

嘉实事件驱动股票型证券投资基金 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	10,020,015,780.48 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
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.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	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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-243,076,474.68
本期利润	-93,772,128.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0088
本期加权平均净值利润率	-1.08%
本期基金份额净值增长率	-0.97%

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	-2, 409, 318, 950. 38
期末可供分配基金份额利润	-0. 2405
期末基金资产净值	8, 222, 428, 135. 26
期末基金份额净值	0. 821
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	-17. 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	5. 53%	0. 73%	4. 19%	0. 54%	1. 34%	0. 19%
过去三个月	-0. 97%	0. 74%	4. 92%	0. 50%	-5. 89%	0. 24%
过去六个月	-0. 97%	0. 78%	8. 59%	0. 46%	-9. 56%	0. 32%
过去一年	0. 12%	0. 81%	13. 05%	0. 54%	-12. 93%	0. 27%
自基金合同生效起至今	-17. 90%	1. 58%	-24. 07%	1. 43%	6. 17%	0. 15%

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：

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

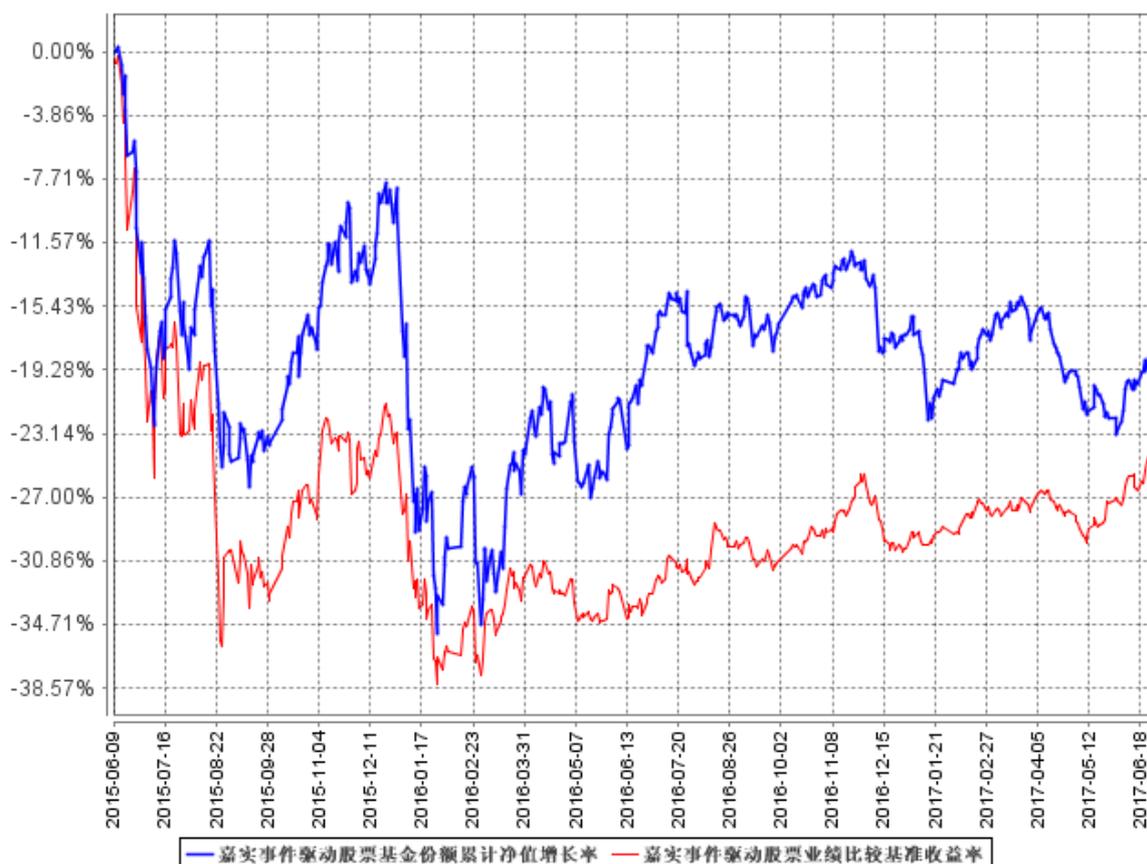
$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

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

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



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（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		
张自力	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理，人工智能投资部负	2015 年 6 月 9 日	-	21 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。

	责人				
陶羽	本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合基金经 理	2016 年 3 月 1 日	-	13 年	曾任美国高盛公司定量分析师，美国德意志资产管理公司高级定量分析师、基金经理。2008 年 8 月加盟嘉实基金，任高级定量分析师。硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）基金经理张自力的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理陶羽的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；（3）2017 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《关于嘉实事件驱动股票基金经理变更的公告》，陶羽先生不再担任本基金基金经理，由张自力先生单独管理本基金。

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，A 股市场整体上延续了自 2016 年末启动的价值股相对强势行情，高估值的中小板股票和创业板股票受到压制。

风格上，自 4 月中旬开始至 5 月末，小市值股票大幅落后于大盘股，成长股估值中枢回落明显，ROE 和红利较高的股票备受青睐，反应出投资者在上市公司盈利能力的确定性以及短期资本回报上有更强诉求。进入 6 月以来，市场除了整体上行以外，在风格方面成长相对于价值有短期反弹，并主要集中于有良好主营业绩和发展空间的高科技成长龙头股。在 6 月下旬 A 股被纳入 MSCI 指数后，相关概念个股交易放量，大盘继续走强，而对于主要依靠兑现未来期望的估值过高的成长股，市场投资热情冷淡。行业上，表现好的行业主要集中于确定性成长和估值合理的白马龙头，受陆港通北上资金推动，家电和食品饮料行业表现领先，低估值的大金融板块，尤其是大型保险公司和国有大银行强劲反弹。

我们继续依据定量模型，寻找那些业绩超预期，同时估值相对合理的标的。但报告期内市场风格变化之剧烈超出预期，之前稳定贡献超额收益的很多模型出现了较大回撤，组合表现并不如意。我们认为在市场存量博弈，经济复苏前景并不明朗的情况下，投资者对少数业绩预期稳定，盈利能力强的标的板块将会持续追捧。我们将在量化投资的框架内对模型进行相应调整，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 0.821 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.97%，业绩比较基准收益率为 8.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月中下旬公布的 6 月和二季度经济预期超出预期，其中信贷、M2、财政支出、PMI 以及需求和产出指标全面改进，GDP 增速稳定在 6.9%，与一季度持平。二季度整体的超预期，主要因为 6 月份的经济活动出现异常跳升导致，其中，6 月份工业增速大幅提升至 7.6%，三大投资需求中，房地产与基建投资超预期的调头向上，出口延续去年下半年以来的改善态势。

展望未来，7 月份进行的金融工作会议，再次确认了加强监管、限制杠杆、金融服务实体的大方向，由此金融监管收紧和货币政策收紧的趋势明确。在风险偏好受到抑制，存量资金博弈的市场，整体呈现的依然是结构性的行情特征，我们预计上证 50 和沪深 300 在震荡上行的趋势上有望持续到年底，中小板和创业板存在一定时期的间歇性短期反弹，但中长期依然整体下行，年底前后有望触及未来三年尺度上的重要底部区域。

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

(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-93,772,128.20 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-2,409,318,950.38 元、“期末可供分配基金份额利润”为-0.2405 元，“期末基金份额净值”为 0.821 元，以及本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）“3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

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事件驱动股票型证券投资基金 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：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	529,537,064.76	122,109,387.23
结算备付金		407,995,774.49	978,600,211.29
存出保证金		161,952,144.36	179,460,233.45
交易性金融资产	6.4.7.2	7,154,576,605.03	7,904,837,062.33
其中：股票投资		6,954,706,605.03	7,705,137,062.33
基金投资		-	-
债券投资		199,870,000.00	199,700,000.00
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	-	150,000,000.00
应收证券清算款		24,974,241.44	89,155,386.34
应收利息	6.4.7.5	2,809,740.08	4,311,776.67
应收股利		-	-
应收申购款		81,305.40	148,122.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,281,926,875.56	9,428,622,180.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		24,685,553.57	62,619,463.08
应付赎回款		20,541,807.11	10,277,721.88
应付管理人报酬		10,021,691.27	12,089,801.25
应付托管费		1,670,281.87	2,014,966.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,198,390.55	3,781,583.05
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	381,015.93	469,364.85
负债合计		59,498,740.30	91,252,900.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,020,015,780.48	11,266,479,115.80
未分配利润	6.4.7.10	-1,797,587,645.22	-1,929,109,836.58
所有者权益合计		8,222,428,135.26	9,337,369,279.22
负债和所有者权益总计		8,281,926,875.56	9,428,622,180.20

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.821 元，基金份额总额

10,020,015,780.48 份。

6.2 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：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 2017 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 30 日
一、收入		-6,948,307.18	-1,057,576,845.73
1.利息收入		15,109,683.54	12,201,785.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,902,572.57	12,062,455.02
债券利息收入		2,936,054.79	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,271,056.18	139,330.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-171,937,655.62	-1,222,261,489.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-280,095,026.63	-1,164,051,406.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-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	6.4.7.14	49,168,132.00	-95,484,752.00
股利收益	6.4.7.15	59,430,839.01	37,274,668.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	149,304,346.48	151,290,709.81
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	575,318.42	1,192,148.98
减：二、费用		86,823,821.02	102,653,156.19
1. 管理人报酬		64,710,964.55	72,675,698.91
2. 托管费		10,785,160.68	12,112,616.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	11,099,553.21	17,608,663.92
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	228,142.58	256,176.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-93,772,128.20	-1,160,230,001.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-93,772,128.20	-1,160,230,001.92

6.3 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：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）	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）	-	-93,772,128.20	-93,772,128.20
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）	-1,246,463,335.32	225,294,319.56	-1,021,169,015.76
其中：1.基金申购款	45,927,311.40	-8,747,413.96	37,179,897.44
2.基金赎回款	-1,292,390,646.72	234,041,733.52	-1,058,348,913.20
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)	10,020,015,780.48	-1,797,587,645.22	8,222,428,135.26
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)	13,443,424,462.07	-1,314,164,872.84	12,129,259,589.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,160,230,001.92	-1,160,230,001.92
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)	-852,984,464.18	210,317,719.63	-642,666,744.55
其中：1.基金申购款	244,576,483.38	-64,255,256.82	180,321,226.56
2.基金赎回款	-1,097,560,947.56	274,572,976.45	-822,987,971.11
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)	12,590,439,997.89	-2,264,077,155.13	10,326,362,842.76

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
基金管理人负责人

王红
主管会计工作负责人

张公允
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	64,710,964.55	72,675,698.91

其中：支付销售机构的 客户维护费	23,457,206.14	29,206,460.99
---------------------	---------------	---------------

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	10,785,160.68	12,112,616.49

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 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（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	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

	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	529,537,064.76	750,742.07	332,652,989.95	1,560,421.39

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	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	网下申购
300671	富满电子	2017年6月	2017年	未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	网下申购

		27 日	7 月 5 日							
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002356	赫美集团	2017年6月14日	重大事项停牌	25.41	-	-	2,200,633	53,449,859.25	55,918,084.53	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事项停牌	8.03	-	-	5,000,000	44,371,312.92	40,150,000.00	-
002669	康达新材	2017年4月21日	重大事项停牌	29.28	-	-	53,500	1,503,490.66	1,566,480.00	-
002675	东诚药业	2017年1月3日	重大事项停牌	14.26	2017年7月17日	12.84	3,600,000	70,787,144.96	51,336,000.00	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项停牌	25.63	2017年7月6日	23.07	260,400	5,274,928.82	6,674,052.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项停牌	15.75	2017年8月9日	14.50	654,516	7,576,518.84	10,308,627.00	-
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事项停牌	16.92	-	-	59,800	985,370.98	1,011,816.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事项停牌	21.65	2017年7月27日	19.49	413,974	14,993,480.51	8,962,537.10	-

300388	国祯 环保	2017 年 6 月 26 日	重大事 项停牌	21.15	2017 年 7 月 10 日	21.06	47,000	975,409.00	994,050.00	-
300414	中光 防雷	2017 年 4 月 28 日	重大事 项停牌	24.78	-	-	251,703	7,687,826.03	6,237,200.34	-
300440	运达 科技	2017 年 2 月 20 日	重大事 项停牌	13.12	-	-	375,600	4,894,143.47	4,927,872.00	-
300510	金冠 电气	2017 年 3 月 10 日	重大事 项停牌	34.85	2017 年 7 月 11 日	35.00	2,730	16,789.50	95,140.50	-
600057	象屿 股份	2017 年 6 月 27 日	重大事 项停牌	10.17	2017 年 7 月 4 日	10.17	4,302,220	46,999,862.98	43,753,577.40	-
601069	西部 黄金	2017 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	26.26	-	-	3,938,918	92,377,012.23	103,435,986.68	-
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重大事 项停牌	23.48	-	-	1,148,400	23,709,342.30	26,964,432.00	-
603501	韦尔 股份	2017 年 6 月 5 日	重大事 项停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

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	6,954,706,605.03	83.97
	其中：股票	6,954,706,605.03	83.97
2	固定收益投资	199,870,000.00	2.41
	其中：债券	199,870,000.00	2.41
	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	937,532,839.25	11.32
7	其他各项资产	189,817,431.28	2.29
8	合计	8,281,926,875.56	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	18,179,740.00	0.22
B	采矿业	368,165,656.20	4.48
C	制造业	5,069,977,426.40	61.66
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	115,805,369.72	1.41
E	建筑业	163,326,124.00	1.99
F	批发和零售业	161,606,951.43	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	145,631,464.27	1.77

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,515,474.90	1.82
J	金融业	417,963,982.45	5.08
K	房地产业	241,687,404.06	2.94
L	租赁和商务服务业	88,206,957.60	1.07
M	科学研究和技术服务业	915,530.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	13,724,524.00	0.17
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	6,954,706,605.03	84.58

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	300136	信维通信	5,683,695	227,461,473.90	2.77
2	300296	利亚德	12,000,000	225,600,000.00	2.74
3	002217	合力泰	12,613,092	124,617,348.96	1.52
4	600519	贵州茅台	240,200	113,338,370.00	1.38
5	300393	中来股份	1,896,663	104,335,431.63	1.27
6	000651	格力电器	2,520,000	103,748,400.00	1.26
7	601069	西部黄金	3,938,918	103,435,986.68	1.26
8	002241	歌尔股份	5,005,284	96,501,875.52	1.17
9	000333	美的集团	2,221,096	95,595,971.84	1.16
10	600887	伊利股份	4,420,461	95,437,752.99	1.16

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	600519	贵州茅台	94,405,449.90	1.01
2	002241	歌尔股份	85,512,206.42	0.92
3	000858	五粮液	72,871,052.05	0.78
4	000423	东阿阿胶	71,960,102.99	0.77
5	600068	葛洲坝	67,802,331.83	0.73
6	600436	片仔癀	65,854,201.15	0.71
7	600036	招商银行	60,030,938.16	0.64
8	601288	农业银行	59,605,329.76	0.64
9	002419	天虹股份	56,772,225.69	0.61
10	601166	兴业银行	56,370,207.87	0.60
11	600298	安琪酵母	52,139,558.73	0.56
12	002415	海康威视	51,605,588.43	0.55
13	001979	招商蛇口	49,834,433.90	0.53
14	600016	民生银行	49,771,687.98	0.53
15	002032	苏泊尔	48,588,295.35	0.52
16	002146	荣盛发展	48,502,716.46	0.52
17	601636	旗滨集团	48,020,682.21	0.51
18	000651	格力电器	47,746,943.58	0.51
19	000952	广济药业	47,020,346.92	0.50
20	600057	象屿股份	46,999,862.98	0.50

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	300145	中金环境	79,226,031.37	0.85
2	300415	伊之密	79,026,433.02	0.85
3	300482	万孚生物	78,235,803.04	0.84
4	300241	瑞丰光电	74,222,348.94	0.79
5	002281	光迅科技	74,220,014.19	0.79
6	300270	中威电子	72,241,778.33	0.77
7	300136	信维通信	69,180,486.93	0.74
8	002139	拓邦股份	68,066,086.82	0.73
9	300250	初灵信息	64,940,620.89	0.70
10	300283	温州宏丰	63,228,800.05	0.68
11	300267	尔康制药	61,929,122.31	0.66
12	300339	润和软件	60,316,046.55	0.65
13	300487	蓝晓科技	57,662,719.08	0.62
14	300462	华铭智能	57,505,639.95	0.62
15	002589	瑞康医药	57,158,694.40	0.61
16	600537	亿晶光电	56,335,719.00	0.60
17	300031	宝通科技	55,303,746.93	0.59
18	002536	西泵股份	54,412,975.93	0.58
19	300375	鹏翎股份	54,374,909.55	0.58
20	002372	伟星新材	53,365,714.62	0.57

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	3,789,339,680.83
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	4,396,497,017.98
--------------	------------------

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,870,000.00	2.43
	其中：政策性金融债	199,870,000.00	2.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	199,870,000.00	2.43

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150207	15 国开 07	1,000,000	100,250,000.00	1.22
2	170401	17 农发 01	1,000,000	99,620,000.00	1.21

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707 合约	338	412,562,800.00	7,837,080.00	-
IF1707	沪深 300 股指期货 IF1707 合约	357	390,636,540.00	10,709,400.00	-
公允价值变动总额合计（元）					18,546,480.00
股指期货投资本期收益（元）					49,168,132.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					12,006,640.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，符合既定的投资政策和投资目标。

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	161,952,144.36
2	应收证券清算款	24,974,241.44
3	应收股利	-
4	应收利息	2,809,740.08
5	应收申购款	81,305.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,817,431.28

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601069	西部黄金	103,435,986.68	1.26	重大事项停牌

§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
150,549	66,556.51	26,323,018.95	0.26%	9,993,692,761.53	99.74%

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	153,841.26	0.00%

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	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月9日）基金份额总额	16,549,730,858.05
本报告期期初基金份额总额	11,266,479,115.80
本报告期基金总申购份额	45,927,311.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,292,390,646.72
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	10,020,015,780.48

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

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
长江证券股份有限公司	0	3,530,670,957.59	43.15%	2,471,501.28	43.37%	—
中信证券股份有限公司	2	932,514,828.84	11.40%	652,760.39	11.45%	—
东方证券股份有限公司	0	863,180,349.92	10.55%	604,239.38	10.60%	—
国金证券股份有限公司	1	669,944,626.73	8.19%	468,967.50	8.23%	—
中泰证券股份有限公司	1	438,086,603.05	5.35%	306,665.52	5.38%	—
中国国际金融股份有限公司	2	436,788,230.14	5.34%	305,755.70	5.37%	—
天风证券股份有限公司	0	339,032,144.72	4.14%	214,027.00	3.76%	—

中信建投证 券股份有限 公司	2	338,412,330.66	4.14%	236,888.64	4.16%	-
光大证券股 份有限公司	1	260,849,371.92	3.19%	182,594.60	3.20%	-
北京高华证 券有限责任 公司	2	237,001,417.25	2.90%	165,900.97	2.91%	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	0	80,616,578.12	0.99%	50,896.52	0.89%	-
海通证券股 份有限公司	2	54,731,082.24	0.67%	38,311.79	0.67%	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证	1	-	-	-	-	-

券有限公司						
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	0	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	0	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	-	-	5,607,000,000.00	30.65%	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	2,130,000,000.00	11.64%	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	1,370,000,000.00	7.49%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	850,000,000.00	4.65%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	4,768,000,000.00	26.06%	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	3,571,300,000.00	19.52%	-	-

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