嘉实事件驱动股票型证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实事件驱动股票型证券投资基金
基金简称	嘉实事件驱动股票
基金主代码	001416
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,566,381,649.04份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	立足于中国特定的投资环境,将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内,在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会,通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式,选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资,力争实现投资者的长期稳定增值。
投资策略	事件性投资是主题性投资在标的股票上的具体表现形式。而相对于主题性投资相对宽泛的投资概念而言,事件性投资更加具体,与标的股票的联系更加紧密。在事件分析的投资决策框架内,事件性投资可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益,以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性,从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性,确保了超额收益的渐进式稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798

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	2016年
本期已实现收益	-931,466,256.71	-120,861,812.98	-1,078,825,573.84
本期利润	-1,970,936,239.05	110,499,535.69	-1,026,707,402.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2829	0.0113	-0.0823
本期加权平均净值利润率	-39.30%	1.37%	-10.37%
本期基金份额净值增长率	-34.36%	1.45%	-8.09%
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	-2,941,424,046.79	-1,811,389,391.46	-2,448,732,235.12
期末可供分配基金份额利润	-0.4480	-0.2271	-0.2173
期末基金资产净值	3,624,957,602.25	6,708,138,877.45	9,337,369,279.22
期末基金份额净值	0.552	0.841	0.829
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	-44.80%	-15.90%	-17.10%

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	-14.68%	1.66%	-9.51%	1.31%	-5.17%	0.35%
过去六个月	-23.01%	1.53%	-10.68%	1.20%	-12.33%	0.33%
过去一年	-34.36%	1.39%	-19.28%	1.07%	-15.08%	0.32%
过去三年	-38.80%	1.39%	-13.32%	0.94%	-25.48%	0.45%
自基金合同生效起至今	-44.80%	1.44%	-33.83%	1.24%	-10.97%	0.20%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×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。而中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

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)=80%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+20%×(中证综合债券指数(t)/中证综合债券指数(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

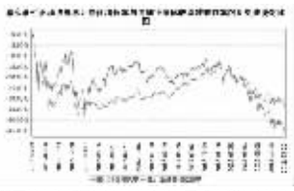
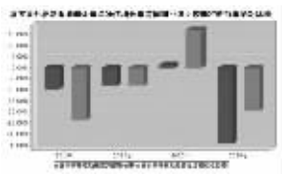


图:嘉实事件驱动股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年6月9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



注:本基金基金合同生效日为2015年6月9日,2015年度的相关数据根据当年实际存续期(2015年6月9日至2015年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§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、嘉实快钱货币、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		
张自力	本基金、嘉实美国成长股票(QDII)基金经理	2015年6月9日	-	22年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学。曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

注:(1)基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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17日,本基金管理人发布《关于新增嘉实事件驱动股票基金经理的公告》,增聘张楠先生担任本基金基金经理,与张自力先生共同管理本基金。

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、《嘉实事件驱动股票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

报告期内,A股市场受多方面影响,市场整体下行,内部驱动因素较为复杂。

2018年内较为显著的是中美贸易摩擦这一新情况,区别于以往的限制于国家层面的谈判,本次贸易摩擦已经延伸至美国对中国具体的产业政策、特定行业、特定公司的定向制裁,导致部分企业在上游产业链端、下游市场端等出现来源于美国政治干预带来的经营波动。这类风险主要出现在高科技领域,如通信、计算机等行业。

国内加强内部风险管控、并对产业升级进程加压提速,也给企业造成一定压力。一些行业政策的突发式下文事件导致相关上市公司的盈利预期出现突变,如年中的太阳能补贴政策的提前停止,使相应公司的预期净利润大幅下调,对于以预期收益为估值基础的股票市场产生了连续跌停的结果。

上半年表现较好的医药卫生和医疗器械,在年中开始持续触发各类利空的突发事件,从疫苗记录造假到体检机构造假,从带量采购新规到医保骗保,导致上半年以来盈利能力较强、市场预期确定性较强的大医疗板块持续下挫。

此外,白马股、白酒板块和白色家电等在2017年大放异彩的板块,由于风险偏好的收缩和扎堆机构的逐步撤出,估值大幅回落。另外在年初,由于小市值类上市公司高质押率和自2016年末开始的小市值风格的估值收缩和股价的持续下行,导致上市公司股东方自身的爆仓风险,小盘股在相应时间段内收到较大压制。

报告期内,本组合严格遵守基金合同的约定,基于量化模型,构建多类事件驱动子策略,包括但不限于财报业绩加速事件、扭亏事件、股东高管增持事件、股权激励事件、重大重组事件、定向增发事件、限售股解禁事件、重大诉讼和关联交易事件、企业变革事件、国企改革国资注入事件、指数成分股调整事件、宏观对冲事件,等等。本组合通过行业、风格、风险等维度的控制,进行组合优化。同时,组合根据国家政策、宏观经济周期以及对市场风格、境外资金、机构投资者的监控,积极布局市场发展方向。

组合作为股票型基金,受必须超过80%股票仓位的约束,后续将坚持主动股票型的高仓位运作,坚持整体稳健的投资风格,对各类事件驱动型策略进行相应调整和优化,进一步控制风险和波动,希望取得更好的投资效果,回馈投资者。

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0.552元;本报告期基金份额净值增长率为-34.36%,业绩比较基准收益率为-19.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,在实体经济层面,2019年面临的经济形势较为严峻,既有来自外部的政治经济压力,也有内部产业升级与突破和市场需要进一步扩大的压力,企业盈利预期可能弱于前一年度。预期国家会通过多次和多种类的方式支撑经济的稳健发展,2018年已推出结构性而非税率性的个人减税方法,19年初推出降准,预期19年还将有多次具体性的货币政策支持,以及一定的财政和行业政策扶持经济稳健。

美国针对性的限制中国的高新科技企业发展,结合我国2025科技战略规划以及国家今年反复重点强调的科技创新,在充足的人才和资金投入下,高科技含量相关领域将有更广阔的发展机会。

在经济体经历粗放扩张型发展后的产业优化的过程,尤其是经济收缩期内,各行业的龙头企业将通过技术、品牌、规模和成本优势,进一步吸收合并行业内的落后产能或小规模竞争对手,行业龙头将在经济下行压力以及产业升级驱动下进一步获取相对优势地位。我们预期各细分行业内的具有竞争优势的企业将获得相对更大的发展空间。

组合管理上,我们将继续依据事件驱动类策略,寻找主营业务稳健、有业绩超预期的成长潜力、估值相对合理并且符合组合投资目标的标的。我们进一步加强投资流程,由内部风控端和组合控制端按照"定期对照持仓与投资信号"、"实时监控买入卖出清单"这两种方式,对事件策略的信号生产、组合持仓构建、交易过程进行监控,以确保组合是严格按照既定投资策略进行的。事件类选股策略上,主要基于上市公司各类重大事件进行构造,以公司经营基本面信息为主。其中,上市公司的主营收入和净利润增速变化事件、资本市场一致预期变化事件、重大并购重组预期和公告以及重大资产交易类事件等,基于上市公司盈利能力的新信息披露或潜在增长能力来进行选股。还有诸如测度内部人员行为(如控股股东、大股东、董监高行为事件)、上市公司自身对股价的主动或被动诉求(如业绩承诺完成期限、质押和定增涉及的价格、回购计划等事件),涉入重大关联交易、涉入重大诉讼事件,以及所在行业和板块所面临的国家新行业政策对盈利的影响、国企改革等事件。

结合2018年市场面临的外部和内部行业政策情况,我们将会进一步扩展和增强风控类事件对组合下行风险的控制,利用量化框架的优势,积极调整模型,控制风险,希望取得更好的投资效果,回馈投资者。

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,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)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-1,970,936,239.05元、3.1.2"期末可供分配利润"为-2,941,424,046.79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 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,本基金托管人在对嘉实事件驱动股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,嘉实事件驱动股票型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实事件驱动股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,嘉实事件驱动股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实事件驱动股票型证券投资基金2018年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实事件驱动股票型证券投资基金 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,注册会计师许薛竞、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22703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:嘉实事件驱动股票型证券投资基金

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
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	118,262,914.04	83,248,360.21
结算备付金		312,534,794.20	518,469,942.19
存出保证金		575,675.11	45,118,991.50
交易性金融资产	7.4.7.2	3,206,299,774.41	6,077,398,780.26
其中:股票投资		2,984,818,957.55	5,737,233,802.84
基金投资		-	-
债券投资		221,480,816.86	340,164,977.42
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		29,517,761.13	267,330.29
应收利息	7.4.7.5	4,205,604.62	8,722,500.46
应收股利		-	-
应收申购款		58,423.41	145,116.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,671,454,946.92	6,733,371,021.25
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		36,743,174.28	-
应付赎回款		2,277,125.29	11,335,999.06
应付管理人报酬		4,798,432.37	8,627,201.11
应付托管费		799,738.75	1,437,866.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,438,829.78	3,380,805.89
应交税费		9.29	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	440,034.91	450,270.90
负债合计		46,497,344.67	25,232,143.80
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	6,566,381,649.04	7,974,470,160.35
未分配利润	7.4.7.10	-2,941,424,046.79	-1,266,331,282.90
所有者权益合计		3,624,957,602.25	6,708,138,877.45
负债和所有者权益总计		3,671,454,946.92	6,733,371,021.25

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.552元,基金份额总额6,566,381,649.04份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实事件驱动股票型证券投资基金

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		-1,866,996,614.08	286,745,935.09
1.利息收入		18,309,866.45	25,929,804.78
其中:存款利息收入	7.4.7.11	5,987,262.71	12,546,388.86
债券利息收入		10,901,623.87	7,178,524.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,420,979.87	6,204,891.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-845,919,075.02	28,790,145.85
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-835,663,012.78	-176,437,407.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	828,440.00	-441,600.00
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	-55,668,335.18	122,438,812.00
股利收益	7.4.7.15	44,583,832.94	83,230,341.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-1,039,469,982.34	231,361,348.67
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	82,576.83	664,635.79
减:二、费用		103,939,624.97	176,246,399.40
1. 管理人报酬		75,328,285.68	121,436,337.66
2. 托管费		12,554,714.28	20,239,389.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	15,509,826.75	34,169,223.56
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		46,297.82	-
7. 其他费用	7.4.7.19	500,500.44	401,448.62
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,970,936,239.05	110,499,535.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,970,936,239.05	110,499,535.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实事件驱动股票型证券投资基金

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)	7,974,470,160.35	-1,266,331,282.90	6,708,138,877.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,970,936,239.05	-1,970,936,239.05
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)	-1,408,088,511.31	295,843,475.16	-1,112,245,036.15
其中:1.基金申购款	78,982,418.11	-23,340,559.17	55,641,858.94
2.基金赎回款	-1,487,070,929.42	319,184,034.33	-1,167,886,895.09
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)	6,566,381,649.04	-2,941,424,046.79	3,624,957,602.25
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)	11,266,479,115.80	-1,929,109,836.58	9,337,369,279.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,499,535.69	110,499,535.69
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)	-3,292,008,955.45	552,279,017.99	-2,739,729,937.46
其中:1.基金申购款	75,942,331.13	-13,535,467.65	62,406,863.48
2.基金赎回款	-3,367,951,286.58	565,814,485.64	-2,802,136,800.94
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)	7,974,470,160.35	-1,266,331,282.90	6,708,138,877.45

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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	75,328,285.68	121,436,337.66
其中:支付销售机构的客户维护费	27,191,855.71	43,988,339.74

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	12,554,714.28	20,239,389.56

注:支付基金托管人中国工商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			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	118,262,914.04	1,637,394.50	83,248,360.21	2,156,758.98

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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日