

# 嘉实主题精选混合型证券投资基金 2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实主题精选混合型证券投资基金
基金简称	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 21 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	2,586,114,393.97 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用“主题投资策略”，从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合，并优先考虑股票类资产的配置，剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深 300 指数增长率×95%+同业存款收益率×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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010)65215588	(010)66594942

### 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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	2018 年	2017 年	2016 年

本期已实现收益	-658,069,241.20	103,019,208.72	-371,893,060.62
本期利润	-1,137,386,063.26	-31,566,678.08	-839,638,816.35
加权平均基金份额本期利润	-0.4248	-0.0129	-0.3081
本期加权平均净值利润率	-31.05%	-0.83%	-19.26%
本期基金份额净值增长率	-27.23%	0.00%	-16.68%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	373,520,629.67	1,532,219,082.01	1,539,658,865.58
期末可供分配基金份额利润	0.1444	0.5821	0.5922
期末基金资产净值	2,959,635,023.64	4,164,660,671.97	4,139,537,938.93
期末基金份额净值	1.144	1.582	1.592
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	193.29%	303.02%	303.01%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-8.33%	1.36%	-11.83%	1.56%	3.50%	-0.20%
过去六个月	-14.75%	1.39%	-13.51%	1.42%	-1.24%	-0.03%
过去一年	-27.23%	1.34%	-24.10%	1.27%	-3.13%	0.07%
过去三年	-39.37%	1.43%	-18.15%	1.12%	-21.22%	0.31%
过去五年	6.02%	1.87%	28.69%	1.46%	-22.67%	0.41%
自基金合同 生效起至今	193.29%	1.71%	121.11%	1.69%	72.18%	0.02%

注:本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数增长率×95%+同业存款收益率×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:

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

$$\text{Return}(t)=95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t)/\text{沪深 300 指数}(t-1)-1) + 5\% \times \text{同业存款日收益率}$$

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

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

嘉实主题混合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

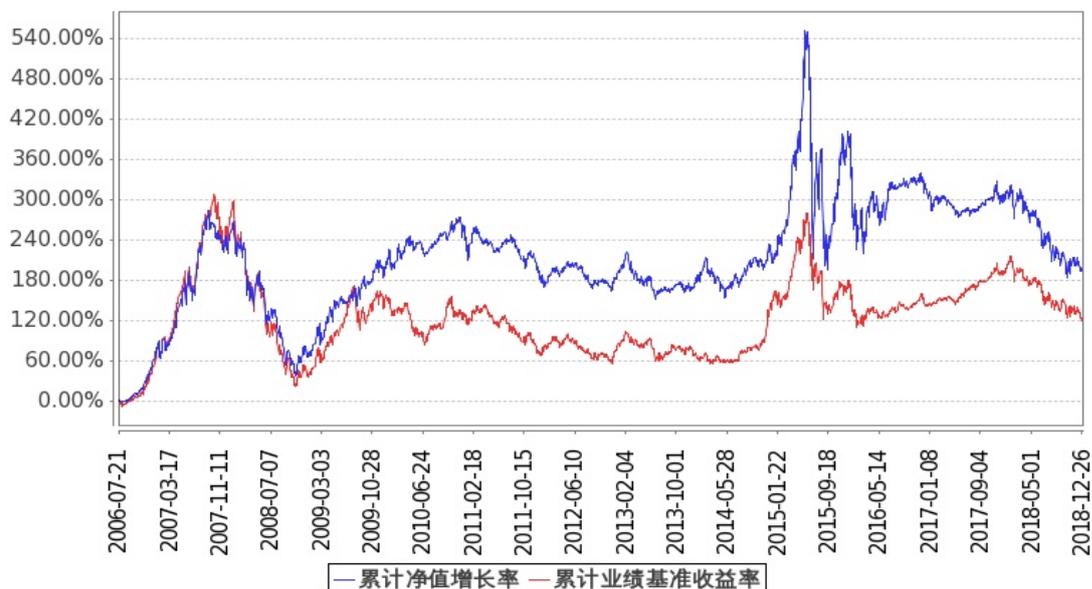


图: 嘉实主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006 年 7 月 21 日至 2018 年 12 月 31 日)

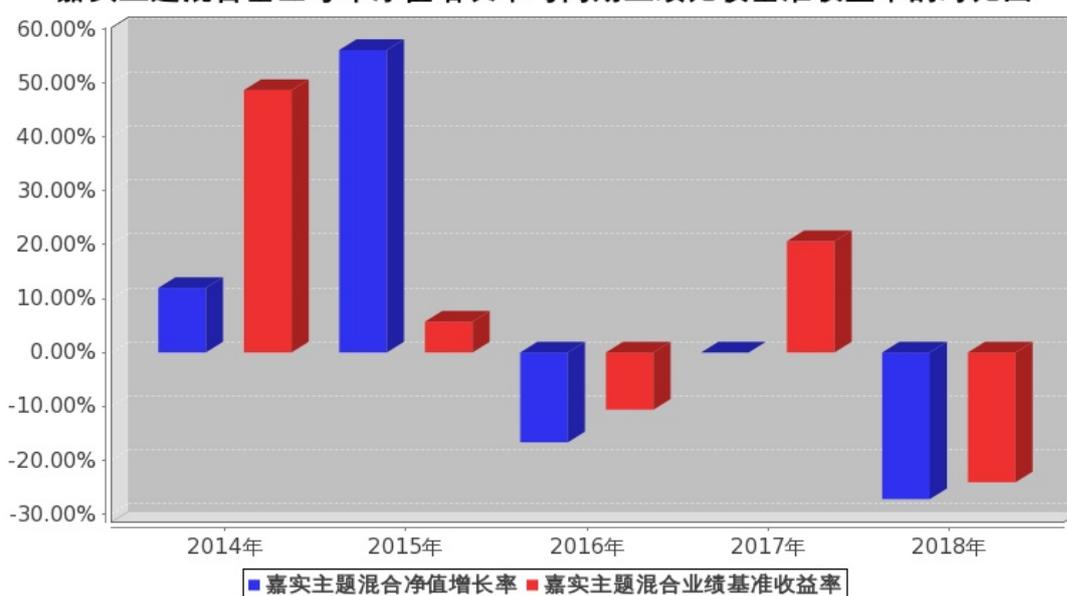
注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项

项投资比例符合基金合同第十四条（二）投资范围、（八）2. 投资组合比例限制）约定：

（1）资产配置范围为：股票资产 30%~95%，债券 0~70%，权证 0~3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；（2）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；（4）在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五；（5）持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%；（6）法律法规和基金合同规定的其他限制。

### 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

嘉实主题混合基金每年净值增长率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

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.1000	13,579,843.72	13,198,568.40	26,778,412.12	-
2017 年	0.1000	8,298,021.72	14,148,891.67	22,446,913.39	-
2016 年	0.3000	30,798,202.93	50,263,792.99	81,061,995.92	-
合计	0.5000	52,676,068.37	77,611,253.06	130,287,321.43	-

## § 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、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、144 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（QDII）混合、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）、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）、嘉实信用债券、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、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、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、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、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、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（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、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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		
方晗	本基金基金经理	2017 年 10 月 25 日	-	10 年	曾任职于 Christensen International LLC，从事资本市场咨询工作。2011 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，从事宏观策略研究工作。

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

在报告期内，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、《嘉实主题精选混合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 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。

#### 4.3.2 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，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司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，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 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 12 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

2018 年在宏观经济整体平稳下行的背景下，股票市场出现了远大于经济下行节奏的下跌，主要的下行动力为提前于上市公司盈利下行节奏的估值收缩。估值收缩背后来源于市场参与者对中美贸易争端、去杠杆政策背景下流动性收缩、民企的生存困难等非周期的经济因素予以了较为悲观的预期。全年市场是一个大面积、单边熊市，各市值段、各风格板块和各行业（除银行外）基本下跌超过 20%以上。从 4 月到 10 月的主要下跌过程中，主要指数无任何 10%以上的反弹机会，这使得 2018 年股票市场唯一奏效的组合管理策略就是低仓位+超配银行。

本组合在 2018 年年初对权益市场整体回报率的展望并不乐观，但依然低估了整体市场下跌的幅度，以及对全面的结构性机会的缺失准备不足。在 4~6 月的关键降仓防御的阶段没有充分发挥组合仓位的灵活性，有效防范净值损失。另外，在一些结构性机会的把握上，过于乐观的判断部分个股能够提供的正收益概率。由于持续单边的市场下跌，和行业层面层出不穷的公司经营、现金流风险以及行业政策风险，整个 7~10 月很少有机会对组合的结构做出补救式的调整，整体组合净值在局部的医药、航空、部分高端制造业层面承受了不小的损失。直至 10 月底~11 月初，市场出现一个月左右的反弹机会之后，才有更为充裕的空间和余地对组合结构做更为充分的调整。

#### 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 1.144 元；本报告期基金份额净值增长率为-27.23%，业绩比较基准收益率为-24.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年 A 股估值的调整，对应了在 10%左右上市公司盈利增速背景下 30%以上的估值下挫，这意味着对于中国经济中期增长趋势和所处国际环境较为悲观的预期，这种预期，由于国内外政策的潜在应对，在 2019 年继续维持不变的概率不大。2016~2017 年全球主要经济体同步复苏，两个主要引擎和动力在于中国自 2015 年以来的政策再通胀努力（房地产基建刺激+上游供给侧改革）和美国在实现充分就业后的空中加油。由于两大经济体一定程度上在过去 2 年透支了短期刺激的空间，且中美两国都略微乐观地估计了 2018 年继续增长的潜力，致使两国不约而同的在 2018 年上半年采取了更为收缩的政策立场——中国的加速金融去杠杆和美联储加速加息和缩表。贸易冲突更体现了双方政府在乐观预期情况下的政策相向而行。考虑到全球前景的迅速恶化，以及舆论压力的加大，预计中美两国在 2019 年都将采取更为务实的政策立场，中国政策立场转向稳定增长、美国则试图延缓衰退的到来。和 2018 年相比，2019 年全球的宏观背景将从“增长尚稳+政策收缩”过度到“政策积极+增长下行”的组合，这意味着股票市场的核心问题，从 2018 年的流动性收紧，转变成增长与盈利何时企稳。我们谨慎偏乐观的预期是，尽管历经波折，经济增长与企业盈利有望于 2019 年 3 季度见底企稳。在盈利周期企稳和流动性宽松背景下，与 2019 年相反，风险溢价乃至股票市场整体估值不会再提供如 2018 年一样的显著负贡献（-30%以上），而是略有一定正贡献，从而促成 2018 年股票市场整体给予一定正回报。另外，当估值区域底部企稳阶段，个股的结构性机会将较 2018 年显著增长，带给公募基金更好的通过 Alpha 机会的捕捉获取总体回报的更为平稳的环境。本基金在 2019 年将更多以区间思维，中性仓位应对市场的机会与风险，更高标准选股（除了公司所处行业的空间与增长，更多关注经营永续性、现

金流质量和资产负债表可能的风险），希望能取得理想的效果。

#### 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

(1) 本基金的基金管理人于 2018 年 1 月 15 日发布《嘉实主题精选混合型证券投资基金 2017 年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.1000 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 报告期内基金未实施利润分配。

(3) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-1,137,386,063.26 元，以及本基金基金合同（十九（二）收益分配原则）约定，因此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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.9 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”）在嘉实主题精选混合型证券投资基金（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 审计报告

嘉实主题精选混合型证券投资基金 2018 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计、注册会计师薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2019)第22702号）。

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。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	311,961,205.97	52,911,423.63
结算备付金		3,012,279.52	12,910,612.04
存出保证金		851,294.59	1,813,233.09
交易性金融资产	7.4.7.2	1,981,954,280.82	4,105,545,149.57
其中：股票投资		1,760,913,065.52	3,855,782,220.87
基金投资		-	-
债券投资		221,041,215.30	249,762,928.70

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	649,971,614.96	-
应收证券清算款		18,666,269.85	-
应收利息	7.4.7.5	6,899,334.77	5,001,557.74
应收股利		-	-
应收申购款		228,010.58	582,214.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,973,544,291.06	4,178,764,190.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,346,941.99	-
应付赎回款		662,642.41	3,970,507.29
应付管理人报酬		3,867,428.92	5,257,385.73
应付托管费		644,571.48	876,230.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,697,255.91	3,307,481.03
应交税费		4.47	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	690,422.24	691,913.64
负债合计		13,909,267.42	14,103,518.66
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,586,114,393.97	2,632,441,589.96
未分配利润	7.4.7.10	373,520,629.67	1,532,219,082.01
所有者权益合计		2,959,635,023.64	4,164,660,671.97
负债和所有者权益总计		2,973,544,291.06	4,178,764,190.63

注： 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.144 元，基金份额总额 2,586,114,393.97 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
一、收入		-1,051,636,862.71	46,890,751.20
1. 利息收入		13,477,174.83	39,908,572.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,764,435.66	5,501,788.23
债券利息收入		9,241,406.26	8,454,795.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,471,332.91	25,951,988.02
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-586,154,674.00	141,234,926.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-608,591,360.49	128,417,395.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	247,778.00	-485,980.00
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	22,188,908.49	13,303,511.02
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-479,316,822.06	-134,585,886.80
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	357,458.52	333,139.20
减：二、费用		85,749,200.55	78,457,429.28
1. 管理人报酬		55,027,042.80	57,250,778.76
2. 托管费		9,171,173.74	9,541,796.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	21,048,829.94	11,168,551.94
5. 利息支出		-	5,354.52
其中：卖出回购金融资产支出		-	5,354.52
6. 税金及附加		4.41	-
7. 其他费用	7.4.7.19	502,149.66	490,947.53
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,137,386,063.26	-31,566,678.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,137,386,063.26	-31,566,678.08

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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）	2,632,441,589.96	1,532,219,082.01	4,164,660,671.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,137,386,063.26	-1,137,386,063.26
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）	-46,327,195.99	5,466,023.04	-40,861,172.95
其中：1. 基金申购款	401,101,085.35	195,699,449.26	596,800,534.61
2. 基金赎回款	-447,428,281.34	-190,233,426.22	-637,661,707.56
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）	-	-26,778,412.12	-26,778,412.12
五、期末所有者权益（基金净值）	2,586,114,393.97	373,520,629.67	2,959,635,023.64
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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）	2,599,879,073.35	1,539,658,865.58	4,139,537,938.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,566,678.08	-31,566,678.08

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）	32,562,516.61	46,573,807.90	79,136,324.51
其中：1. 基金申购款	670,342,704.17	403,899,451.52	1,074,242,155.69
2. 基金赎回款	-637,780,187.56	-357,325,643.62	-995,105,831.18
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）	-	-22,446,913.39	-22,446,913.39
五、期末所有者权益（基金净值）	2,632,441,589.96	1,532,219,082.01	4,164,660,671.97

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：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

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一致。

### 7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 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
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	55,027,042.80	57,250,778.76
其中：支付销售机构的客户维护费	5,241,387.39	7,066,499.06

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,171,173.74	9,541,796.53

注：支付基金托管人中国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

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 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

本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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。

##### 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（2018 年 12 月 31 日）及上年度末（2017 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 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国银行股份有限公司 _活期	311,961,205.97	2,614,142.51	52,911,423.63	4,084,308.81

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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(2018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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
002120	韵达股份	2018年4月20日	2020年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	27.23	654,091	20,000,093.25	17,810,897.93	-
002120	韵达股份	2018年4月20日	2019年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	28.80	654,091	20,000,093.25	18,837,820.80	-
002341	新纶科技	2018年6月25日	2019年6月27日	非公开发行流通受限	12.95	11.00	552,847	7,159,368.65	6,081,317.00	-
002341	新纶科技	2018年6月25日	2020年6月29日	非公开发行流通受限	12.95	10.56	552,847	7,159,368.65	5,838,064.32	-
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	网下申购

注：1、以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

2、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。

3、本基金于 2018 年 4 月 20 日参与认购韵达控股股份有限公司(简称“韵达股份”)非公开发行股票，以每股 39.75 元的价格购入 1,006,294 股。韵达股份于 2018 年 8 月 16 日实施 2017 年度利润分配方案，每 10 股派 2.38 元人民币现金，同时每 10 股转增 3 股，本基金所持韵达股份股票增加 301,888 股。

#### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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（2018 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（2018 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	1,760,913,065.52	59.22
	其中：股票	1,760,913,065.52	59.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	221,041,215.30	7.43
	其中：债券	221,041,215.30	7.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	649,971,614.96	21.86

	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	314,973,485.49	10.59
8	其他各项资产	26,644,909.79	0.90
9	合计	2,973,544,291.06	100.00

## 8.2 报告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	53,137,106.00	1.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,071,397,649.61	36.20
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	76,602,617.40	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	190,409,957.11	6.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,803,412.60	10.13
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	45,828,385.00	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	23,683,792.00	0.80
S	综合	-	-
	合计	1,760,913,065.52	59.50

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601799	星宇股份	3,271,014	155,373,165.00	5.25
2	600529	山东药玻	5,614,494	106,675,386.00	3.60
3	601766	中国中车	10,351,100	93,366,922.00	3.15
4	002120	韵达股份	2,972,329	87,072,372.83	2.94
5	300383	光环新网	6,717,700	85,113,259.00	2.88

6	600570	恒生电子	1,584,320	82,352,953.60	2.78
7	002643	万润股份	7,968,700	80,643,244.00	2.72
8	600760	中航沈飞	2,567,525	71,146,117.75	2.40
9	300529	健帆生物	1,679,789	69,711,243.50	2.36
10	300059	东方财富	5,635,240	68,186,404.00	2.30

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	601799	星宇股份	188,838,854.60	4.53
2	601111	中国国航	168,845,671.53	4.05
3	600029	南方航空	166,195,830.21	3.99
4	603019	中科曙光	163,397,295.43	3.92
5	000977	浪潮信息	150,774,524.56	3.62
6	000661	长春高新	148,857,294.64	3.57
7	600276	恒瑞医药	145,592,687.49	3.50
8	600115	东方航空	138,603,427.66	3.33
9	300383	光环新网	137,034,845.30	3.29
10	300373	扬杰科技	134,067,737.71	3.22
11	002013	中航机电	130,399,858.13	3.13
12	600570	恒生电子	129,880,272.60	3.12
13	002415	海康威视	129,639,647.39	3.11
14	600348	阳泉煤业	128,204,486.70	3.08
15	300003	乐普医疗	125,293,627.86	3.01
16	300059	东方财富	124,594,847.36	2.99
17	002410	广联达	124,513,433.31	2.99
18	600760	中航沈飞	122,940,649.18	2.95
19	601766	中国中车	122,324,010.51	2.94
20	002709	天赐材料	119,247,160.47	2.86
21	000513	丽珠集团	117,842,326.70	2.83
22	000768	中航飞机	116,653,182.89	2.80
23	601328	交通银行	115,660,400.56	2.78
24	300529	健帆生物	106,223,286.91	2.55
25	600038	中直股份	102,632,998.29	2.46
26	000063	中兴通讯	98,275,056.29	2.36
27	300188	美亚柏科	92,240,027.94	2.21
28	300323	华灿光电	89,994,871.84	2.16
29	603883	老百姓	89,890,996.72	2.16

30	002643	万润股份	88,510,658.79	2.13
31	600104	上汽集团	85,309,475.53	2.05
32	600153	建发股份	84,078,168.66	2.02
33	601699	潞安环能	83,837,518.06	2.01
34	600489	中金黄金	83,669,228.90	2.01
35	002180	纳思达	83,310,152.24	2.00

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	220,626,846.19	5.30
2	002048	宁波华翔	195,363,741.92	4.69
3	000063	中兴通讯	192,327,665.67	4.62
4	601318	中国平安	185,234,918.62	4.45
5	300373	扬杰科技	181,469,137.93	4.36
6	601766	中国中车	169,773,978.05	4.08
7	300003	乐普医疗	161,117,443.12	3.87
8	600029	南方航空	154,621,234.23	3.71
9	000977	浪潮信息	146,660,186.77	3.52
10	000651	格力电器	128,349,209.97	3.08
11	002142	宁波银行	126,730,845.94	3.04
12	600036	招商银行	126,579,512.30	3.04
13	002236	大华股份	120,751,638.95	2.90
14	002013	中航机电	118,116,321.95	2.84
15	000681	视觉中国	116,995,410.86	2.81
16	600835	上海机电	116,697,497.56	2.80
17	600703	三安光电	115,931,914.03	2.78
18	601288	农业银行	114,428,045.78	2.75
19	002410	广联达	113,606,742.88	2.73
20	000001	平安银行	113,333,133.55	2.72
21	601328	交通银行	112,688,437.47	2.71
22	002415	海康威视	112,470,792.78	2.70
23	600115	东方航空	110,361,731.85	2.65
24	600585	海螺水泥	108,930,451.24	2.62
25	601088	中国神华	104,990,210.17	2.52
26	601939	建设银行	103,413,502.60	2.48
27	600522	中天科技	102,302,204.29	2.46
28	601336	新华保险	101,166,859.79	2.43
29	600763	通策医疗	101,062,581.87	2.43
30	002709	天赐材料	98,978,996.51	2.38
31	300323	华灿光电	98,871,133.82	2.37
32	600348	阳泉煤业	95,760,400.50	2.30

33	000768	中航飞机	93,156,485.69	2.24
34	601012	隆基股份	89,306,141.02	2.14
35	002027	分众传媒	87,535,798.43	2.10
36	601398	工商银行	86,767,480.15	2.08
37	600782	新钢股份	85,602,805.66	2.06
38	600438	通威股份	84,571,140.87	2.03
39	300188	美亚柏科	84,390,389.71	2.03
40	600104	上汽集团	84,287,988.86	2.02

#### 8.4.3 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	7,529,883,184.49
卖出股票收入（成交）总额	8,535,971,368.69

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

#### 8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,631,000.00	7.45
	其中：政策性金融债	220,631,000.00	7.45
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）	410,215.30	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	221,041,215.30	7.47

#### 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

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	180404	18 农发 04	800,000	80,200,000.00	2.71
2	180407	18 农发 07	500,000	50,215,000.00	1.70
3	180207	18 国开 07	500,000	50,120,000.00	1.69
4	180305	18 进出 05	400,000	40,096,000.00	1.35
5	113015	隆基转债	4,070	410,215.30	0.01

**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**

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

**8.8 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。

**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 投资组合报告附注****8.12.1**

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。

**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	金额
1	存出保证金	851,294.59
2	应收证券清算款	18,666,269.85
3	应收股利	-
4	应收利息	6,899,334.77
5	应收申购款	228,010.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,644,909.79

**8.12.4 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	113015	隆基转债	410,215.30	0.01

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002120	韵达股份	18,837,820.80	0.64	非公开发行流通受限
2	002120	韵达股份	17,810,897.93	0.60	非公开发行流通受限

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。

## § 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

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 (%)
115,297	22,430.02	634,113,603.19	24.52	1,952,000,790.78	75.48

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	569,723.72	0.02

## 9.3 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年7月21日） 基金份额总额	5,522,865,254.70
本报告期期初基金份额总额	2,632,441,589.96
本报告期基金总申购份额	401,101,085.35
减：本报告期基金总赎回份额	447,428,281.34
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	2,586,114,393.97

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

#### (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，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 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其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（特殊普通合伙）的审计费 140,000.00 元，该审计机构已连续 13 年为本基金提供审

计服务。

### 11.6 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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 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	
广发证券股份有限公司	4	2,413,607,382.02	15.08%	1,689,539.37	15.23%	-
中信证券股份有限公司	5	2,072,836,449.56	12.95%	1,414,329.18	12.75%	-
海通证券股份有限公司	2	1,514,772,131.04	9.46%	1,060,351.34	9.56%	-
华泰证券股份有限公司	4	1,298,596,208.99	8.11%	909,018.76	8.20%	-
方正证券股份有限公司	5	1,249,357,014.27	7.80%	874,551.93	7.89%	-
中泰证券股份有限公司	4	1,128,405,294.75	7.05%	789,885.08	7.12%	-
国信证券股份有限公司	1	955,068,001.00	5.97%	668,547.62	6.03%	-

长江证券 股份有限 公司	1	949,839,369.07	5.93%	664,890.91	5.99%	-
华创证券 有限责任 公司	2	646,691,598.37	4.04%	452,685.66	4.08%	-
招商证券 股份有限 公司	2	627,474,526.00	3.92%	439,235.27	3.96%	-
国金证券 股份有限 公司	2	554,300,493.26	3.46%	388,010.35	3.50%	-
天风证券 股份有限 公司	2	517,197,527.12	3.23%	326,505.37	2.94%	-
中国国际 金融股份 有限公司	3	411,998,263.35	2.57%	286,821.94	2.59%	-
安信证券 股份有限 公司	3	340,990,999.93	2.13%	238,693.73	2.15%	-
东方证券 股份有限 公司	4	289,232,546.60	1.81%	202,463.35	1.83%	-
东吴证券 股份有限 公司	3	264,836,461.29	1.65%	167,191.95	1.51%	-
西南证券 股份有限 公司	2	231,674,904.22	1.45%	146,252.47	1.32%	新增

光大证券 股份有限 公司	1	196,056,262.42	1.22%	137,239.39	1.24%	-
新时代证 券股份有 限公司	2	89,581,469.72	0.56%	56,553.15	0.51%	新增 1个
国泰君安 证券股份 有限公司	4	89,482,560.18	0.56%	62,638.39	0.56%	-
东兴证券 股份有限 公司	1	86,003,079.02	0.54%	60,202.14	0.54%	-
国元证券 股份有限 公司	1	48,686,670.98	0.30%	34,080.67	0.31%	-
中信建投 证券股份 有限公司	4	30,400,934.87	0.19%	21,281.07	0.19%	-
国海证券 股份有限 公司	2	275,386.80	0.00%	173.86	0.00%	新增
中国中投 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
天源证券 经纪有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
广州证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

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。

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。

3: 中银国际证券有限责任公司更名为中银国际证券股份有限公司。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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

2019 年 03 月 26 日