

嘉实服务增值行业证券投资基金 2019 年 半年度报告摘要

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 08 月 29 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 2019 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 嘉实服务增值行业证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实服务增值行业混合 |
| 基金主代码 | 070006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004 年 4 月 1 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 | 300,788,228.33 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准，在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。 |
| 投资策略 | 在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上，制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。同时，根据合适的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票，获取稳定的长期回报。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300×80%+中债总指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于中等风险证券投资基金 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|----------------|-------------------|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 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

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn |
| 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 |

§ 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(2019年01月01日-2019年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益 | 6,602,265.12 |
| 本期利润 | 312,661,946.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 1.0169 |
| 本期加权平均净值利润率 | 21.13% |
| 本期基金份额净值增长率 | 24.29% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年06月30日) |
| 期末可供分配利润 | 1,188,320,437.16 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 3.9507 |
| 期末基金资产净值 | 1,543,718,851.61 |
| 期末基金份额净值 | 5.132 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 526.14% |

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 | 4.54% | 1.36% | 4.45% | 0.92% | 0.09% | 0.44% |
| 过去三个月 | 0.81% | 1.50% | -0.77% | 1.22% | 1.58% | 0.28% |
| 过去六个月 | 24.29% | 1.35% | 21.78% | 1.23% | 2.51% | 0.12% |
| 过去一年 | 3.91% | 1.45% | 8.89% | 1.22% | -4.98% | 0.23% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年 | -22.14% | 1.17% | 19.82% | 0.88% | -41.96% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 526.14% | 1.55% | 240.69% | 1.37% | 285.45% | 0.18% |

注:本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数×80%+中债总指数×20%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制,它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票,具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势,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:

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

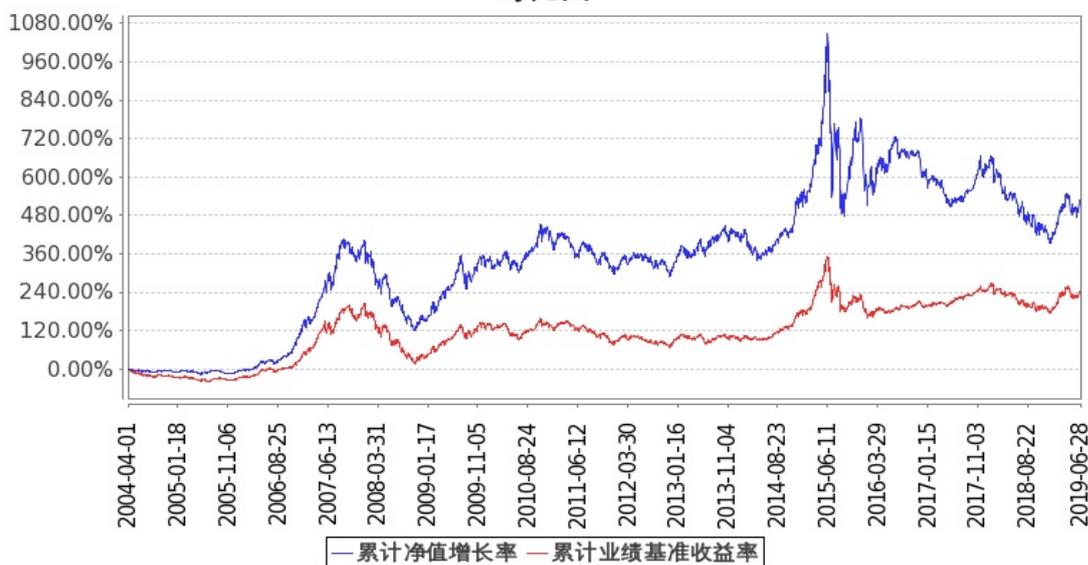
$$\text{Return}(t) = 80\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中国债券总指数}(t) / \text{中国债券总指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实服务增值行业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：嘉实服务增值行业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

(2004年4月1日至2019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十八条（二）投资范围和（七）投资组合比例限制）的约定：

- （1）在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围：股票资产 25%–95%；债券资产 0%–70%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的 80%。
- （2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%。
- （3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。
- （4）法律法规规定的其他限制。

§ 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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 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、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。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 | | |
| 李帅 | 本基金、嘉实低价策略股票基金经理 | 2017 年 11 月 23 日 | - | 9 年 | 2009 年 7 月加入嘉实基金，先后负责 A 股汽车行业、海外市场投资品、A 股机械行业研究，历任周期组组长、基金经理助理。曾在中信产业基金任制造业高级研究员。 |

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。

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、《嘉实服务增值行业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 4 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

今年上半年前半段，市场由一个低估值的起点，同时在流动性较为宽裕、财政支出前置、减税以及贸易战缓和预期的多力叠加下，大幅反弹，之后 4 月中旬高位休整，4 月下旬先是由于经济和信贷数据低于市场的乐观预期开始调整，之后又受到贸易战的影响出现较大幅度的快速下跌后阴跌了一个月，6 月出现一定的反弹。本基金在年初判断市场在低估值的位置会有一个较大幅度的反弹，因此满仓并较早对券商等高弹性板块增加了较大比例的配置，因此今年前两月的表现较好。但基金的决策失误在于，在 2 月下旬过早的判断了市场当时对经济的突然线性乐观是错误的、多种周期因素将在二季度环比减弱，因此在 2 月下旬 2800 点的位置过早的大幅减仓，虽然事后证明这个判断基本是正确的，市场也的确在 6 月又回到了 2800 点的位置，但在三四两月市场大幅上涨时基金相对表现受到了较大的压力。此外，基金做的不足的地方在于，虽然看到了外资持续买入带来的价值回归，但低估了这股力量，核心资产受到了前所未有的追捧，基金并没有在第一时间大幅加仓核心资产。基金在上半年的主要运作为，向好行业和优质公司集中，进一步降低换手率。

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 5.132 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.29%，业绩比较基准收益率为 21.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对经济的判断如下：一季度经济数据较好，主要是多方面因素的叠加，信贷投放的季节性因素、铁矿石供给端出问题同时地产和基建需求较好下的周期品供需两旺、个税调整和增值税利好下的消费品需求旺盛。以上这些因素都从二季度开始环比走弱，因此整体看，经济整体上还是处在寻底企稳的过程之中，从企业盈利和库存周期的跟踪来看，我们维持今年年底见底企稳的判断。贸易战是影响市场心理波动的一个较为重要的外部变量，但具体进程我们无法预判只能期盼双方共赢，以及尽量做到及时应对。此外，外资持续买入带来的价值回归也是市场结构的重要

变化，核心资产的价值被挖掘并被持续放大。综上，我们采取自下而上精选优质个股的策略，同时更加强调聚焦最佳盈利模式的好行业，我们维持最为看好保险行业的判断和核心持仓，该基金将长期配置保险、银行地产龙头、食品饮料、医药和计算机行业，并逐步向优质龙头集中。

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（二十三（二）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”）在嘉实服务增值行业证券投资基金（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：嘉实服务增值行业证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 14,647,357.06 | 110,671,348.18 |
| 结算备付金 | | 300,028.39 | 164,264.48 |
| 存出保证金 | | 285,780.21 | 353,906.30 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,529,968,612.23 | 1,111,685,259.80 |
| 其中：股票投资 | | 1,449,944,612.23 | 1,031,429,259.80 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 80,024,000.00 | 80,256,000.00 |
| 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 | - | 101,000,471.50 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,593,692.10 | 1,405,360.58 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 77,254.23 | 78,543.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,547,872,724.22 | 1,325,359,153.89 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | 27,325,356.66 |
| 应付赎回款 | | 941,470.58 | 394,155.97 |
| 应付管理人报酬 | | 1,831,915.33 | 1,716,983.79 |
| 应付托管费 | | 305,319.23 | 286,163.97 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 456,418.95 | 549,190.14 |
| 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 | 618,748.52 | 920,326.57 |
| 负债合计 | | 4,153,872.61 | 31,192,177.10 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 300,788,228.33 | 313,407,715.03 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,242,930,623.28 | 980,759,261.76 |
| 所有者权益合计 | | 1,543,718,851.61 | 1,294,166,976.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,547,872,724.22 | 1,325,359,153.89 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.132 元，基金份额总额 300,788,228.33 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 327,508,944.64 | -307,700,082.11 |
| 1. 利息收入 | | 2,065,132.12 | 2,851,184.68 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 556,620.06 | 755,693.37 |
| 债券利息收入 | | 1,317,084.93 | 1,942,141.36 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 191,427.13 | 153,349.95 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 19,373,769.38 | 93,921,999.16 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 8,752,489.22 | 84,458,417.73 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | -305,795.00 |
| 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 | 10,621,280.16 | 9,769,376.43 |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.16 | 306,059,681.85 | -404,495,538.22 |
| 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 | 10,361.29 | 22,272.27 |
| 减：二、费用 | | 14,846,997.67 | 18,984,453.74 |
| 1. 管理人报酬 | | 10,981,997.64 | 13,657,862.22 |
| 2. 托管费 | | 1,830,332.95 | 2,276,310.32 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 1,896,645.95 | 2,823,311.19 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 138,021.13 | 226,970.01 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 312,661,946.97 | -326,684,535.85 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 312,661,946.97 | -326,684,535.85 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 313,407,715.03 | 980,759,261.76 | 1,294,166,976.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 312,661,946.97 | 312,661,946.97 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -12,619,486.70 | -50,490,585.45 | -63,110,072.15 |

| | | | |
|--|---------------------------------|------------------|------------------|
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,786,645.87 | 14,229,106.49 | 18,015,752.36 |
| 2. 基金赎回款 | -16,406,132.57 | -64,719,691.94 | -81,125,824.51 |
| 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) | 300,788,228.33 | 1,242,930,623.28 | 1,543,718,851.61 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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) | 342,078,757.50 | 1,693,736,383.88 | 2,035,815,141.38 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -326,684,535.85 | -326,684,535.85 |
| 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) | -22,217,206.21 | -103,741,662.94 | -125,958,869.15 |
| 其中：1. 基金申购款 | 4,575,271.58 | 21,156,917.67 | 25,732,189.25 |
| 2. 基金赎回款 | -26,792,477.79 | -124,898,580.61 | -151,691,058.40 |
| 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) | - | -3,378,968.72 | -3,378,968.72 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 319,861,551.29 | 1,259,931,216.37 | 1,579,792,767.66 |

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>经雷</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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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 |

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,981,997.64 | 13,657,862.22 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,025,647.67 | 1,265,073.35 |

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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年 6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | | 1,830,332.95 | | 2,276,310.32 |

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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期内（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.4.4.2 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（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月 30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 14,647,357.06 | 543,537.86 | 148,739,863.10 | 741,569.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018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。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.5.1 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

6.4.12.1.1 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12月27日 | 2019年12月30日 | 非公开发行流通受限 | 21.25 | 10.18 | 520,000 | 11,050,000.00 | 5,293,600.00 | - |
| 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 | 28.60 | 403,900 | 9,500,011.50 | 11,551,540.00 | - |
| 300788 | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年7月5日 | 新股流通受限 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |

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。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。韵达股份于2019年6月12日实施2018年度利润分配方案,每10股派4.76元人民币现金,同时每10股转增3股。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2019年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2019年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019年6月30日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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 | 1,449,944,612.23 | 93.67 |
| | 其中：股票 | 1,449,944,612.23 | 93.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 80,024,000.00 | 5.17 |
| | 其中：债券 | 80,024,000.00 | 5.17 |
| | 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 | 14,947,385.45 | 0.97 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,956,726.54 | 0.19 |
| 9 | 合计 | 1,547,872,724.22 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 363,431.25 | 0.02 |
| C | 制造业 | 598,644,181.07 | 38.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 21,389,643.50 | 1.39 |
| F | 批发和零售业 | 99,722,190.76 | 6.46 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 47,185,192.52 | 3.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 222,949,282.76 | 14.44 |
| J | 金融业 | 299,734,628.69 | 19.42 |
| K | 房地产业 | 50,143,000.00 | 3.25 |
| L | 租赁和商务服务业 | 26,450,063.48 | 1.71 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 42,137,200.00 | 2.73 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 25,783,000.00 | 1.67 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 15,419,691.60 | 1.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,106.60 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,449,944,612.23 | 93.93 |

7.3 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 | 601318 | 中国平安 | 1,500,068 | 132,921,025.48 | 8.61 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 3,000,000 | 100,230,000.00 | 6.49 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 2,500,040 | 89,951,439.20 | 5.83 |
| 4 | 600809 | 山西汾酒 | 1,000,000 | 69,050,000.00 | 4.47 |
| 5 | 000550 | 江铃汽车 | 3,025,662 | 58,667,586.18 | 3.80 |
| 6 | 603345 | 安井食品 | 999,968 | 51,398,355.20 | 3.33 |
| 7 | 002120 | 韵达股份 | 1,560,086 | 47,185,192.52 | 3.06 |
| 8 | 600570 | 恒生电子 | 650,051 | 44,300,975.65 | 2.87 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 1,200,000 | 43,812,000.00 | 2.84 |
| 10 | 000963 | 华东医药 | 1,667,881 | 43,298,190.76 | 2.80 |

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>）的半年度报告正文。

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 | 000550 | 江铃汽车 | 54,961,676.06 | 4.25 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 39,277,515.44 | 3.03 |
| 3 | 300770 | 新媒股份 | 35,956,990.31 | 2.78 |
| 4 | 601336 | 新华保险 | 35,186,479.02 | 2.72 |
| 5 | 603589 | 口子窖 | 32,445,504.20 | 2.51 |
| 6 | 603369 | 今世缘 | 32,132,216.02 | 2.48 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 31,062,727.61 | 2.40 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 30,551,025.20 | 2.36 |
| 9 | 000581 | 威孚高科 | 28,639,865.95 | 2.21 |
| 10 | 600378 | 天科股份 | 27,393,144.37 | 2.12 |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 26,918,818.55 | 2.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 300750 | 宁德时代 | 25,256,800.66 | 1.95 |
| 13 | 300559 | 佳发教育 | 25,086,884.46 | 1.94 |
| 14 | 601211 | 国泰君安 | 25,003,441.27 | 1.93 |
| 15 | 002074 | 国轩高科 | 24,888,516.44 | 1.92 |
| 16 | 300014 | 亿纬锂能 | 24,768,958.53 | 1.91 |
| 17 | 300495 | 美尚生态 | 24,724,180.85 | 1.91 |
| 18 | 600438 | 通威股份 | 24,264,758.37 | 1.87 |
| 19 | 000776 | 广发证券 | 19,984,452.10 | 1.54 |
| 20 | 002366 | 台海核电 | 19,882,761.30 | 1.54 |

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 | 601336 | 新华保险 | 60,809,345.85 | 4.70 |
| 2 | 603108 | 润达医疗 | 41,619,239.35 | 3.22 |
| 3 | 600211 | 西藏药业 | 33,400,719.03 | 2.58 |
| 4 | 600378 | 天科股份 | 31,729,692.55 | 2.45 |
| 5 | 600835 | 上海机电 | 31,021,708.04 | 2.40 |
| 6 | 601668 | 中国建筑 | 30,735,395.01 | 2.37 |
| 7 | 601555 | 东吴证券 | 29,340,410.41 | 2.27 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 28,916,829.00 | 2.23 |
| 9 | 000650 | 仁和药业 | 27,449,695.10 | 2.12 |
| 10 | 601211 | 国泰君安 | 26,265,780.60 | 2.03 |
| 11 | 002366 | 台海核电 | 23,805,309.00 | 1.84 |
| 12 | 600837 | 海通证券 | 21,911,185.73 | 1.69 |
| 13 | 000625 | 长安汽车 | 20,963,573.20 | 1.62 |
| 14 | 000776 | 广发证券 | 20,841,166.94 | 1.61 |
| 15 | 601788 | 光大证券 | 20,507,428.00 | 1.58 |
| 16 | 600438 | 通威股份 | 18,712,406.27 | 1.45 |
| 17 | 002074 | 国轩高科 | 18,451,516.35 | 1.43 |
| 18 | 600570 | 恒生电子 | 17,333,247.26 | 1.34 |
| 19 | 600073 | 上海梅林 | 16,063,916.89 | 1.24 |
| 20 | 002025 | 航天电器 | 15,788,560.14 | 1.22 |

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 | 815,389,044.55 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 711,917,863.19 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 80,024,000.00 | 5.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,024,000.00 | 5.18 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 80,024,000.00 | 5.18 |

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 | 180209 | 18 国开 09 | 800,000 | 80,024,000.00 | 5.18 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

7.7 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。

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 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 7 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布深圳保监局二〇一八年行政处罚信息主动公开事项（十三）深保监罚〔2018〕23 号，2018 年 7 月 5 日因招商银行股份有限公司违反《中华人民共和国保险法》第一百三十一条第（一）项规定，根据该法第一百六十五条予以处罚，罚款 30 万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”的决策程序说明：基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“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，其他九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。

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 | 285,780.21 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,593,692.10 |
| 5 | 应收申购款 | 77,254.23 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,956,726.54 |

7.12.4 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。

7.12.5 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 | 11,551,540.00 | 0.75 | 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%。

§ 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 (%) |
| 39,002 | 7,712.12 | 2,508,071.79 | 0.83 | 298,280,156.54 | 99.17 |

8.2 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 | 2,633.89 | 0.00 |

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 (2004 年 4 月 1 日) 基金份额总额 | 9,033,444,910.92 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 313,407,715.03 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,786,645.87 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 16,406,132.57 |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 300,788,228.33 |

注：报告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

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。

2019 年 6 月 6 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》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（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，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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 | |
| 安信证券股份有限公司 | 3 | 327,172,563.95 | 21.45% | 229,021.76 | 21.82% | - |
| 国海证券股份有限公司 | 2 | 199,046,448.25 | 13.05% | 125,658.80 | 11.97% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 6 | 196,672,261.69 | 12.89% | 137,671.82 | 13.12% | 新增 1 个 |

| | | | | | | |
|----------------------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 国信证券股 份有限公司 | 1 | 192,597,093.52 | 12.63% | 134,817.94 | 12.85% | - |
| 华泰证券股 份有限公司 | 4 | 165,611,259.64 | 10.86% | 115,928.49 | 11.05% | - |
| 中泰证券股 份有限公司 | 4 | 134,757,877.89 | 8.83% | 94,330.98 | 8.99% | - |
| 招商证券股 份有限公司 | 2 | 106,382,417.89 | 6.97% | 74,467.56 | 7.10% | - |
| 华创证券有 限责任公司 | 2 | 72,118,007.75 | 4.73% | 50,482.61 | 4.81% | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | 3 | 67,693,060.36 | 4.44% | 42,735.47 | 4.07% | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 4 | 52,190,365.49 | 3.42% | 36,533.75 | 3.48% | - |
| 海通证券股 份有限公司 | 2 | 9,878,515.50 | 0.65% | 6,914.89 | 0.66% | - |
| 渤海证券股 份有限公司 | 1 | 1,190,981.49 | 0.08% | 833.69 | 0.08% | - |
| 华福证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|----|
| 天源证券经纪有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 天风证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券股 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|-----------|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 瑞银证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 信达证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 |
| 平安证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国元证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 英大证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股 份有限公司 | 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。

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 08 月 29 日

