

嘉实研究阿尔法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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018年08月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08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	嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金
基金简称	嘉实研究阿尔法股票
基金代码	000682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	269,079,662.67份
基金合同存续期限	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自顶向下的资产配置和自底向上的个股选择相结合的策略,以追求基金资产的长期增值为目标,采用“自上而下”精选策略资产配置,通过嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金的资产配置,并通过对个股的精选,动态调整大类资产的配置比例,实现超额收益的目的。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金及货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
注册地址	北京市西城区金融大街29号	北京市东城区东大街52号
办公地址	北京市西城区金融大街29号	北京市东城区东大街52号
法定代表人	魏善春	任德奇
联系人	孙倩	王冠
联系电话	010-66093300	010-66060009
电子邮箱	service@jhfund.com	gtservice@china.com
客户服务热线	400-600-8880	95509
网址	http://www.jsfund.com	http://www.abchina.com

2.4 信息披露方式

基金基金半年度报告正文的互联网网址	http://www.jsfund.com
基金半年度报告备查地点	北京市西城区金融大街29号华润大厦9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

主要财务指标和财务指标	金额单位:人民币元
-------------	-----------

3.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期净收益	29,506,469.09
本期公允价值变动损益	-41,067,571.06
本期公允价值变动损益对本期利润的影响	-11,329
期间平均净资产收益率	-0.63%
本期基金份额净值增长率	-10.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额	72,406,180.07
期末可供分配基金份额红利	0.2677
期末基金资产净值	341,124,243.54
期末基金份额净值	1.289
3.1.3 年初数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额净值	96.27%

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

阶段	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	--------	--------------	-----	-----

过去一个月	-6.72%	1.28%	-7.80%	1.26%	2.68%
过去三个月	-7.11%	1.37%	-12.61%	1.10%	5.60%
过去六个月	-10.13%	1.87%	-16.69%	1.12%	6.73%
过去一年	-2.09%	0.91%	-12.91%	0.93%	15.00%
过去三年	-3.00%	1.54%	-33.38%	1.47%	30.38%
自基金合同生效以来	96.27%	1.44%	16.23%	1.47%	70.94%

注:本基金业绩比较基准:MSCI中国A股指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

MSCI中国A股指数是摩根士丹利资本国际公司(MSCI)编制的,它的样本选自于沪深两个证券市场,并以自由流通股量为权重来选取成份股。MSCI中国A股指数的具有广泛性、代表性、指数编制方法透明、市场波动较小、国际化等特点,能够较好的反映中国A股市场总体发展趋势。

Benchmark(1)=100%*MSCI中国A股指数收益率(1)+5%*银行活期存款税后利率

Benchmark(2)=(1+Return(t))-Benchmark(1-1)

其中t=1,2,3,...

3.2.2 自基金合同生效以来某基金份额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

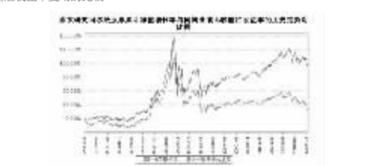


图:嘉实研究阿尔法股票基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按基金合同约定招募说明书的约定,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“第十二部分(二)投资范围(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营情况

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26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、北京亦设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人及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,具体包括嘉实多元、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、嘉实优质企业债混合、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(ODI)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面60指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实国际收益混合、嘉实H股指数(ODII-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、嘉实深证基本本120ETF、嘉实深证基本本120ETF联接、嘉实黄金(ODII-POF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心债、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、嘉实全球货币混合(ODI)、嘉实财富宝7天债券、嘉实增强收益定债债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOP)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期债ETF、嘉实中证全指中国国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意定长期债券、嘉实美国成长股票(ODII)、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、嘉实货币A/B、嘉实货币宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实新鑫货币货币、嘉实对冲套利定期混合、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、嘉实医疗保股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新创混合、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、嘉实创新驱动股票、嘉实快线货币、嘉实创机遇混合发起式、嘉实创见策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新兴产业混合、嘉实医药混合、嘉实医药混合(LOF)、嘉实成长增值混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题精选混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实策略债券、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、嘉实增值宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实平安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、嘉实新材料6个月理财债券、嘉实沪深回报混合、嘉实现金添利债券、嘉实原油(CDI-LOF)、嘉实前沿科技沪港股票、嘉实宏发债券、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、嘉实航空资产配置混合(POF)、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、嘉实复兴定期纯债债券。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、特定客户资产管理组合。

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	在本基金的基金经理任职日期	证券从业年限	说明
张勇	本基金、嘉实沪深300ETF联接基金的投资	2017年04月11日	5年	2012年7月加入嘉实基金管理有限公司,从事股票投资研究工作,先后担任光大和金牛基金基金经理。

注:(1)任职日期、离任日期是指基金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规定》的说明。

4.2 管理人人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

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,《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金合同》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约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人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,持续的技术支持,确保不同交易策略的实现,通过交易系统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,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%,合计4次,均为旗下组合波动跟踪的指数需要,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

在欧日增长放缓、全球地缘政治冲突加剧、中美贸易快速升级的背景下,上半年全球股票市场走势出现明显分化。美股在二月份冲高后持续盘整一个季度,前期纳斯达克指数创出新高;与此同时,受贸易影响最为直接的东亚市场普遍疲软,国内市场在中美贸易战、信用与广泛快速城镇化、资源错配带来的金融体系流动性收缩三大利空因素压制下连续大幅回调。板上,大小风格在二季度表现均不理想,普跌特征显著。一季度表现强势的TMT军工中后段出现快速下跌,随后受避险情绪升温叠加后期周属性凸显的大众消费和医药板块崛起,金融周期板块切换后持续保持活跃。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.289元;本报告期基金份额净值增长率为-10.13%,业绩比较基准收益率为-16.86%。

4.5 管理人人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,从宏观增长到中观景气短期仍体现出一定韧性,企业盈利全年有较大概率实现现价稳增长,目前全A股非金融估值已进入历史箱体底部区域,体现的是市场领先于基本面反应对未增长下行的担忧。伴随着产业资本开始大量回购增持,股息率/无风险利率快速提升,中报披露期来临市场重新拾起对业绩关注,前期恐慌式杀跌的趋势基本告一段落,但中期利空因素压制下,市场整体已经足够便宜,但估值仍会在不断改善预期下迎来新的探底。坚持以防守反击为例,不对仓位做激进变动,积极寻找滞涨的结构性组合

本基金始终坚持以研究的模拟组合为基本构建投资组合,坚持执行自下而上精选个股的投资策略,股票仓位保持在85%以上,行业基准组合选择在较小范围内,基于企业内在价值的细致基础研究的投资模式为获取超额收益来源的重要方式。

4.6 管理人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法规和基金合同的约定,日常估值由基金管理人及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会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,固收估值部门负责人员同时兼任基金经理、估值委员,基金估值委员会估值专业委员会会议,但不介入日常估值业务;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,中国证监会登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券基金业协会。

4.7 管理人人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配;

(2) 根据本报告3.1.1“本期利润”为-41,067,571.06元,以及本基金基金合同(十六)“(三)基金收益分配原则”的约定,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 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

在托管本基金的过程中,本基金管理人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人嘉实基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等项上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露资料符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有任何损害基金份额持有人的利益的行为。

§ 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:嘉实研究阿尔法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	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
银行存款	6.4.7.1	25,200,088.94	34,031,446.69
结算备付金		338,277.67	440,364.92
存出保证金		110,761.24	19,179.84
交易性金融资产	6.4.7.2	316,093,679.92	445,783,820.83
其中:股票投资		295,563,285.67	425,203,867.64
债券投资		20,540,394.06	20,579,953.36
基金投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
其他金融资产	6.4.7.3	-	-
应收利息	6.4.7.4	-	-
应收股利		-	-
应收申购款	6.4.7.5	472,822.18	127,946.51
递延所得税资产		249,420.17	248,585.60
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		342,526,048.02	480,821,243.26
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
应付短期融资券		-	-
应付账款		-	-
预收账款		-	-
应付职工薪酬		-	-
应交税费		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,047.29	210,822.16
所有者权益		1,400,304.48	1,746,197.74
所有者权益合计		1,400,304.48	1,746,197.74
实收资本		64.79	269,079,662.67
未分配利润	6.4.7.10	341,124,243.54	479,076,065.51
所有者权益总计		342,526,048.02	479,076,065.51
负债和所有者权益合计		342,526,048.02	480,821,243.26

注:(1)任职日期、离任日期是指基金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规定》的说明。

4.2 管理人人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

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,《嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金合同》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约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人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,持续的技术支持,确保不同交易策略的实现,通过交易系统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,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%,合计4次,均为旗下组合波动跟踪的指数需要,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

在欧日增长放缓、全球地缘政治冲突加剧、中美贸易快速升级的背景下,上半年全球股票市场走势出现明显分化。美股在二月份冲高后持续盘整一个季度,前期纳斯达克指数创出新高;与此同时,受贸易影响最为直接的东亚市场普遍疲软,国内市场在中美贸易战、信用与广泛快速城镇化、资源错配带来的金融体系流动性收缩三大利空因素压制下连续大幅回调。板上,大小风格在二季度表现均不理想,普跌特征显著。一季度表现强势的TMT军工中后段出现快速下跌,随后受避险情绪升温叠加后期周属性凸显的大众消费和医药板块崛起,金融周期板块切换后持续保持活跃。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.289元;本报告期基金份额净值增长率为-10.13%,业绩比较基准收益率为-16.86%。

4.5 管理人人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,从宏观增长到中观景气短期仍体现出一定韧性,企业盈利全年有较大概率实现现价稳增长,目前全A股非金融估值已进入历史箱体底部区域,体现的是市场领先于基本面反应对未增长下行的担忧。伴随着产业资本开始大量回购增持,股息率/无风险利率快速提升,中报披露期来临市场重新拾起对业绩关注,前期恐慌式杀跌的趋势基本告一段落,但中期利空因素压制下,市场整体已经足够便宜,但估值仍会在不断改善预期下迎来新的探底。坚持以防守反击为例,不对仓位做激进变动,积极寻找滞涨的结构性组合

本基金始终坚持以研究的模拟组合为基本构建投资组合,坚持执行自下而上精选个股的投资策略,股票仓位保持在85%以上,行业基准组合选择在较小范围内,基于企业内在价值的细致基础研究的投资模式为获取超额收益来源的重要方式。

4.6 管理人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法规和基金合同的约定,日常估值由基金管理人及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会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,固收估值部门负责人员同时兼任基金经理、估值委员,基金估值委员会估值专业委员会会议,但不介入日常估值业务;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、深圳交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中国证监会登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券基金业协会。

4.7 管理人人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配;

(2) 根据本报告3.1.1“本期利润”为-41,067,571.06元,以及本基金基金合同(十六)“(三)基金收益分配原则”的约定,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 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

在托管本基金的过程中,本基金管理人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人嘉实基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等项上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露资料符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有任何损害基金份额持有人的利益的行为。

§ 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:嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

资产	附注	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
银行存款	6.4.7.1	25,200,088.94	34,031,446.69
结算备付金		338,277.67	440,364.92
存出保证金		110,761.24	19,179.84
交易性金融资产	6.4.7.2	316,093,679.92	445,783,820.83
其中:股票投资		295,563,285.67	425,203,867.64