嘉实主题精选混合型证券投资基金 2017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：中国银行股份有限公司
送出日期：2018年03月28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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3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。

本报告期自2017年1月1日起至2017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	嘉实主题精选混合型证券投资基金
基金简称	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21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	2,632,441,589.96份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用“主题投资策略”，从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合，并优先考虑股票类资产的配置，剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%
风险收益特征	较高风险，较高收益。

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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	103,019,208.72	-371,893,060.62	2,975,422,144.02
本期利润	-31,566,678.08	-839,638,816.35	2,936,014,191.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0129	-0.3081	0.9040
本期加权平均净值利润率	-0.83%	-19.26%	52.85%
本期基金份额净值增长率	0.00%	-16.68%	56.15%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	1,532,219,082.01	1,539,658,865.58	2,067,179,015.15
期末可供分配基金份额利润	0.5821	0.5922	0.7753
期末基金资产净值	4,164,660,671.97	4,139,537,938.93	5,192,065,057.01
期末基金份额净值	1.582	1.592	1.947
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	303.02%	303.01%	383.69%

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	净值增长率①	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	1.47%	0.93%	4.83%	0.76%	-3.36%	0.17%
过去六个月	4.53%	0.70%	9.45%	0.66%	-4.92%	0.04%
过去一年	0.00%	0.65%	20.65%	0.60%	-20.65%	0.05%
过去三年	30.11%	2.17%	14.02%	1.60%	16.09%	0.57%
过去五年	37.86%	1.84%	57.46%	1.47%	-19.60%	0.37%
自基金合同生效起至今	303.02%	1.74%	191.33%	1.73%	111.69%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%。

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%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+5%×同业存款日收益率

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：嘉实主题混合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

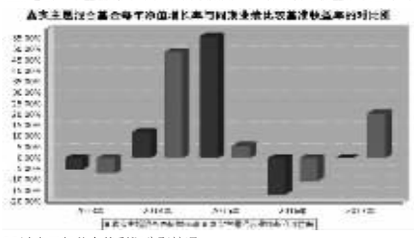
(2006年7月21日至2017年12月31日)

注：1按基金合同约定，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十四条((二)投资范围、(八)2投资组合比例限制)约定；(1)资产配置范围为：股票资产30%~95%，债券0~70%，权证0~3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；(2)持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；(3)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；(4)在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五；(5)持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的3%；(6)法律法规和基金合同规定的其他限制。

2.2017年10月25日，本基金管理人发布《关于增聘嘉实主题混合基金经理的公告》，增聘方晗先生担任本基金基金经理职务，与基金经理邹唯先生共同管理本基金。

3.2017年11月14日，本基金管理人发布《关于嘉实主题混合基金经理变更的公告》，邹唯先生不再担任本基金基金经理职务。

3.2.3过去五年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



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位：元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	0.1000	8,298,021.72	14,148,891.67	22,446,913.39	-
2016年	0.3000	30,798,202.93	50,263,792.99	81,061,995.92	-
2015年	0.2000	20,791,329.03	40,619,543.08	61,410,872.11	-
合计	0.6000	59,887,553.68	105,032,227.74	164,919,781.42	-

§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2017年12月31日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、141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)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、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、嘉实稳泰债券、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、嘉实惠泽定增混合、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、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、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、嘉实稳康纯债债券、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、嘉实稳愉债券、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、嘉实稳悦纯债债券、嘉实致博纯债债券、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。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		
方晗	本基金基金经理	2017年10月25日	-	9年	曾任职于ChristensenInternationalLLC，从事资本市场咨询工作。2011年5月加入嘉实基金管理有限公司，从事宏观策略研究工作。
邹唯	本基金、嘉实主题增强混合基金经理	2013年10月29日	2017年11月14日	15年	曾任职于长城证券研究发展中心；嘉实基金管理有限公司研究部，先后任嘉实迪安保本、嘉实稳健混合、嘉实策略混合和嘉实主题混合基金经理；上海磐信投资管理有限公司，任董事总经理。2013年7月加入嘉实基金管理有限公司，硕士研究生，具有基金从业资格，中国籍。

注：(1)任职日期、离任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

在报告期内，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、《嘉实主题精选混合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19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

2017年中国经济延续2016年以来房地产触底回升、外需改善、供给侧改革使得工业品普遍再通胀状态下的库存回升周期三大要素共同支撑的经济企稳回升周期。宏观稳定改善的背景下，上市公司盈利在2016年以来的复苏格局上加速上涨。在此背景下，上证50和沪深300为代表的消费、周期、金融蓝筹将2016年以来由业绩推升和价值重估支持的趋势加以延续。相应地中小和创业板中的估值偏高的公司仍在存量资金、监管趋严、风险偏好较低的大格局下经历持续的估值泡沫消化。

本基金前三季度对市场环境判断偏谨慎，同时持仓中大部分中小市值的公司受市场风格压力表现不如人意。四季度基金完成了基金经理变革，对原有的管理思路进行了一定调整，大幅提高了仓位水平并对持仓个股进行了调整。12月底的持仓风格以大市值金融蓝筹、部分强周期的煤炭、有色、钢铁、化工龙头、以及部分看好的中小市值制造业龙头为主。

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1.582；本报告期基金份额净值增长率为0.00%，业绩比较基准收益率为20.65%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年中国宏观经济增长将整体呈现稳中有降的格局：下行压力表现为地产投资呈现周期性的回落、基建投资受制于财政资源的空间、政府对地方政府举债能力的约束和中央政府自身刺激经济增长意愿不高而同样有所下降。在相对稳定的贡献力量中：部分制造业领域在资产负债表修复的基础上有望出现一定的产能投资回升和正常的设备更新周期；欧美经济体继续处在经济后周期的扩张阶段，稳定回升的全球增长有望为中国的出口增长贡献支持；就业市场稳定氛围下居民收入提升支撑着居民消费的稳定增长。在总需求稳中趋降的同时，过去两年过于严厉执行的行政主导下的供给侧产能收缩政策有可能出现一定调整，出于重新协调上下游利益考虑，部分工业领域的国有企业的先进产能将有可能被允许释放，从而结束连续两年PPI高企，压缩中下游利润的情况。对于股票市场而言，我们面临的将是一个经历了两年秩序重建、整体低波动率状态和机构逐渐成为主导环境下，信心逐渐回归的市场。信心回归的基础来源于度过从高速增长向中速增长最快速下滑过程、重点的产能过剩领域初步实现过剩产能出清的阶段后，中国经济在未来5年出现剧烈波动、企业盈利在深度通缩环境下集体亏损的概率大幅下降。宏观经济与企业盈利波动性的下降将极大程度上稳定市场的估值体系，构建长期股市上涨的基本环境。赚钱效应的逐步回归、楼市的冷却、资本流出途径的缺乏将让连续两年流出市场的居民财富重新被吸引回市场的概率上升。近期落地、未来逐步执行的资管产品新规，将极大动摇隐性刚兑预期下支撑的银行理财作为稳定的无风险投资渠道的吸引力。股票市场在资金流入上有望较今年进一步改善。总的来说，在主板指数尚未计入对短期盈利增长过于乐观的预期前提下，出于对中国中期系统性风险担忧的下降、企业盈利周期回落但总体仍有正增长、入市资金积极性改善这三点的积极因素有望支撑中国股票市场2018年整体继续运行在一个窄幅震荡，顶部继续抬升的格局。继2017年之后，上证综指有望继续获得一个10%左右的正收益。机会主要来源于二季度前，彼时企业盈利尚在高位、流动性环境不大可能在年初骤然收紧、美港股等主要境外市场依然在全球经济扩张和资本积极配置的乐观氛围下。从二季度开始，需要留意美联储连续加速加息过程中被重新放到聚光灯下观察的人民币汇率压力、一季度一旦食品和能源价格超预期很容易上3%的CPI压力，在通胀和贬值压力一起到来时，货币政策如何抉择颇值得玩味，年中的货币市场和流动性环境恐怕不会太支持市场的乐观氛围。

投资机会上，随着供给侧改革进入第三年，当“三去、一降、一补”中的“三去一降”(去产能、去杠杆、去库存、降成本)已经取得相当进展之后，我们看好与未来政策重点的“补短板”相契合、代表未来中国产业结构调整方向、技术上、成本上、规模上具备一定的全球竞争力、或是拥有独一无二市场优势的方向，包括但不局限于：先进制造业、高精尖的科研创新、居民消费升级相关领域、绿色生态环保这四个方向的行业和公司。

相比2017年一边倒地偏向大盘蓝筹风格，我们认为2018年的机会会更为均衡。不少小市值成长股，系统性受损于过去两年市场风格，已经进入从短期到中长期维度估值都较有吸引力的程度。相比部分很可能在2018年见顶，并出现较大亏损的被高估的蓝筹，中小板和创业板中的个股在盈利面积上可能有更多的机会。当然，这并不代表在18年年内，创业板指数会取得惊人的涨幅，但至少拉长到3年以上投资周期来看，中小板和创业板已经进入可以战略性部署进攻的阶段。

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)本基金的基金管理人于2017年10月20日发布《嘉实主题精选混合型证券投资基金2017年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为2017年9月30日，每10份基金份额发放现金红利0.1000元，具体参见本报告“7.4.11利润分配情况”。

(2)本基金的基金管理人于2018年1月15日发布《嘉实主题精选混合型证券投资基金2017年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为2017年12月31日，每10份基金份额发放现金红利0.1000元，具体参见本报告“7.4.11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，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在嘉实主题精选混合型证券投资基金(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审计报告

嘉实主题精选混合型证券投资基金2017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(2018)第22445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：嘉实主题精选混合型证券投资基金
报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	52,911,423.63	832,384,746.10
结算备付金		12,910,612.04	84,258,946.34
存出保证金		1,813,233.09	1,439,174.60
交易性金融资产	7.4.7.2	4,105,545,149.57	3,231,962,931.41
其中：股票投资		3,855,782,220.87	2,982,010,931.41
基金投资		-	-
债券投资		249,762,928.70	249,952,000.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,001,557.74	5,151,376.88
应收股利		-	-
应收申购款		582,214.56	593,067.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,178,764,190.63	4,155,790,243.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		-	3,622,081.96
应付赎回款		3,970,507.29	4,751,109.07
应付管理人报酬		5,257,385.73	5,493,569.27
应付托管费		876,230.97	915,594.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,307,481.03	761,131.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	691,913.64	708,817.62
负债合计		14,103,518.66	16,252,304.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,632,441,589.96	2,599,879,073.35
未分配利润	7.4.7.10	1,532,219,082.01	1,539,658,865.58
所有者权益合计		4,164,660,671.97	4,139,537,938.93
负债和所有者权益总计		4,178,764,190.63	4,155,790,243.30

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.582元，基金份额总额2,632,441,589.96份。

7.2利润表

会计主体：嘉实主题精选混合型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入		46,890,751.20	-752,462,870.82
1.利息收入		39,908,572.19	17,009,678.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,501,788.23	3,092,188.52
债券利息收入		8,454,795.94	2,610,884.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,951,988.02	11,306,606.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		141,234,926.61	-302,884,613.93
其中：股票投资收益	7.4.7.12	128,417,395.59	-317,963,187.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-485,980.00	-221,720.00
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	-	-
股利收益	7.4.7.15	13,303,511.02	15,300,293.90
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-134,585,886.80	-467,745,755.73
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	333,139.20	1,157,820.15
减：二、费用		78,457,429.28	87,175,945.53
1．管理人报酬		57,250,778.76	65,376,570.34
2．托管费		9,541,796.53	10,896,095.07
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.18	11,168,551.94	10,407,207.66
5．利息支出		5,354.52	-
其中：卖出回购金融资产支出		5,354.52	-
6．其他费用	7.4.7.19	490,947.53	496,072.46
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-31,566,678.08	-839,638,816.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-31,566,678.08	-839,638,816.35

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实主题精选混合型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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)	2,599,879,073.35	1,539,658,865.58	4,139,537,938.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-31,566,678.08	-31,566,678.08
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)	32,562,516.61	46,573,807.90	79,136,324.51
其中：1.基金申购款	670,342,704.17	403,899,451.52	1,074,242,155.69
2.基金赎回款	-637,780,187.56	-357,325,643.62	-995,105,831.18
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)	-	-22,446,913.39	-22,446,913.39
五、期末所有者权益(基金净值)	2,632,441,589.96	1,532,219,082.01	4,164,660,671.97
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	2,666,296,208.50	2,525,768,848.51	5,192,065,057.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-839,638,816.35	-839,638,816.35
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)	-66,417,135.15	-65,409,170.66	-131,826,305.81
其中：1.基金申购款	732,549,640.21	407,914,804.40	1,140,464,444.61
2.基金赎回款	-798,966,775.36	-473,323,975.06	-1,272,290,750.42
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)	-	-81,061,995.92	-81,061,995.92
五、期末所有者权益(基金净值)	2,599,879,073.35	1,539,658,865.58	4,139,537,938.93

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：

经营	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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	57,250,778.76	65,376,570.34
其中：支付销售机构的客户维护费	7,066,499.06	8,190,990.88

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15%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×15%/当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,541,796.53	10,896,095.07

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。

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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1日至2016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(2017年12月31日)及上年度末(2016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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国银行股份有限公司	52,911,423.63	4,084,308.81	832,384,746.10	2,327,377.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(