

# 嘉实主题新动力混合型证券投资基金 2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实主题新动力混合型证券投资基金
基金简称	嘉实主题新动力混合
基金主代码	070021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 7 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	413,867,358.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握驱动中国经济发展和结构转型所带来的主题性投资机会，并在主题的指引下精选具有高成长潜力的上市公司，力争获取长期，持续，稳定的超额收益。
投资策略	通过发掘驱动经济增长及结构转型的新兴增长动力，并以新兴增长动力所指引的主题性投资机会作为主要的投资线索，将主题投资策略融入本基金自上而下的管理流程中。（1）力求前瞻性研判驱动经济发展及转型的新兴增长动力所带来的投资主题；（2）根据投资主题的广度及数量、以及经济周期与市场因素决定大类资产配置决策，优先考虑股票类资产的配置；（3）深入挖掘有望受益于该主题的上市公司股票；（4）在综合考量投资组合的风险与收益的原则下，完成构建并定期调整投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数*95% + 上证国债指数*5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、较高收益的品种。

### 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) 65182266	(010) 66105798

### 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-3,862,529.05
本期利润	17,804,264.34
加权平均基金份额本期利润	0.0409
本期加权平均净值利润率	2.77%
本期基金份额净值增长率	2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	204,328,547.00
期末可供分配基金份额利润	0.4937
期末基金资产净值	618,195,905.87
期末基金份额净值	1.494
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	49.40%

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	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	4.77%	0.69%	4.74%	0.64%	0.03%	0.05%

过去三个月	-1.39%	0.73%	5.80%	0.59%	-7.19%	0.14%
过去六个月	2.68%	0.73%	10.24%	0.54%	-7.56%	0.19%
过去一年	-1.13%	0.72%	15.52%	0.64%	-16.65%	0.08%
过去三年	53.23%	2.16%	66.87%	1.66%	-13.64%	0.50%
自基金合同 生效起至今	49.40%	1.68%	17.42%	1.44%	31.98%	0.24%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×95%+上证国债指数×5%。

沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的 A 股市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性。

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：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

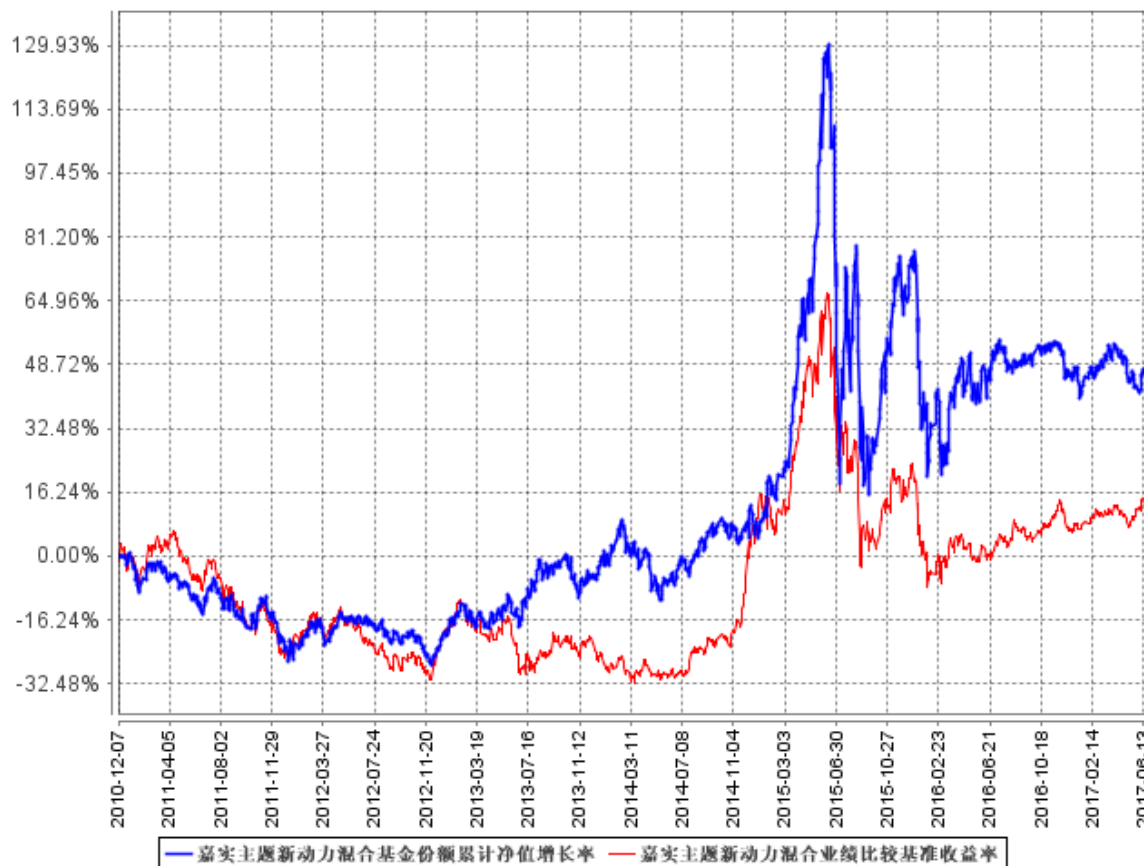
$$\text{Return}(t)=95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t)/\text{沪深 300 指数}(t-1)-1) + 5\% \times (\text{上证国债指数}(t)/\text{上证国债指数}(t-1)-1)$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

嘉实主题新动力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



图：嘉实主题新动力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

(2010 年 12 月 7 日至 2017 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“第十一部分二、投资范围和五、投资限制（二）投资组合限制）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 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 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、嘉实稳丰纯债债券、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。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		
齐海滔	本基金、嘉实医疗保健股票基金经理	2012 年 7 月 18 日	-	14 年	曾任长城证券有限责任公司行业研究员，任银华基金管理有限公司研究员、天华证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金基金经理。2011 年 4 月加盟嘉实基金管理有限公司，曾任投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

（1）任职日期、离任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合规守信情况的说明

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、《嘉实主题新动力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 6 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，经济数据改善，供给侧改革导致上游行业盈利大幅提高，深港通北上资金持续流入，A 股市场环境较为有利。5 月份之后，由于金融去杠杆的原因，流动性边际收紧，抑制市场上行空间。市场利率上行，人民币汇率贬值压力缓解，机构资金追逐高确定性的行业白马龙头公司，市场结构性特征显著，大盘股和各行业龙头显著跑赢，大盘股大幅上涨，创业板下跌明显。报告期内，上证综指上涨 2.86%，上证 50 上涨 11.5%，沪深 300 上涨 10.78%，中证 500 指数下跌 2%，中小板指数上涨 7.33%，创业板指数下跌 7.34%。

报告期内，分行业看，结构分化显著，28 个申万一级行业有 12 个取得正收益，蓝筹风格明显，机构资金和北上资金持续的追逐确定性高的行业白马龙头公司。抱团效应推动食品饮料、家

电大幅上涨，其中家电以 29.8%的正收益排名各行业第 1，食品饮料以 18%的正收益排名第 2，期初机构持仓比例较低的低估值金融也取得较大正收益，非银金融和银行分列涨幅第 3 和第 4 位，高估值行业和景气度回落的行业表现疲软，农林牧渔、纺织服装、综合、传媒、商业贸易、国防军工跌幅均超过 10%。

由于对上半年市场的判断是可能有风险，投资机会是结构性的，因此组合在报告期内保持了中等偏低的仓位，提高了低估值股票的配置比例，并逐渐降低了估值偏高个股的配置，但是，由于组合风格偏成长，组合构成以中小市值股票为主，对家电、白酒、金融并没有重点配置，因此组合在报告期业绩表现较差。组合的配置大方向依旧延续了以老龄化、产业升级和节能环保为主线的配置思路。

#### 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 1.494 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.68%，业绩比较基准收益率为 10.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的经济环境：信用周期渐行渐远，货币政策转向中性，金融去杆杠的进程远未结束，信用周期收紧的滞后效应导致经济有回落压力，社融增速的拐点在半年到 3 个季度后会对经济产生逐渐明显的滞后效应，但是在 3 季度，预计经济整体平稳；供给侧改革叠加弱库存周期，周期品价格呈现弱周期性，本轮周期行业业绩的韧性会较以往更强；CPI 预计仍将保持稳定，通胀压力不大。

综合宏观环境和市场流动性，预计 3 季度的市场行情将相对平稳，在指数相对平稳的情况下，个股继续活跃，经济数据较前期市场预期稍好，会带来周期股的估值修复机会。到了 4 季度，则需要关注经济下行、人民币汇率以及减持对市场的冲击，此外，需要关注实体经济好转带来流动性重归实体经济带来对资本市场的冲击，4 季度市场有可能会调整。目前市场整体性被低估的行业已经所剩无几，下半年行业性的机会在变小，更多的要从个股选择上下功夫。

在经济转型期的经济、政治环境下，寻找符合改革和转型主线的主题标的，是组合长期取得超额收益的最主要手段，符合这一主线的行业和个股将作为组合的核心配置长期持有，如大健康、产业升级（半导体、智能制造）、新能源汽车等，阶段性由于供给侧改革的原因，周期行业景气会超预期，会阶段性的增加周期股（主要是偏上游的周期股）的配置比例。由于我们判断下半年会有较为明显的行业内的个股分化，因此，组合会更加强调所选择标的的质量和催化因素的兑现性。

#### 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验。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（十五（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

本报告期内，本基金托管人在对嘉实主题新动力混合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，嘉实主题新动力混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实主题新动力混合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，嘉实主题新动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实主题新动力混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实主题新动力混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	162,934,188.42	79,083,731.22
结算备付金		568,141.28	634,230.15
存出保证金		180,495.11	140,238.89
交易性金融资产	6.4.7.2	455,625,890.33	586,811,388.44
其中：股票投资		455,625,890.33	566,811,388.44
基金投资		-	-
债券投资		-	20,000,000.00
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		1,198,604.06	-
应收利息	6.4.7.5	31,633.84	510,867.62
应收股利		-	-
应收申购款		13,624.87	59,653.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		620,552,577.91	667,240,109.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		822,067.92	476,698.41
应付管理人报酬		754,152.02	865,751.24
应付托管费		125,691.99	144,291.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	354,681.01	255,157.87
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	300,079.10	400,629.19
负债合计		2,356,672.04	2,142,528.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	413,867,358.87	457,226,663.80
未分配利润	6.4.7.10	204,328,547.00	207,870,917.21
所有者权益合计		618,195,905.87	665,097,581.01
负债和所有者权益总计		620,552,577.91	667,240,109.58

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.494 元，基金份额总额 413,867,358.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实主题新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		24,753,266.55	-153,773,293.16
1.利息收入		451,944.91	480,277.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	445,196.28	114,234.21
债券利息收入		6,748.63	366,043.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,583,450.76	-45,646,406.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	121,566.37	-49,191,375.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,080.00	-67,660.00
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	2,456,804.39	3,612,628.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	21,666,793.39	-108,946,417.71
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	51,077.49	339,254.14
<b>减：二、费用</b>		6,949,002.21	8,448,667.44
1. 管理人报酬		4,786,475.37	6,276,167.70
2. 托管费		797,745.89	1,046,027.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,154,325.33	914,812.65

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	210,455.62	211,659.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,804,264.34	-162,221,960.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,804,264.34	-162,221,960.60

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实主题新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	457,226,663.80	207,870,917.21	665,097,581.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,804,264.34	17,804,264.34
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)	-43,359,304.93	-21,346,634.55	-64,705,939.48
其中：1.基金申购款	19,177,496.22	9,471,596.15	28,649,092.37
2.基金赎回款	-62,536,801.15	-30,818,230.70	-93,355,031.85
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）	413,867,358.87	204,328,547.00	618,195,905.87
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016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）	638,412,496.12	472,060,861.24	1,110,473,357.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-162,221,960.60	-162,221,960.60
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）	-99,913,096.97	-34,674,277.75	-134,587,374.72
其中：1.基金申购款	146,786,272.34	59,397,984.77	206,184,257.11
2.基金赎回款	-246,699,369.31	-94,072,262.52	-340,771,631.83
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）	538,499,399.15	275,164,622.89	813,664,022.04

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：

赵学军	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

本基金在本报告期间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

### 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	4,786,475.37	6,276,167.70
其中：支付销售机构的客户维护费	1,272,624.40	1,425,091.07

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	797,745.89	1,046,027.95

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。

#### 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 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自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 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），基金管理人未运用自有资金申购、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（2017 年 6 月 30 日）及上年度末（2016 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
	中国工商银行	162,934,188.42	438,465.24	26,133,123.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 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（2017 年 6 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****6.4.5.1.1 受限证券类别：股票**

金额单位：人民币元

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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	网下申购
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	网下申购
300670	大烨	2017 年	2017	未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	网下申

	智能	6月 26日	年 7月 3日							购
300671	富满 电子	2017年 6月 27日	2017 年 7月 5日	未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	网下申 购
300672	国科 微	2017年 6月 30日	2017 年 7月 12日	未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	网下申 购
603305	旭升 股份	2017年 6月 30日	2017 年 7月 10日	未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	网下申 购
603331	百达 精工	2017年 6月 27日	2017 年 7月 5日	未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	网下申 购
603617	君禾 股份	2017年 6月 23日	2017 年 7月 3日	未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	网下申 购
603933	睿能 科技	2017年 6月 28日	2017 年 7月 6日	未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	网下申 购

#### **6.4.5.1.2 受限证券类别：债券**

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

#### **6.4.5.1.3 受限证券类别：其他**

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

#### **6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本期末（2017 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（2017 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（2017 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	455,625,890.33	73.42
	其中：股票	455,625,890.33	73.42
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	163,502,329.70	26.35
7	其他各项资产	1,424,357.88	0.23
8	合计	620,552,577.91	100.00

### 7.2 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	-	-
C	制造业	292,409,453.36	47.30
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	22,133,800.00	3.58
E	建筑业	9,718,778.24	1.57
F	批发和零售业	118,715,262.10	19.20
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	514,173.14	0.08
J	金融业	187,943.49	0.03
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	11,946,480.00	1.93
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	455,625,890.33	73.70

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	000028	国药一致	737,255	59,643,929.50	9.65
2	000963	华东医药	1,188,558	59,071,332.60	9.56
3	000513	丽珠集团	719,793	49,017,903.30	7.93
4	600529	山东药玻	1,763,607	43,331,823.99	7.01
5	002048	宁波华翔	1,433,664	29,906,231.04	4.84
6	000525	红太阳	959,994	17,865,488.34	2.89
7	600452	涪陵电力	340,000	15,527,800.00	2.51
8	002206	海利得	1,870,000	13,894,100.00	2.25
9	601799	星宇股份	312,656	13,825,648.32	2.24
10	603588	高能环境	765,800	11,946,480.00	1.93

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 (%)
1	000525	红太阳	16,226,126.84	2.44
2	002051	中工国际	15,409,089.24	2.32
3	600308	华泰股份	15,132,868.61	2.28
4	600390	五矿资本	14,786,749.45	2.22
5	603588	高能环境	13,443,459.60	2.02
6	002206	海利得	13,313,204.12	2.00
7	300602	飞荣达	12,782,938.51	1.92
8	000513	丽珠集团	12,456,764.23	1.87
9	601009	南京银行	11,809,775.74	1.78
10	600742	一汽富维	11,367,335.22	1.71
11	600420	现代制药	11,176,799.65	1.68
12	300097	智云股份	11,070,695.26	1.66
13	601800	中国交建	10,500,895.06	1.58
14	300068	南都电源	10,387,493.60	1.56
15	601600	中国铝业	10,244,561.00	1.54
16	000983	西山煤电	10,152,223.94	1.53
17	601668	中国建筑	9,824,328.09	1.48
18	300124	汇川技术	9,540,265.66	1.43
19	002074	国轩高科	9,523,055.06	1.43
20	300121	阳谷华泰	8,916,696.61	1.34

### 7.4.2 累计卖出金额前 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000547	航天发展	27,215,764.61	4.09
2	000963	华东医药	24,878,280.21	3.74
3	300232	洲明科技	22,900,154.65	3.44
4	000980	众泰汽车	17,801,617.76	2.68
5	600759	洲际油气	17,634,296.85	2.65
6	002051	中工国际	17,556,789.26	2.64
7	601058	赛轮金宇	17,488,288.04	2.63
8	002048	宁波华翔	15,348,471.06	2.31
9	000028	国药一致	14,948,195.23	2.25
10	603986	兆易创新	14,861,903.43	2.23
11	600502	安徽水利	14,677,661.57	2.21
12	600390	五矿资本	13,900,960.52	2.09
13	600308	华泰股份	13,730,537.42	2.06
14	600068	葛洲坝	13,412,372.19	2.02
15	603703	盛洋科技	13,365,647.61	2.01
16	002425	凯撒文化	12,633,312.35	1.90
17	002643	万润股份	12,340,643.86	1.86
18	601009	南京银行	11,690,509.92	1.76
19	300107	建新股份	11,184,807.71	1.68
20	002053	云南能投	10,971,586.55	1.65

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	356,806,278.54
卖出股票收入（成交）总额	489,785,216.41

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	180,495.11
2	应收证券清算款	1,198,604.06
3	应收股利	-
4	应收利息	31,633.84
5	应收申购款	13,624.87
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,424,357.88

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14,968	27,650.14	3,803,362.38	0.92%	410,063,996.49	99.08%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	188,315.70	0.05%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月7日）基金份额总额	6,316,712,603.86
本报告期期初基金份额总额	457,226,663.80
本报告期基金总申购份额	19,177,496.22
减：本报告期基金总赎回份额	62,536,801.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	413,867,358.87

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称		股票交易	应支付该券商的佣金	

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
中国国际金 融股份有限 公司	2	240,462,127.40	28.53%	168,324.20	28.54%	—
长江证券股 份有限公司	3	183,699,419.90	21.80%	128,590.67	21.80%	—
东方证券股 份有限公司	1	125,046,990.13	14.84%	87,533.56	14.84%	—
北京高华证 券有限责任 公司	2	84,799,436.20	10.06%	59,359.93	10.06%	—
招商证券股 份有限公司	2	63,689,930.53	7.56%	44,582.96	7.56%	—
中信建投证 券股份有限 公司	2	62,144,161.45	7.37%	43,500.92	7.38%	—
东兴证券股 份有限公司	1	45,374,942.06	5.38%	31,763.29	5.39%	—
光大证券股 份有限公司	1	27,446,129.66	3.26%	19,212.30	3.26%	—
中信证券股 份有限公司	2	7,763,511.84	0.92%	5,434.46	0.92%	—
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	2,332,307.45	0.28%	1,472.38	0.25%	新增
天风证券股 份有限公司	1	—	—	—	—	新增



海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日