嘉实沪港深精选股票型证券投资基金 2018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:2018年08月25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2018年8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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	嘉实沪港深精选股票
基金主代码	001878
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27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	5,308,950,728.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制,追求基金长期资产增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
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	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通的股票,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	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)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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	150,666,132.31
本期利润	-1,264,614,917.13
加权平均基金份额本期利润	-0.2210
本期加权平均净值利润率	-12.94%
本期基金份额净值增长率	-11.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	959,675,782.98
期末可供分配基金份额利润	0.1808
期末基金资产净值	7,854,876,601.28
期末基金份额净值	1.480
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	54.66%

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
过去一个月	-7.99%	1.62%	-5.63%	1.05%	-2.36%	0.57%
过去三个月	-6.66%	1.39%	-5.99%	0.94%	-0.67%	0.45%
过去六个月	-11.42%	1.49%	-6.89%	1.00%	-4.53%	0.49%
过去一年	7.78%	1.33%	4.05%	0.82%	3.73%	0.51%
自基金合同生效起至今	54.66%	1.08%	25.74%	0.72%	28.92%	0.36%

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:

Benchmark(0)=1000

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

Benchmark(t)=(1+Return(t))*Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,…。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

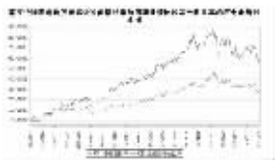

图:嘉实沪港深精选股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年5月27日至2018年6月30日)

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。

§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6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、142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300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合(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)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、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、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、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。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		
张金涛	本基金、嘉实稳盛债券、嘉实沪港深回报混合基金经理	2016年5月27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,现任海外研究组组长,负责海外投资策略以及能源原材料行业研究。
张丹华	本基金、嘉实全球互联网股票、嘉实文体娱乐股票、嘉实沪港深回报混合、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,基金经理张丹华的任职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、《嘉实沪港深精选股票型证券投资基金金合同》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

2018年上半年,中国权益市场跌幅较大。对A股市场较有代表性的沪深300指数跌12.9%,上证指数跌13.9%,香港恒生指数跌3.2%,恒生国企指数跌5.4%。发达市场跑赢新兴市场,美国标普500跌3.7%,MSCI新兴市场指数跌14.3%。

2016年四季度以来,中央决策层率先对核心城市房地产市场进行调控,而后因城施政,同时推进低线城市的棚户区改造和商品房去库存,到目前为止,达到了避免房价过快上涨和房地产库存保持在合理健康水平的政策目标。在工业部门,上一轮衰退周期中掣肘经济的产能过剩问题, 通过近两年的供给侧改革和环保要求升级中基本得以消除,上游行业和制造业产能利用率回升,现金流和盈利能力大幅改善,银行体系不良率持续改善8个季度、企业杠杆率连续5个季度下降,金融体系风险得以缓解。居民消费支出增速稳定、品质升级,多数品类呈现量价齐升态势。

目前压制权益资产估值的因素主要包括:第一,受去杠杆和资管新规的影响,18年上半年出现了一些信用违约事件,量级与16年同期相仿,大于17年同期,信用利差上升,推高了风险资产的风险溢价水平。第二,去杠杆带来了信用紧缩对基建和地产投资的抑制可能会导致经济衰退。第三,中美贸易摩擦对经济增长的负面影响,以及人民币汇率贬值可能引致的资本外流。

政策制定者已经推出减税、定向降准、扩大信贷抵押品范围等措施来对冲上述冲击,目前中国房地产库存和工业库存仍处于低位,工业企业盈利能力健康,资本开支水平较低,存款准备金率仍处于历史较高水平,政策操作空间较大。短期来看,若能维持汇率稳定、隔离信用风险,将提振权益市场的信心。

本基金2018年上半年一直保持较高仓位运作,并且在港股的配置超过权益资产的60%。在港股基金超配了保险、航空、原材料、博彩、医药等行业。在A股,基金持仓主要集中在家电、电子和医药等白马龙头。本基金在二季度减持了部分中小市值个股,在六月份降低了仓位以应对可能的市场风险和赎回压力。在六月下旬基金实施了首次分红以回报投资者。目前基金持仓的重点仍在低估值的价值股和稳定成长的消费和医药个股。

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1.480元;本报告期基金份额净值增长率为-11.42%,业绩比较基准收益率为-6.89%。

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2018年下半年,中国经济稳中求进,可能会略有下滑,失速风险低。但是我们也要看到同时实现深化改革、防范金融风险、服务实体经济三大目标,政策难度大,叠加外部贸易摩擦升级的风险,市场预期波动可能会更大。有利的方面是A股和港股经过近期的调整,估值回到了低位,权益资产的吸引力明显上升。同时我们看到上市公司的盈利增长仍然较为强劲,资产回报率继续改善,优质企业不断涌现,股票市场存在大量投资机会。总体而言,我们认为较低的估值意味着市场风险已经得到比较充分的释放,未来半年市场将在波动中前行,是中长期投资中国股票的良好时机。

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历。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22日发布《嘉实沪港深精选股票型证券投资基金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0.6760元,具体参见本报告“6.4.11 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 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”)在嘉实沪港深精选股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金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:嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,090,032,002.11	669,882,946.32
结算备付金		6,735,891.18	54,119,800.06
存出保证金		666,770.66	717,923.23
交易性金融资产	6.4.7.2	6,742,453,045.30	7,077,085,805.12
其中:股票投资		6,742,453,045.30	7,077,085,805.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	190,973.56	140,651.43
应收股利		56,447,768.05	-
应收申购款		16,549,812.32	99,468,365.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,913,076,263.18	7,901,415,491.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,436.53	88,333,092.00
应付赎回款		42,989,433.16	53,347,231.07
应付管理人报酬		10,699,839.93	9,519,494.15
应付托管费		1,783,306.66	1,586,582.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,380,941.46	3,374,655.26
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	318,704.16	523,778.09
负债合计		58,199,661.90	156,684,832.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	5,308,950,728.98	4,435,524,257.19
未分配利润	6.4.7.10	2,545,925,872.30	3,309,206,401.69
所有者权益合计		7,854,876,601.28	7,744,730,658.88
负债和所有者权益总计		7,913,076,263.18	7,901,415,491.80

注: 报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.480元,基金份额总额5,308,950,728.98份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
一、收入		-1,166,376,532.91	700,156,782.41
1.利息收入		3,639,615.18	1,849,520.05
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,639,615.18	1,826,186.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,333.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		227,113,625.32	189,720,937.16
其中:股票投资收益	6.4.7.12	129,200,397.02	156,671,048.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	97,913,228.30	33,049,888.87
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-1,415,281,049.44	497,952,386.42
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	18,151,276.03	10,633,938.78
减:二、费用		98,238,384.22	43,844,489.49
1. 管理人报酬		72,876,659.38	29,396,021.08
2. 托管费		12,146,109.88	4,899,336.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,972,598.69	9,345,106.43
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	243,016.27	204,025.06
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,264,614,917.13	656,312,292.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-1,264,614,917.13	656,312,292.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	4,435,524,257.19	3,309,206,401.69	7,744,730,658.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,264,614,917.13	-1,264,614,917.13
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)	873,426,471.79	857,736,134.73	1,731,162,606.52
其中:1.基金申购款	4,272,957,133.88	3,258,360,587.01	7,531,317,720.89
2.基金赎回款	-3,399,530,662.09	-2,400,624,452.28	-5,800,155,114.37
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)	-	-356,401,746.99	-356,401,746.99
五、期末所有者权益(基金净值)	5,308,950,728.98	2,545,925,872.30	7,854,876,601.28
项目	上年度可比期间 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)	1,188,751,926.24	181,669,954.81	1,370,421,881.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	656,312,292.92	656,312,292.92
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)	2,882,542,546.51	932,414,812.89	3,814,957,359.40
其中:1.基金申购款	4,852,369,078.37	1,634,887,050.43	6,487,256,128.80
2.基金赎回款	-1,969,826,531.86	-702,472,237.54	-2,672,298,769.40
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,071,294,472.75	1,770,397,060.62	5,841,691,533.37

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:

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

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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	72,876,659.38	29,396,021.08
其中:支付销售机构的客户维护费	16,739,415.65	4,550,874.16

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,146,109.88	4,899,336.93

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。

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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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。

6.4.4.4.2 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6月30日)及上年度末(2017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 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	1,090,032,002.11	3,174,210.34	499,790,207.97	1,433,975.56

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(2018年1月1日至2018年6月30日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017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(2018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	2018年12月28日	非公开发行流通受限	21.25	11.49	1,694,117	35,999,986.25	19,465,404.33	-
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	11.16	1,694,118	36,000,007.50	18,906,356.88	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	网下申购
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	网下申购
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	网下申购

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%。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2018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(2018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(2018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	6,742,453,045.30	85.21
	其中:股票	6,742,453,045.30	85.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,096,767,893.29	13.86
8	其他各项资产	73,855,324.59	0.93
9	合计	7,913,076,263.18	100.00

注:通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为3,829,946,092.12元,占基金资产净值的比例为48.76%; 通过深港通交易机制投资的港股公允价值为541,536,155.9元,占基金资产净值的比例为6.89%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,998,645,057.83	25.44