嘉实新消费股票型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新消费股票型证券投资基金
基金简称	嘉实新消费股票
基金主代码	001044
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月23日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,958,805,522.47份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金优选消费行业股票,在严格控制投资风险的条件下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,淡化大类资产配置,主要通过消费行业子行业间的灵活配置和行业内个股的精选实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+中债总指数收益率×5%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)65215588	(010)66275853

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	42,902,550.94
本期利润	617,526,822.22
加权平均基金份额本期利润	0.2944
本期加权平均净值利润率	22.02%
本期基金份额净值增长率	24.59%
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	205,836,519.68
期末可供分配基金份额利润	0.1051
期末基金资产净值	2,838,785,843.18
期末基金份额净值	1.449
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	44.90%

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	4.24%	1.00%	5.45%	1.28%	-1.21%	-0.28%
过去三个月	3.43%	1.47%	6.71%	1.71%	-3.28%	-0.24%
过去六个月	24.59%	1.44%	40.22%	1.64%	-15.63%	-0.20%
过去一年	-0.82%	1.53%	10.42%	1.70%	-11.24%	-0.17%
过去三年	57.33%	1.18%	61.12%	1.32%	-3.79%	-0.14%
自基金合同生效起至今	44.90%	1.61%	48.71%	1.65%	-3.81%	-0.04%

注:本基金业绩比较基准为:中证内地消费主题指数收益率× 95%+中债总指数收益率× 5%

中证内地消费主题以中证800指数样本股作为样本空间,包括可选消费和主要消费,涵盖全市场消费行业股票中的较好投资标的。

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)=95%× (中证内地消费主题指数 (t)/中证内地消费主题指数(t-1)-1)+5%× (中债总指数(t) /中债总指数(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

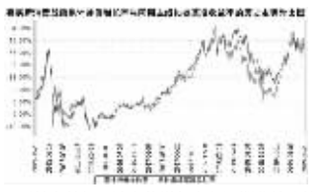

图:嘉实新消费股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年3月23日至2019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、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		
谭丽	本基金、嘉实价值优势混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实价值精选股票基金经理	2017年4月11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。

注:(1)基金经理任职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。

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、《嘉实新消费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

宏观经济方面,2季度的各项宏观数据逐月向下,压力逐步加大,同时减税降费等政策也开始落地,但政策的积极作用需要时间发挥,因此短期来看,企业盈利压力仍然较大,中美贸易关系的恶化对微观企业经营的影响比较负面,企业的谨慎反应就是缩减投资、放慢扩张,这种信心低迷下的收缩行为会对经济构成进一步下行的压力,居民消费呈现出较强的韧性,工资收入具有一定刚性,同时减税在2019年对个人的可支配收入也有正面的支撑,这都导致在低迷的经济环境下,消费领域仍然是相对的亮点,也符合我们经济转型升级的大方向。

虽然2季度资本市场整体表现不佳,但消费行业在2季度无论是绝对收益还是相对收益都表现非常优异,白酒和调味品表现尤其卓越,食品饮料为代表的必需消费品行业成为了各类投资者避险的集中地,出现显著的确定性溢价,对于阶段性高增长给予极高的估值溢价,我们认为这种投资者行为可以理解,但随着持续上涨,这类高估值、交易异常拥挤的资产,风险会显著提升,大幅降低其2-3年的收益率空间,持续高增长的难度非常大,当然不排除个别非常优秀的企业可以做到,总体来讲我们认为大多数消费个股的表现已经非常充分,我们需要更加精挑细选消费领域内的标的,消费领域非常广泛,个股众多,机会仍然很多,我们仍然会积极投资,部分标的估值较高,但确实能够通过持续的增长来消化估值,这对个股质地的要求是非常高的,我们会更加关注估值不高,市场预期较低的标的,首先立足于不败,后而求胜。

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1.449元;本报告期基金份额净值增长率为24.59%,业绩比较基准收益率为40.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前外部环境不确定性仍然较大,内部经济环境在金融供给侧改革背景下,总需求面临较大的压力,消费作为经济增长的重要支撑仍然具有很重要的战略意义,也是抵抗通胀,抵抗外部经济波动的良好资产,减税降费、增值税的下调从需求端和供给端都对激发消费需求有一定的作用,展望下半年,经济在经历了2、3季度的疲弱之后,在对冲政策、贸易摩擦常态化、减税降费的滞后效应等综合因素作用下,4季度有望逐渐企稳,这对于前期以汽车为代表的可选消费品,可能会有一个需求端的触底反弹。

我们消费组合构建的思路是各消费细分行业的优质资产,我们不希望过度集中于某一子行业,除非我们能够在该行业找到大量性价比足够有吸引力的优质资产,拉长周期看,我们更愿意买选手,当然前提是赛道没有严重问题,消费是个很大的领域,我们积极的在食品饮料、汽车、家电、珠宝首饰、消费电子产品、医药等子行业内寻找好的投资标的,如果展望下半年,我们认为可选消费品的机会更大,必需消费品的确定性溢价已经非常明显,留给我们的容错空间很小,可选消费品受制于疲弱的经济环境,无论是对业绩的预期,还是估值水平都是比较低的,一旦经济有所企稳,我们相信这类股票的吸引力会显著提升,同时我们也会加强对于战略性核心品种的深入研究,在波动中寻找投资机会。

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

根据本基金基金合同(十六(三)基金收益分配原则)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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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:嘉实新消费股票型证券投资基金

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	242,958,783.45	328,990,291.39
结算备付金		1,637,298.20	141,193.77
存出保证金		373,609.48	493,840.83
交易性金融资产	6.4.7.2	2,609,564,584.72	2,295,083,611.76
其中:股票投资		2,609,564,584.72	2,282,771,311.76
基金投资		-	-
债券投资		-	12,312,300.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	53,469.28	84,284.01
应收股利		-	-
应收申购款		888,900.05	1,508,402.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,855,476,645.18	2,626,301,624.52
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		-	13,023,177.79
应付赎回款		11,836,388.80	1,953,347.44
应付管理人报酬		3,478,886.70	3,393,765.42
应付托管费		579,814.44	565,627.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	665,207.57	325,342.49
应交税费		18.33	75.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,486.16	403,909.15
负债合计		16,690,802.00	19,665,245.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,958,805,522.47	2,240,815,191.64
未分配利润	6.4.7.10	879,980,320.71	365,821,187.32
所有者权益合计		2,838,785,843.18	2,606,636,378.96
负债和所有者权益总计		2,855,476,645.18	2,626,301,624.52

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.449元,基金份额总额1,958,805,522.47份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实新消费股票型证券投资基金

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		644,285,707.13	94,836,301.66
1.利息收入		901,546.45	1,037,058.92
其中:存款利息收入	6.4.7.11	889,930.79	1,021,167.33
债券利息收入		11,615.66	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	15,891.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		66,867,290.97	49,414,927.04
其中:股票投资收益	6.4.7.12	25,798,238.50	30,656,247.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,453,002.15	-
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	37,616,050.32	18,758,679.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	574,624,271.38	42,318,670.08
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	1,892,598.33	2,065,645.62
减:二、费用		26,758,884.91	21,901,510.86
1. 管理人报酬		20,818,195.87	16,808,423.90
2. 托管费		3,469,699.31	2,801,403.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,338,557.48	2,064,106.21
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		38.37	-
7. 其他费用	6.4.7.19	132,393.88	227,576.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		617,526,822.22	72,934,790.80
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		617,526,822.22	72,934,790.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实新消费股票型证券投资基金

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)	2,240,815,191.64	365,821,187.32	2,606,636,378.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	617,526,822.22	617,526,822.22
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)	-282,009,669.17	-103,367,688.83	-385,377,358.00
其中:1.基金申购款	414,642,441.19	151,917,109.38	566,559,550.57
2.基金赎回款	-696,652,110.36	-255,284,798.21	-951,936,908.57
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)	1,958,805,522.47	879,980,320.71	2,838,785,843.18
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)	1,215,150,498.31	483,373,276.47	1,698,523,774.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	72,934,790.80	72,934,790.80
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)	1,055,330,996.52	491,282,547.01	1,546,613,543.53
其中:1.基金申购款	1,651,053,307.29	767,749,170.41	2,418,802,477.70
2.基金赎回款	-595,722,310.77	-276,466,623.40	-872,188,934.17
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)	2,270,481,494.83	1,047,590,614.28	3,318,072,109.11

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	20,818,195.87	16,808,423.90
其中:支付销售机构的客户维护费	4,008,434.02	3,851,945.55

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 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托管费	3,469,699.31	2,801,403.99

注:支付基金托管人中国建设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(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固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(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
中国建设银行股份有限公司_活期	242,958,783.45	874,020.25	602,334,705.86	978,761.72

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	388,236	8,250,015.00	3,952,242.48	-
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%。

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	2,609,564,584.72	91.39
	其中:股票	2,609,564,584.72	91.39
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	244,596,081.65	8.57
8	其他各项资产	1,315,978.81	0.05
9	合计	2,855,476,645.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	363,431.25	0.01
C	制造业	2,056,504,513.07	72.44
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	236,476,361.76	8.33
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	46,766,211.76	1.65
J	金融业	72,698,322.36	2.56
K	房地产业	-	-
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	196,755,744.52	6.93
S	综合	-	-
	合计	2,609,564,584.72	91.93

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	603345	安井食品	5,489,701	282,170,631.40	9.94
2	000651	格力电器	4,936,987	271,534,285.00	9.57
3	600519	贵州茅台	256,645	252,538,680.00	8.90
4	000895	双汇发展	8,551,643	212,850,394.27	7.50
5	603096	新经典	3,669,016	196,732,637.92	6.93
6	603866	桃李面包	5,839,006	159,894,599.90	5.63
7	000538	云南白药	1,806,990	150,739,105.80	5.31
8	601633	长城汽车	17,204,500	142,281,215.00	5.01
9	002925	盈趣科技	3,603,607	140,576,709.07	4.95
10	000963	华东医药	5,180,849	134,494,840.04	4.74

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(%) |
|---|---|---|---