

嘉实沪港深回报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	嘉实沪港深回报混合型证券投资基金
基金简称	嘉实沪港深回报混合
基金主代码	004477
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 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	4,282,825,466.32 份
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 A 股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过跨市场资产配置，发掘内地与香港股票市场互联互通机制下的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金主要投资于 A 股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过跨市场资产配置，发掘内地与香港股票市场互联互通机制下的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	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 3 月 29 日（基金合同生效日） -2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-365,392,756.01	146,942,116.90
本期利润	-1,523,411,475.41	719,761,232.82
加权平均基金份额本期利润	-0.3311	0.2404
本期加权平均净值利润率	-29.17%	21.72%
本期基金份额净值增长率	-25.29%	26.95%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-395,205,490.33	205,235,813.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0923	0.0535
期末基金资产净值	3,887,619,975.99	4,867,560,917.08
期末基金份额净值	0.9077	1.2695
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-5.15%	26.95%

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）上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	-12.19%	1.59%	-8.46%	1.36%	-3.73%	0.23%
过去六个月	-17.77%	1.54%	-10.75%	1.18%	-7.02%	0.36%
过去一年	-25.29%	1.47%	-16.91%	1.10%	-8.38%	0.37%
自基金合同 生效起至今	-5.15%	1.28%	-2.28%	0.90%	-2.87%	0.38%

注:本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数, 是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好, 同时公信力较好的股票指数, 适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制, 以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本, 以其发行量为权数的加权平均股价指数, 是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子, 每日计算债券市场整体表现, 是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一, 适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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:

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

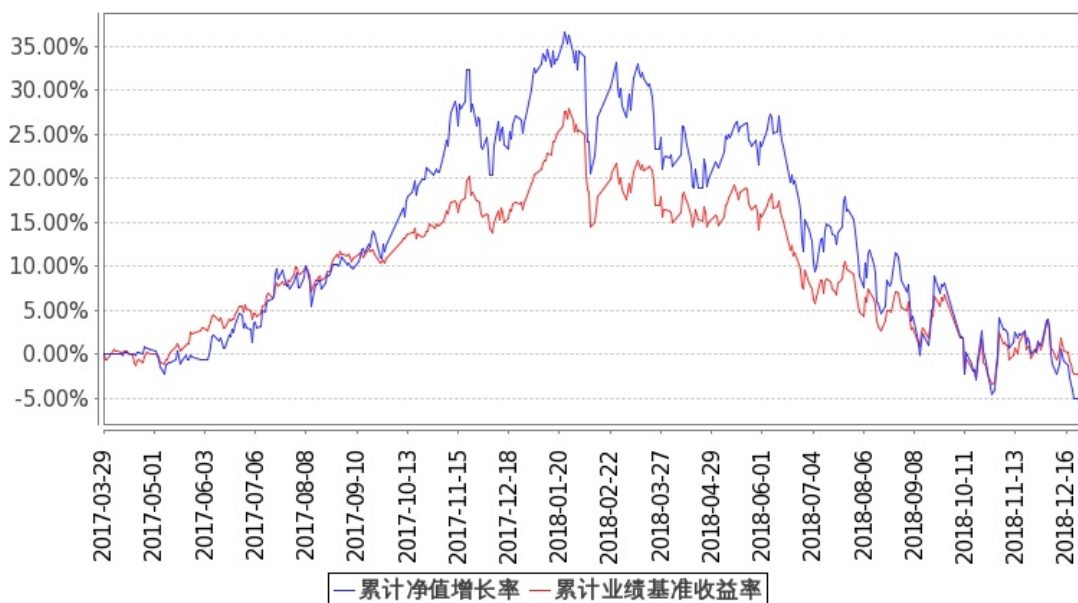
$$\text{Return}(t) = 45\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 45\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实沪港深回报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



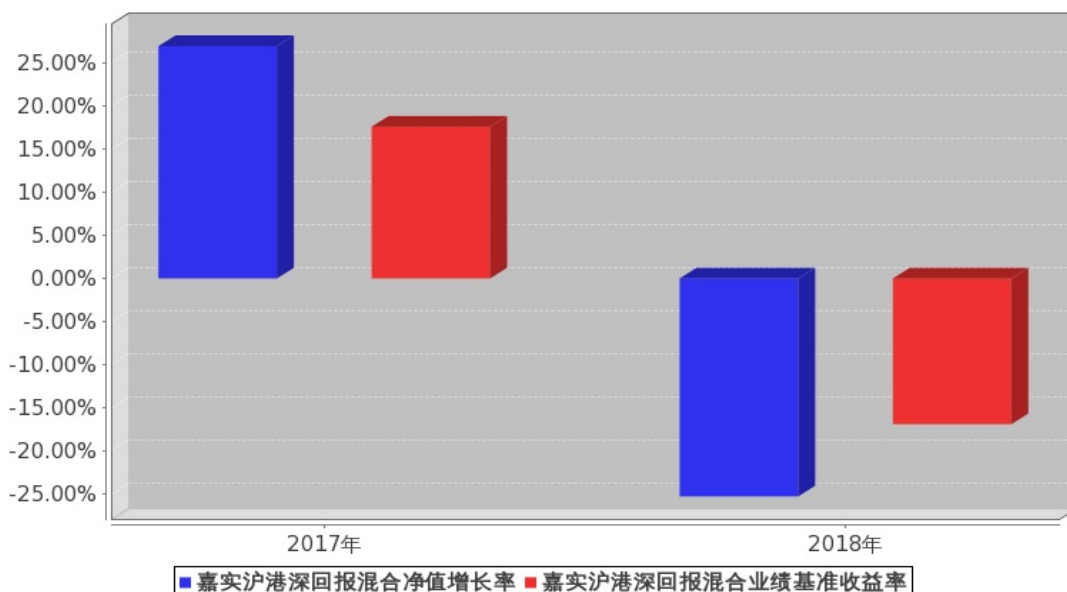
图：嘉实沪港深回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月29日至2018年12月31日)

注：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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

嘉实沪港深回报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



注:本基金基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日, 2017 年度的相关数据根据当年实际存续期 (2017 年 3 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日) 计算。

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	0.5000	193,042,735.22	37,140,458.37	230,183,193.59	-
2017 年	-	-	-	-	-
2017 年	-	-	-	-	-
合计	0.5000	193,042,735.22	37,140,458.37	230,183,193.59	-

§ 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		
张金涛	本基金、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实瑞享定期混合基金经理	2017 年 3 月 29 日	-	16 年	曾任中金公司研究部能源组组长。润晖投资高级副总裁，负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金，曾任海外研究组组长，负责海外投资策略

					以及能源原材料行业研究。现任策略组投资总监。
谭丽	本基金、嘉实价值优势混合、嘉实新消费股票、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实价值精选股票基金经理	2017 年 6 月 21 日	-	17 年	曾在北京海问投资咨询有限公司、国信证券股份有限公司及泰达荷银基金管理有限公司任研究员、基金经理助理职务。2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理。现任策略组投资总监。
张丹华	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实全球互联网股票、嘉实沪港深精选股票、嘉实文体娱乐股票、嘉实研究增强混合、嘉实前沿科技沪港深股票基金经理	2017 年 12 月 30 日	-	7 年	2011 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员。博士，具有基金从业资格。

注：（1）基金经理张金涛的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理谭丽、基金经理张丹华的任职日期是指公司作出决定后公告之日，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；（3）2019 年 1 月 10 日，本基金管理人发布《关于嘉实沪港深回报混合基金经理变更的公告》，增聘刘岚先生、王丹女士为本基金基金经理，与张金涛先生共同管理本基金，张丹华先生、谭丽女士不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实沪港深回报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 年市场在经历了年初的上涨以后急转直下，一路下行，中间没有像样的反弹。全年上证综合指数下跌 24.59%，恒生指数下跌 13.61%。2018 年的股票市场受到中美贸易摩擦、国内去杠杆以及诸多行业政策变化的轮番冲击，股价大幅下跌出现在公司业绩还未明显恶化的时候，估值收缩非常显著。板块方面，A 股只有银行股跌幅较小，有明显的超额收益。港股的公用事业、能源、电信等行业表现较为稳健。

本基金 2018 年大部分时间保持中性仓位运作，在港股的配置超过权益资产的 60%，但是并没有取得超额收益，主要因为股票中防御类的银行、公用事业、电信和能源等行业配置偏低。在港股基金超配了航空、原材料、保险等行业，在 A 股，基金持仓主要集中在家电家居、食品饮料和医药等行业。

投资策略上，基金经理以价值投资为主，优先选择低估值伴有基本面边际改善的股票，以期享受盈利和估值的双升，在股价上涨获利空间降低后及时获利了结。基金经理在深入研究的支持下，致力于挖掘领先市场的投资机会。鉴于港股市场流动性较差，交易成本较高，在买入港股股票时特别注意回避有治理问题的公司。在买入流动性较差的中小盘港股时，仓位要同时兼顾风险收益比和流动性指标。

行业选择上，基金经理相信未来很长一段时间，中国都处于经济转型期，因此产业升级和消费升级是长期发展方向，能够主动进行产业升级、符合消费升级方向的公司值得长期关注。对于周期股，基金经理的投资也是基于深入研究的基础上进行投资，主要投资于估值和盈利水平都有上升空间，处于大上升周期较低位置的股票，对于持续性存疑的周期反弹保持谨慎。

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 0.9077 元；本报告期基金份额净值增长率为-25.29%，业绩比较基准收益率为-16.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年的宏观经济格局是总需求多处承压，经济下行并无悬念，悬念在何时企稳。内外部长期因素拐点压力下，短期内上市公司盈利周期仍难以触底。积极的一面是流动性环境将更为宽

松、广谱利率进一步下行。另外，在长期风险溢价层面，随着中美贸易纠纷的常态化，即使没有明显的和解，市场在中期的表现上也将逐步钝化贸易战的边际影响。预计在 2019 年，随着流动性环境的改善，市场将告别全市场普跌的环境，盈利向下调整和估值修复均有空间，自下而上主导的个股超额收益将再次凸显。

投资策略上需要精选个股，平衡板块配置。行业上我们相对看好大金融、科技、基建、航空、汽车、制造业龙头、环保和公用事业等行业的投资机会。我们也看好消费与医药板块中长期的发展机会，但短期内估值仍有压力，压制回报率。

在港股和 A 股两个市场上，我们侧重于在港股配置相对 A 股估值更有吸引力的金融地产、航空、汽车、基建、环保和公用事业等行业，在 A 股侧重于消费、医药、制造业和科技等行业。

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，香港联合交易所，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

本基金的基金管理人于 2018 年 6 月 25 日发布《嘉实沪港深回报混合型证券投资基金 2018 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2018 年 6 月 11 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.5000 元，具体参见本报告” 7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益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”）在嘉实沪港深回报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

嘉实沪港深回报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 22767 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：嘉实沪港深回报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	上年度末
----	-----	-----	------

		2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,170,382,340.00	624,205,342.08
结算备付金		19,282,324.09	65,733,246.94
存出保证金		223,033.44	8,349,927.25
交易性金融资产	7.4.7.2	2,679,070,147.69	4,331,431,422.15
其中：股票投资		2,677,459,519.25	4,331,431,422.15
基金投资		-	-
债券投资		1,610,628.44	-
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	-	-
应收证券清算款		25,961,044.63	-
应收利息	7.4.7.5	233,184.26	102,696.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	26,846,636.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,895,152,074.11	5,056,669,270.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		-	141,047,755.84
应付赎回款		-	39,243,118.36
应付管理人报酬		5,150,832.14	5,705,346.06
应付托管费		858,472.03	950,891.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,092,779.84	1,793,546.11
应交税费		14.11	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	430,000.00	367,696.16
负债合计		7,532,098.12	189,108,353.53
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,282,825,466.32	3,834,218,403.85
未分配利润	7.4.7.10	-395,205,490.33	1,033,342,513.23
所有者权益合计		3,887,619,975.99	4,867,560,917.08

负债和所有者权益总计		3,895,152,074.11	5,056,669,270.61
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9077 元，基金份额总额 4,282,825,466.32 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实沪港深回报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 03 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-1,419,349,973.37	776,329,119.49
1. 利息收入		4,974,474.02	8,995,212.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,828,806.36	3,492,095.92
债券利息收入		1,051.28	143.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		144,616.38	5,502,973.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-278,591,015.02	182,181,109.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-370,263,711.52	147,418,224.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	305,953.79
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	91,672,696.50	34,456,931.76
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-1,158,018,719.40	572,819,115.92
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	12,285,287.03	12,333,680.88
减：二、费用		104,061,502.04	56,567,886.67
1. 管理人报酬		78,631,992.38	37,544,381.25
2. 托管费		13,105,332.06	6,257,396.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	11,841,418.38	12,406,682.63
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.43	-
7. 其他费用	7.4.7.19	482,755.79	359,425.94
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,523,411,475.41	719,761,232.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,523,411,475.41	719,761,232.82

注：本基金合同生效日为 2017 年 03 月 29 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 03 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪港深回报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）	3,834,218,403.85	1,033,342,513.23	4,867,560,917.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,523,411,475.41	-1,523,411,475.41
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）	448,607,062.47	325,046,665.44	773,653,727.91
其中：1. 基金申购款	3,771,063,600.61	1,071,980,547.51	4,843,044,148.12
2. 基金赎回款	-3,322,456,538.14	-746,933,882.07	-4,069,390,420.21
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）	-	-230,183,193.59	-230,183,193.59
五、期末所有者	4,282,825,466.32	-395,205,490.33	3,887,619,975.99

项目	上年度可比期间		
	2017 年 03 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
权益（基金净值）			
一、期初所有者权益（基金净值）	3,523,043,789.83	-	3,523,043,789.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	719,761,232.82	719,761,232.82
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）	311,174,614.02	313,581,280.41	624,755,894.43
其中：1. 基金申购款	3,732,396,571.42	731,704,229.81	4,464,100,801.23
2. 基金赎回款	-3,421,221,957.40	-418,122,949.40	-3,839,344,906.80
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）	3,834,218,403.85	1,033,342,513.23	4,867,560,917.08

注：本基金合同生效日为 2017 年 03 月 29 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 03 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日。

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3月29日(基金合同生效日)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03月29日(基金 合同生效日)至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	78,631,992.38	37,544,381.25
其中：支付销售机构的客户维护费	24,136,247.66	14,971,354.08

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03月29日(基金 合同生效日)至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,105,332.06	6,257,396.85

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3月29日(基金合同生效日)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3月29日(基金合同生效日)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03月29日(基金合同生效 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	1,170,382,340.00	4,481,455.78	624,205,342.08	3,078,855.50

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3月29日(基金合同生效日)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
002048	宁波华翔	2017年	2019年	非公开发	21.25	9.52	1,129,412	24,000,005.00	10,752,002.24	-

		12月 27日	12月 30日	行流 通受 限						
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%。

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	2,677,459,519.25	68.74
	其中:股票	2,677,459,519.25	68.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,610,628.44	0.04
	其中:债券	1,610,628.44	0.04
	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	-	-
	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	1,189,664,664.09	30.54
8	其他各项资产	26,417,262.33	0.68
9	合计	3,895,152,074.11	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,118,546,344.27 元，占基金资产净值的比例为 28.77%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 429,866,076.98 元，占基金资产净值的比例为 11.06%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	-	-
C	制造业	830,905,108.11	21.37
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	157,441,839.94	4.05
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	13,018,958.40	0.33
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	119,491,350.43	3.07
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	-	-
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	8,139,695.32	0.21
S	综合	-	-
	合计	1,129,047,098.00	29.04

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	209,365,422.73	5.39
必需消费品	124,474,426.49	3.20
能源	85,958,479.46	2.21
金融	609,897,454.02	15.69
医疗保健	42,709,668.04	1.10
工业	132,708,866.47	3.41
信息技术	64,533,339.16	1.66
原材料	64,990,189.84	1.67
房地产	186,612,375.04	4.80
公用事业	27,162,200.00	0.70
合计	1,548,412,421.25	39.83

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	966 HK	中国太平	10,885,400	205,062,430.82	5.27
2	000651	格力电器	5,612,088	200,295,420.72	5.15
3	998 HK	中信银行	38,466,000	160,430,607.80	4.13
4	3968 HK	招商银行	5,404,000	135,894,063.76	3.50
5	2333 HK	长城汽车	29,465,000	115,919,376.17	2.98
6	000963	华东医药	4,310,783	114,063,318.18	2.93
7	600660	福耀玻璃	4,278,126	97,455,710.28	2.51
8	1336 HK	新华保险	3,281,600	89,423,009.31	2.30
9	1088 HK	中国神华	5,717,000	85,958,479.46	2.21
10	2202 HK	万科企业	3,091,400	72,051,012.49	1.85

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	998 HK	中信银行	224,560,003.60	4.61
2	1398 HK	工商银行	218,861,139.00	4.50
3	2333 HK	长城汽车	216,927,975.99	4.46
4	000651	格力电器	151,903,885.11	3.12
5	600585	海螺水泥	148,461,237.57	3.05
6	000963	华东医药	114,372,931.05	2.35
7	603728	鸣志电器	111,207,958.78	2.28

8	600867	通化东宝	103,732,351.22	2.13
9	2899 HK	紫金矿业	101,432,496.67	2.08
10	600660	福耀玻璃	99,053,937.89	2.03
11	000513	丽珠集团	98,860,399.29	2.03
12	002572	索菲亚	94,301,442.07	1.94
13	753 HK	中国国航	88,235,594.10	1.81
14	175 HK	吉利汽车	76,713,791.94	1.58
15	1088 HK	中国神华	73,856,650.90	1.52
16	600309	万华化学	73,851,920.40	1.52
17	002043	兔宝宝	71,077,009.28	1.46
18	603589	口子窖	67,478,851.40	1.39
19	002048	宁波华翔	67,426,186.41	1.39
20	601155	新城控股	66,870,423.47	1.37

8.4.2 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	700 HK	腾讯控股	300,114,050.74	6.17
2	1398 HK	工商银行	167,433,904.22	3.44
3	600585	海螺水泥	165,719,148.94	3.40
4	2018 HK	瑞声科技	163,481,492.94	3.36
5	002032	苏泊尔	112,605,470.70	2.31
6	2899 HK	紫金矿业	110,349,577.63	2.27
7	2318 HK	中国平安	105,791,672.33	2.17
8	002008	大族激光	99,607,596.97	2.05
9	291 HK	华润啤酒	84,458,096.28	1.74
10	000651	格力电器	75,549,356.42	1.55
11	175 HK	吉利汽车	72,493,665.18	1.49
12	1114 HK	BRILLIANCE CHI	70,569,082.46	1.45
13	002236	大华股份	65,835,771.52	1.35
14	753 HK	中国国航	61,332,411.04	1.26
15	002258	利尔化学	58,672,467.32	1.21
16	603096	新经典	54,124,615.91	1.11
17	371 HK	北控水务集团	52,658,955.41	1.08
18	000513	丽珠集团	51,764,805.82	1.06
19	601636	旗滨集团	51,127,784.62	1.05
20	3799 HK	达利食品	50,242,545.47	1.03

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	3,671,337,351.63
卖出股票收入（成交）总额	3,797,040,795.17

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	1,610,628.44	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,610,628.44	0.04

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	128046	利尔转债	16,246	1,610,628.44	0.04

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，

或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）14 号），对中信银行股份有限公司理财资金违规缴纳土地款，自有资金融资违规缴纳土地款等违规事实，于 2018 年 11 月 19 日作出行政处罚决定，罚款 2280 万元。

2018 年 5 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银监罚决字（2018）1 号），对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实，于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金投资于“中信银行（0998.HK）”，“招商银行（3968.HK）”的决策程序说明：基于对中信银行、招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“中信银行”、“招商银行”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，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	223,033.44
2	应收证券清算款	25,961,044.63
3	应收股利	-
4	应收利息	233,184.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,417,262.33

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，本基金未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限情况。

§ 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(%)
81,464	52,573.23	1,127,868,846.50	26.33	3,154,956,619.82	73.67

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	1,151,430.68	0.03

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(2017年3月29日)基金份额总额	3,523,043,789.83
本报告期期初基金份额总额	3,834,218,403.85
本报告期基金总申购份额	3,771,063,600.61
减：本报告期基金总赎回份额	3,322,456,538.14
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	4,282,825,466.32

注：报告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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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 130,000.00 元，该审计机构已连续 2 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

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
中信建投证券股份有限公司	4	3,398,460,060.01	45.53%	2,378,919.08	45.67%	-
中信证券股份有限公司	5	900,038,264.99	12.06%	630,031.52	12.10%	-
国泰君安	2	628,292,779.97	8.42%	439,806.56	8.44%	-

证券股份 有限公司						
天风证券 股份有限 公司	2	510,657,559.48	6.84%	351,210.76	6.74%	-
海通证券 股份有限 公司	2	490,914,802.12	6.58%	343,643.45	6.60%	-
方正证券 股份有限 公司	5	401,391,132.76	5.38%	280,973.81	5.39%	-
东方证券 股份有限 公司	4	217,092,651.72	2.91%	151,965.24	2.92%	-
国信证券 股份有限 公司	1	215,486,756.37	2.89%	150,840.73	2.90%	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	181,815,681.00	2.44%	127,271.65	2.44%	-
中泰证券 股份有限 公司	4	163,624,061.77	2.19%	114,537.49	2.20%	-
东吴证券 股份有限 公司	3	150,236,737.00	2.01%	94,844.40	1.82%	-
广发证券 股份有限 公司	4	134,823,489.12	1.81%	94,377.07	1.81%	-
安信证券	3	48,801,151.84	0.65%	34,160.81	0.66%	-

股份有限 公司						
华创证券 有限责任 公司	2	19,451,596.42	0.26%	13,616.63	0.26%	-
西南证券 股份有限 公司	2	3,121,327.68	0.04%	2,184.89	0.04%	新增
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	3	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	新增 1个
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司							
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	3	-	-	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-	新增

股份有限 公司						
广州证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。

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：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-

§ 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