药一致	2,684,976	217,214,558.40	5.79
2	000963	华东医药	3,545,244	176,198,626.80	4.70
3	000063	中兴通讯	5,840,762	138,659,689.88	3.70
4	000651	格力电器	3,208,600	132,098,062.00	3.52
5	600703	三安光电	5,369,380	105,776,786.00	2.82
6	600887	伊利股份	3,760,800	81,195,672.00	2.17
7	002027	分众传媒	5,823,400	80,129,984.00	2.14
8	600036	招商银行	3,348,500	80,062,635.00	2.14

9	002450	康得新	3,381,452	76,150,299.04	2.03
10	601318	中国平安	1,449,927	71,930,878.47	1.92
11	600436	片仔癀	1,000,384	61,063,439.36	1.63
12	600038	中直股份	1,287,923	58,948,235.71	1.57
13	000513	丽珠集团	861,460	58,665,426.00	1.56
14	600585	海螺水泥	2,273,400	51,674,382.00	1.38
15	601800	中国交建	2,999,948	47,669,173.72	1.27
16	600867	通化东宝	2,579,241	47,045,355.84	1.25
17	601398	工商银行	8,466,600	44,449,650.00	1.19
18	600068	葛洲坝	3,951,300	44,412,612.00	1.18
19	601169	北京银行	4,835,700	44,343,369.00	1.18
20	000401	冀东水泥	2,862,346	44,051,504.94	1.17
21	601166	兴业银行	2,612,100	44,040,006.00	1.17
22	601939	建设银行	6,908,896	42,489,710.40	1.13
23	601668	中国建筑	4,348,500	42,093,480.00	1.12
24	000002	万科A	1,623,400	40,536,298.00	1.08
25	000069	华侨城A	4,015,976	40,400,718.56	1.08
26	000423	东阿阿胶	560,854	40,319,794.06	1.08
27	000858	五粮液	700,000	38,962,000.00	1.04
28	601799	星宇股份	879,952	38,911,477.44	1.04
29	601888	中国国旅	1,260,208	37,982,669.12	1.01
30	002241	歌尔股份	1,947,900	37,555,512.00	1.00
31	000525	红太阳	1,987,146	36,980,787.06	0.99
32	600820	隧道股份	3,584,883	36,207,318.30	0.97
33	600089	特变电工	3,442,800	35,564,124.00	0.95
34	300056	三维丝	2,245,686	34,044,599.76	0.91
35	601601	中国太保	933,100	31,604,097.00	0.84
36	601336	新华保险	585,700	30,104,980.00	0.80

37	002049	紫光国芯	928,774	28,624,814.68	0.76
38	600109	国金证券	2,346,229	27,497,803.88	0.73
39	002466	天齐锂业	500,000	27,175,000.00	0.72
40	600030	中信证券	1,500,000	25,530,000.00	0.68
41	601991	大唐发电	4,500,000	20,340,000.00	0.54
42	000895	双汇发展	754,600	17,921,750.00	0.48
43	601628	中国人寿	500,000	13,490,000.00	0.36
44	600741	华域汽车	500,000	12,120,000.00	0.32
45	002120	韵达股份	208,905	10,779,498.00	0.29
46	600011	华能国际	1,000,000	7,340,000.00	0.20
47	600019	宝钢股份	1,007,600	6,760,996.00	0.18
48	300065	海兰信	179,850	4,609,555.50	0.12
49	601098	中南传媒	221,890	4,136,029.60	0.11
50	600340	华夏幸福	16,020	537,951.60	0.01
51	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
52	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.00
53	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.00
54	601952	苏垦农发	5,213	72,304.31	0.00
55	002867	周大生	1,722	53,175.36	0.00
56	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
57	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
58	603113	金能科技	1,748	40,763.36	0.00
59	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
60	002880	卫光生物	499	37,774.30	0.00
61	002872	天圣制药	1,002	37,043.94	0.00
62	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
63	603920	世运电路	1,563	35,042.46	0.00
64	603728	鸣志电器	1,360	31,728.80	0.00

65	603197	保隆科技	543	28,806.15	0.00
66	002869	金溢科技	628	27,318.00	0.00
67	603896	寿仙谷	696	27,150.96	0.00
68	603096	新经典	635	26,911.30	0.00
69	603505	金石资源	1,285	26,483.85	0.00
70	603803	瑞斯康达	1,123	26,019.91	0.00
71	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
72	300657	弘信电子	511	24,068.10	0.00
73	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
74	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
75	603758	秦安股份	1,221	22,527.45	0.00
76	300658	延江股份	555	21,550.65	0.00
77	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
78	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
79	300662	科锐国际	828	20,923.56	0.00
80	603855	华荣股份	1,364	20,896.48	0.00
81	002875	安奈儿	579	20,757.15	0.00
82	603326	我乐家居	726	20,306.22	0.00
83	002866	传艺科技	744	20,035.92	0.00
84	603767	中马传动	893	19,887.11	0.00
85	002865	钧达股份	623	18,440.80	0.00
86	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
87	002877	智能自控	718	18,151.04	0.00
88	603787	新日股份	925	18,102.25	0.00
89	603383	顶点软件	406	18,091.36	0.00
90	002868	绿康生化	617	17,936.19	0.00
91	002870	香山股份	523	17,546.65	0.00
92	603042	华脉科技	616	17,506.72	0.00

93	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
94	603320	迪贝电气	479	17,033.24	0.00
95	603501	韦尔股份	829	16,704.35	0.00
96	300643	万通智控	1,014	16,599.18	0.00
97	603196	日播时尚	1,042	16,348.98	0.00
98	603488	展鹏科技	919	16,045.74	0.00
99	603496	恒为科技	456	15,677.28	0.00
100	300652	雷迪克	483	15,431.85	0.00
101	300663	科蓝软件	647	15,418.01	0.00
102	300647	超频三	622	15,301.20	0.00
103	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
104	603226	菲林格尔	436	14,946.08	0.00
105	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
106	603879	永悦科技	614	14,183.40	0.00
107	300514	友讯达	512	13,767.68	0.00
108	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
109	603139	康惠制药	455	13,590.85	0.00
110	300659	中孚信息	388	13,587.76	0.00
111	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
112	603229	奥翔药业	670	13,279.40	0.00
113	300655	晶瑞股份	437	12,922.09	0.00
114	603536	惠发股份	504	12,070.80	0.00
115	603269	海鸥股份	398	11,693.24	0.00
116	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
117	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
118	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
119	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
120	600511	国药股份	76	2,754.24	0.00

121	002544	杰赛科技	26	592.80	0.00
122	000712	锦龙股份	33	540.21	0.00
123	600737	中粮糖业	33	311.52	0.00
124	000952	广济药业	6	90.18	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600887	伊利股份	74,374,865.04	2.07
2	600036	招商银行	71,265,973.37	1.99
3	002027	分众传媒	70,154,652.31	1.95
4	601318	中国平安	64,307,095.14	1.79
5	000513	丽珠集团	52,705,122.78	1.47
6	600390	五矿资本	52,400,768.97	1.46
7	601800	中国交建	49,562,454.97	1.38
8	600089	特变电工	49,364,313.70	1.38
9	600585	海螺水泥	48,182,465.02	1.34
10	601939	建设银行	44,377,332.90	1.24
11	600820	隧道股份	44,132,462.13	1.23
12	601169	北京银行	43,424,680.55	1.21
13	601398	工商银行	43,107,899.74	1.20
14	601166	兴业银行	42,966,162.06	1.20
15	601668	中国建筑	42,607,480.68	1.19
16	002074	国轩高科	41,340,127.57	1.15
17	000069	华侨城 A	40,460,894.35	1.13
18	600308	华泰股份	39,907,794.51	1.11

19	600340	华夏幸福	38,214,207.53	1.06
20	002241	歌尔股份	35,823,625.28	1.00

#### 7.4.2 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	600737	中粮糖业	111,404,512.55	3.10
2	600477	杭萧钢构	98,637,990.72	2.75
3	000581	威孚高科	86,437,966.70	2.41
4	002051	中工国际	86,255,524.12	2.40
5	601992	金隅股份	79,629,898.38	2.22
6	600759	洲际油气	64,689,917.36	1.80
7	600308	华泰股份	60,925,252.68	1.70
8	000547	航天发展	56,780,937.36	1.58
9	300033	同花顺	52,336,574.45	1.46
10	600584	长电科技	46,374,575.91	1.29
11	000778	新兴铸管	43,423,668.24	1.21
12	600498	烽火通信	41,850,617.14	1.17
13	600390	五矿资本	41,819,900.55	1.17
14	002074	国轩高科	41,242,826.10	1.15
15	600104	上汽集团	39,689,997.05	1.11
16	601058	赛轮金宇	38,515,758.74	1.07
17	600118	中国卫星	38,003,985.34	1.06
18	000423	东阿阿胶	37,925,402.75	1.06
19	000401	冀东水泥	37,274,836.13	1.04
20	601688	华泰证券	36,981,816.85	1.03

## 7.4.3 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	1,902,217,775.76
卖出股票收入（成交）总额	2,307,380,236.12

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 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。

## 7.5 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	248,525,000.00	6.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	621,744,000.00	16.58
	其中：政策性金融债	621,744,000.00	16.58
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）	97,473.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	870,366,473.30	23.21

## 7.6 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	120009	12 付息国债 09	2,500,000	248,525,000.00	6.63
2	150201	15 国开 01	1,800,000	179,982,000.00	4.80

3	160419	16 农发 19	1,800,000	179,874,000.00	4.80
4	110208	11 国开 08	1,000,000	101,810,000.00	2.72
5	160217	16 国开 17	600,000	59,688,000.00	1.59

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	661,070.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,333,815.75
5	应收申购款	119,667.35
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,114,553.31

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123001	蓝标转债	97,473.30	0.00

#### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
206,206	15,466.74	9,087,279.24	0.28%	3,180,246,884.63	99.72%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 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的情况

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月9日）基金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	3,360,747,642.92
本报告期基金总申购份额	34,600,895.96
减：本报告期基金总赎回份额	206,014,375.01
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	3,189,334,163.87

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

**10.5 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，会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

**10.6 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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

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	
招商证券股份有限公司	2	778,496,113.14	18.51%	544,949.70	18.65%	—
长江证券股份有限公司	1	715,784,850.47	17.01%	501,056.01	17.15%	—
宏信证券有限责任公司	2	512,105,201.90	12.17%	358,475.31	12.27%	—
东兴证券股份有限公司	1	437,969,204.98	10.41%	306,578.45	10.49%	—
光大证券股份有限公司	1	362,265,330.67	8.61%	253,585.73	8.68%	—
中国国际金融股份有限公司	3	303,599,146.98	7.22%	191,664.20	6.56%	新增 1 个
中信建投证券股份有限公司	2	238,469,746.00	5.67%	166,929.09	5.71%	—

海通证券股 份有限公司	2	200,898,769.84	4.78%	140,629.54	4.81%	-
安信证券股 份有限公司	3	149,510,657.02	3.55%	104,657.65	3.58%	-
中信证券股 份有限公司	4	124,519,137.00	2.96%	87,165.28	2.98%	-
广发证券股 份有限公司	5	101,774,149.07	2.42%	71,241.95	2.44%	-
东方证券股 份有限公司	4	87,088,308.01	2.07%	60,962.94	2.09%	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	78,845,423.51	1.87%	55,191.79	1.89%	-
国金证券股 份有限公司	2	64,087,866.61	1.52%	44,861.50	1.54%	-
东吴证券股 份有限公司	3	51,405,022.24	1.22%	33,444.41	1.14%	新增 2 个
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
国信证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
华西证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经 纪有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
信达证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	新增

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。

注 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。

注 3：平安证券有限责任公司更名为平安证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租深圳交易单元 1 个。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加“新浪基金”为嘉实旗下基金代销机构 并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 2 月 21 日
2	关于调整凤凰金信基金代销的部分开放式基金转换补差费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 2 月 28 日
3	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 3 月 16 日
4	嘉实基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 3 月 24 日
5	关于嘉实旗下部分开放式基金转换业务更新的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2017 年 4 月 12 日

		理人网站	
6	关于增加创金启富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 14 日
7	关于增加北京肯特瑞为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 31 日
8	关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 28 日
9	关于增加中民财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实稳健开放式证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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

2017 年 8 月 26 日