

嘉实事件驱动股票型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	69
§11 备查文件目录.....	71
11.1 备查文件目录.....	71

11.2 存放地点.....	71
11.3 查阅方式.....	71

§ 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	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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100005	100140
法定代表人		邓红国	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 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：

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

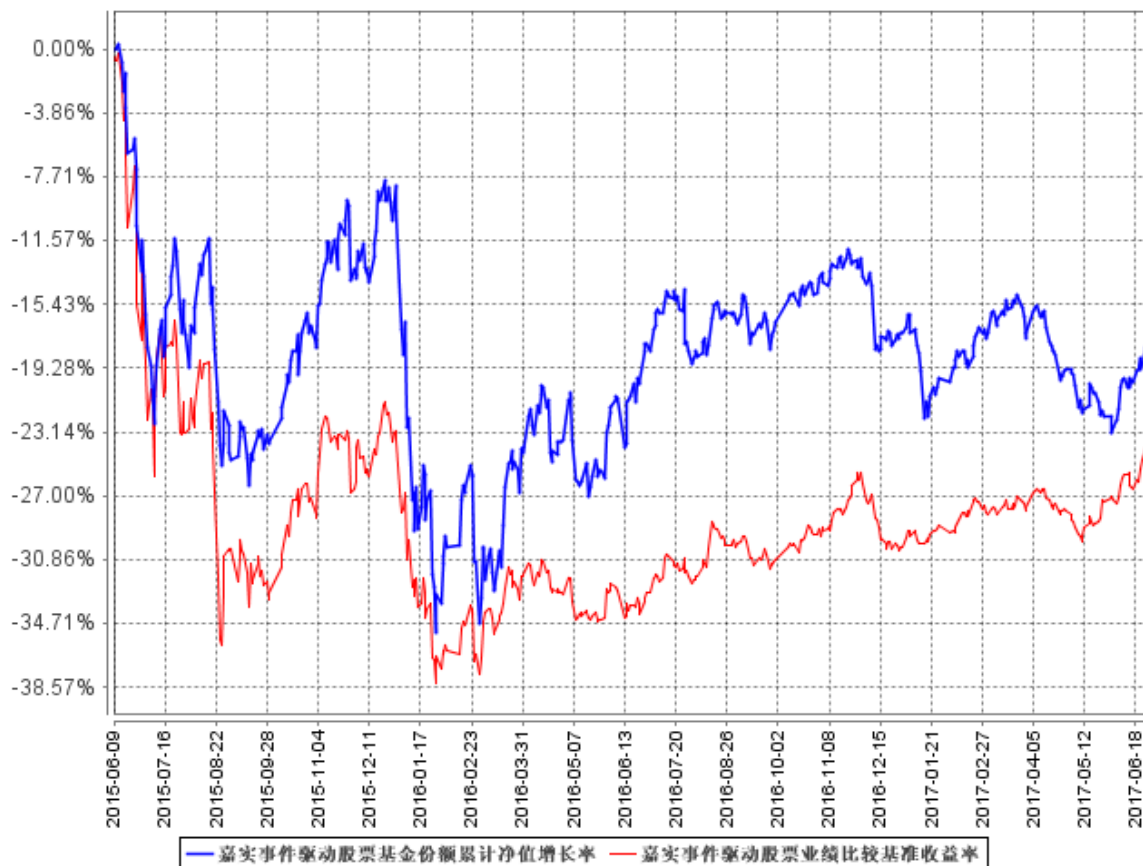
$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

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

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，人工智能投资部负责人	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 (AmericanCenturyInvestments) 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。

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“-”		-93,772,128.20	-1,160,230,001.92

号填列)			
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	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
金净值)			
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 基金基本情况

嘉实事件驱动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1064号《关于准予嘉实事件驱动股票型证券投资基金注册的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集共募集 16,549,730,858.05 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 705 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 16,549,730,858.05 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 80%-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的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%;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 X 80%+中证综合债券指数收益率 X 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以

及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	529,537,064.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	529,537,064.76

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,492,449,485.17	6,954,706,605.03	462,257,119.86	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	200,135,800.00	199,870,000.00	-265,800.00
	合计	200,135,800.00	199,870,000.00	-265,800.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,692,585,285.17	7,154,576,605.03	461,991,319.86	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	784,652,860.00	-	-	
其中：股指期货投资	784,652,860.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	784,652,860.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707	338.00	412,562,800.00	7,837,080.00
IF1707	沪深 300 股指期货 IF1707	357.00	390,636,540.00	10,709,400.00
总额合计				18,546,480.00
减：可抵销期货暂收款				18,546,480.00
股指期货投资净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末(2017年6月30日)，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末(2017年6月30日)，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	55,449.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,861.24
应收债券利息	2,562,246.58
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	185,182.74
合计	2,809,740.08

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,197,196.05
银行间市场应付交易费用	1,194.50
合计	2,198,390.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,943.69
预提费用	378,072.24
应付指数使用费	-
其他	-
合计	381,015.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,266,479,115.80	11,266,479,115.80
本期申购	45,927,311.40	45,927,311.40
本期赎回(以“-”号填列)	-1,292,390,646.72	-1,292,390,646.72
本期末	10,020,015,780.48	10,020,015,780.48

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,448,732,235.12	519,622,398.54	-1,929,109,836.58
本期利润	-243,076,474.68	149,304,346.48	-93,772,128.20
本期基金份额交易产生的变动数	282,489,759.42	-57,195,439.86	225,294,319.56
其中：基金申购款	-10,336,810.24	1,589,396.28	-8,747,413.96
基金赎回款	292,826,569.66	-58,784,836.14	234,041,733.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,409,318,950.38	611,731,305.16	-1,797,587,645.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	750,742.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	190,476.27
其他	5,961,354.23
合计	6,902,572.57

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,396,497,017.98
减：卖出股票成本总额	4,676,592,044.61
买卖股票差价收入	-280,095,026.63

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	205,200,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	200,441,600.00
减：应收利息总额	5,200,000.00
买卖债券差价收入	-441,600.00

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	49,168,132.00

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	59,430,839.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	59,430,839.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	137,297,706.48
——股票投资	136,821,906.48
——债券投资	475,800.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	12,006,640.00
——权证投资	-

——期货投资	12,006,640.00
3. 其他	-
合计	149,304,346.48

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	488,899.75
基金转出费收入	86,418.67
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	575,318.42

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	11,098,753.21
银行间市场交易费用	800.00
合计	11,099,553.21

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	74,383.76
信息披露费	114,888.48
债券托管账户维护费	18,000.00

银行划款手续费	20,270.34
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	600.00
合计	228,142.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

6.4.10 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。

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

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。

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券****6.4.12.1.1 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

6.4.12.1.2 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。

6.4.12.1.3 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。

6.4.12.2 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	21.06	47,000	975,409.00	994,050.00	-

					月 10 日						
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	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金未持有债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末,除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示:

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	529,537,064.76	-	-	-	529,537,064.76
结算备付金	407,995,774.49	-	-	-	407,995,774.49
存出保证金	1,312,276.36	-	-	160,639,868.00	161,952,144.36
交易性金融资产	199,870,000.00	-	-	6,954,706,605.03	7,154,576,605.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	24,974,241.44	24,974,241.44
应收利息	-	-	-	2,809,740.08	2,809,740.08

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	3,564.59	-	-	77,740.81	81,305.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,138,718,680.20	-	-	7,143,208,195.36	8,281,926,875.56
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	24,685,553.57	24,685,553.57
应付赎回款	-	-	-	20,541,807.11	20,541,807.11
应付管理人报酬	-	-	-	10,021,691.27	10,021,691.27
应付托管费	-	-	-	1,670,281.87	1,670,281.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,198,390.55	2,198,390.55
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	381,015.93	381,015.93
负债总计	-	-	-	59,498,740.30	59,498,740.30
利率敏感度缺口	1,138,718,680.20	-	-	7,083,709,455.06	8,222,428,135.26
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	122,109,387.23	-	-	-	122,109,387.23
结算备付金	978,600,211.29	-	-	-	978,600,211.29

存出保证金	1,150,937.45	-	-	178,309,296.00	179,460,233.45
交易性金融资产	199,700,000.00	-	-	7,705,137,062.33	7,904,837,062.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	150,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	89,155,386.34	89,155,386.34
应收利息	-	-	-	4,311,776.67	4,311,776.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10,987.23	-	-	137,135.66	148,122.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,451,571,523.20	-	-	7,977,050,657.00	9,428,622,180.20
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	62,619,463.08	62,619,463.08
应付赎回款	-	-	-	10,277,721.88	10,277,721.88
应付管理人报酬	-	-	-	12,089,801.25	12,089,801.25
应付托管费	-	-	-	2,014,966.87	2,014,966.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,781,583.05	3,781,583.05
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	469,364.85	469,364.85
负债总计	-	-	-	91,252,900.98	91,252,900.98

利率敏感度缺口	1,451,571,523.20	-	-	7,885,797,756.02	9,337,369,279.22
---------	------------------	---	---	------------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.43% (2016 年 12 月 31 日：2.14%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	6,954,706,605.03	84.58	7,705,137,062.33	82.52
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,954,706,605.03	84.58	7,705,137,062.33	82.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	业绩比较基准上升5%	447,012,199.74	664,593,077.24
	业绩比较基准下降5%	-447,012,199.74	-664,593,077.24

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,722,647,485.06 元，属于第二层次的余额为 431,929,119.97 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 7,346,971,240.25 元，第二层次 557,865,822.08 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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所有股票投资明细

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

11	000858	五 粮 液	1,686,625	93,877,547.50	1.14
12	002436	兴森科技	14,546,700	91,644,210.00	1.11
13	300365	恒华科技	2,481,721	88,597,439.70	1.08
14	600489	中金黄金	8,662,032	86,880,180.96	1.06
15	600104	上汽集团	2,765,600	85,871,880.00	1.04
16	600660	福耀玻璃	3,232,484	84,173,883.36	1.02
17	002475	立讯精密	2,747,172	80,327,309.28	0.98
18	300316	晶盛机电	6,241,720	77,959,082.80	0.95
19	600436	片仔癀	1,250,000	76,300,000.00	0.93
20	300138	晨光生物	5,802,576	76,129,797.12	0.93
21	000423	东阿阿胶	1,049,883	75,476,088.87	0.92
22	600068	葛洲坝	6,635,000	74,577,400.00	0.91
23	002415	海康威视	2,286,500	73,853,950.00	0.90
24	600036	招商银行	3,026,200	72,356,442.00	0.88
25	600547	山东黄金	2,497,017	72,238,701.81	0.88
26	000418	小天鹅A	1,505,271	70,431,630.09	0.86
27	002372	伟星新材	3,670,610	68,566,994.80	0.83
28	002271	东方雨虹	1,847,000	68,523,700.00	0.83
29	000537	广宇发展	8,213,611	67,433,746.31	0.82
30	600452	涪陵电力	1,447,590	66,111,435.30	0.80
31	002511	中顺洁柔	4,980,733	65,895,097.59	0.80
32	300054	鼎龙股份	6,440,686	65,501,776.62	0.80
33	002247	帝龙文化	4,961,061	65,089,120.32	0.79
34	002508	老板电器	1,484,365	64,540,190.20	0.78
35	300439	美康生物	2,984,953	64,176,489.50	0.78
36	601288	农业银行	17,867,900	62,895,008.00	0.76
37	001979	招商蛇口	2,897,000	61,879,920.00	0.75
38	600816	安信信托	4,383,835	59,576,317.65	0.72

39	600298	安琪酵母	2,261,600	58,507,592.00	0.71
40	002419	天虹股份	4,054,815	58,308,239.70	0.71
41	300394	天孚通信	2,249,476	57,564,090.84	0.70
42	002365	永安药业	1,881,629	56,938,093.54	0.69
43	002597	金禾实业	2,602,300	56,886,278.00	0.69
44	601166	兴业银行	3,356,900	56,597,334.00	0.69
45	002356	赫美集团	2,200,633	55,918,084.53	0.68
46	002394	联发股份	3,775,678	55,615,736.94	0.68
47	002032	苏泊尔	1,327,401	54,489,811.05	0.66
48	002120	韵达股份	1,052,736	54,321,177.60	0.66
49	600309	万华化学	1,878,434	53,798,349.76	0.65
50	600690	青岛海尔	3,558,900	53,561,445.00	0.65
51	600988	赤峰黄金	4,112,753	52,437,600.75	0.64
52	002008	大族激光	1,499,934	51,957,713.76	0.63
53	300196	长海股份	1,742,918	51,851,810.50	0.63
54	002675	东诚药业	3,600,000	51,336,000.00	0.62
55	000821	京山轻机	3,791,209	50,309,343.43	0.61
56	601636	旗滨集团	10,975,500	49,499,505.00	0.60
57	002768	国恩股份	2,252,356	47,186,858.20	0.57
58	000915	山大华特	1,257,360	46,358,863.20	0.56
59	002433	太安堂	4,981,787	46,081,529.75	0.56
60	300457	赢合科技	670,400	45,855,360.00	0.56
61	601328	交通银行	7,364,700	45,366,552.00	0.55
62	600016	民生银行	5,464,000	44,914,080.00	0.55
63	300269	联建光电	2,219,340	44,453,380.20	0.54
64	600999	招商证券	2,567,500	44,212,350.00	0.54
65	600057	象屿股份	4,302,220	43,753,577.40	0.53
66	002001	新和成	2,227,942	43,244,354.22	0.53

67	601233	桐昆股份	3,065,300	42,485,058.00	0.52
68	600507	方大特钢	4,968,309	42,379,675.77	0.52
69	300429	强力新材	1,673,907	41,697,023.37	0.51
70	002007	华兰生物	1,136,529	41,483,308.50	0.50
71	002426	胜利精密	5,000,000	40,150,000.00	0.49
72	300373	扬杰科技	1,991,800	40,134,770.00	0.49
73	002237	恒邦股份	3,821,233	40,084,734.17	0.49
74	300119	瑞普生物	2,795,200	39,803,648.00	0.48
75	600350	山东高速	6,319,200	39,179,040.00	0.48
76	002048	宁波华翔	1,866,201	38,928,952.86	0.47
77	002677	浙江美大	2,782,480	38,759,946.40	0.47
78	000661	长春高新	300,000	38,733,000.00	0.47
79	000989	九芝堂	2,041,326	38,703,540.96	0.47
80	300306	远方光电	2,218,604	38,448,407.32	0.47
81	300072	三聚环保	999,981	37,049,296.05	0.45
82	600872	中炬高新	2,011,500	36,810,450.00	0.45
83	300055	万邦达	2,000,000	36,800,000.00	0.45
84	002035	华帝股份	1,509,440	36,528,448.00	0.44
85	600009	上海机场	969,437	36,169,694.47	0.44
86	002438	江苏神通	4,239,996	35,658,366.36	0.43
87	002146	荣盛发展	3,499,925	34,544,259.75	0.42
88	600521	华海药业	1,624,286	34,174,977.44	0.42
89	300121	阳谷华泰	2,448,000	33,782,400.00	0.41
90	600743	华远地产	8,000,000	33,760,000.00	0.41
91	600213	亚星客车	3,017,428	32,618,396.68	0.40
92	600720	祁连山	3,933,800	30,801,654.00	0.37
93	600183	生益科技	2,327,800	28,725,052.00	0.35
94	000538	云南白药	300,000	28,155,000.00	0.34

95	002753	永东股份	1,508,605	28,014,794.85	0.34
96	600019	宝钢股份	4,142,200	27,794,162.00	0.34
97	601992	金隅股份	4,282,600	27,708,422.00	0.34
98	601088	中国神华	1,148,400	26,964,432.00	0.33
99	300041	回天新材	1,986,200	25,264,464.00	0.31
100	002078	太阳纸业	3,381,100	24,851,085.00	0.30
101	300320	海达股份	1,644,315	24,796,270.20	0.30
102	002155	湖南黄金	2,546,600	24,370,962.00	0.30
103	600496	精工钢构	5,000,000	24,150,000.00	0.29
104	600270	外运发展	1,247,200	23,609,496.00	0.29
105	002716	金贵银业	1,210,953	23,238,188.07	0.28
106	300035	中科电气	2,784,088	22,829,521.60	0.28
107	300468	四方精创	496,540	22,140,718.60	0.27
108	002726	龙大肉食	1,221,960	22,129,695.60	0.27
109	000705	浙江震元	2,119,484	21,830,685.20	0.27
110	600739	辽宁成大	1,172,600	21,141,978.00	0.26
111	000952	广济药业	1,400,001	21,042,015.03	0.26
112	603788	宁波高发	485,724	20,895,846.48	0.25
113	300470	日机密封	608,838	20,816,171.22	0.25
114	002519	银河电子	2,586,470	20,355,518.90	0.25
115	603077	和邦生物	3,992,000	20,319,280.00	0.25
116	600856	中天能源	1,784,552	20,094,055.52	0.24
117	000895	双汇发展	798,800	18,971,500.00	0.23
118	600110	诺德股份	1,336,600	18,832,694.00	0.23
119	300046	台基股份	980,472	18,334,826.40	0.22
120	002339	积成电子	1,323,145	18,047,697.80	0.22
121	600426	华鲁恒升	1,533,610	18,004,581.40	0.22
122	002652	扬子新材	2,279,522	16,435,353.62	0.20

123	300448	浩云科技	675,431	16,237,361.24	0.20
124	601939	建设银行	2,411,800	14,832,570.00	0.18
125	002479	富春环保	1,242,511	14,785,880.90	0.18
126	002019	亿帆医药	837,900	13,976,172.00	0.17
127	000828	东莞控股	1,155,600	13,867,200.00	0.17
128	002357	富临运业	1,220,160	12,787,276.80	0.16
129	002573	清新环境	638,000	12,007,160.00	0.15
130	000338	潍柴动力	869,600	11,478,720.00	0.14
131	000011	深物业 A	523,600	10,472,000.00	0.13
132	002408	齐翔腾达	933,000	10,337,640.00	0.13
133	300088	长信科技	654,516	10,308,627.00	0.13
134	000951	中国重汽	668,900	10,227,481.00	0.12
135	000666	经纬纺机	435,600	9,905,544.00	0.12
136	300113	顺网科技	365,290	9,826,301.00	0.12
137	000006	深振业 A	1,100,200	9,692,762.00	0.12
138	000090	天健集团	872,900	9,689,190.00	0.12
139	600742	一汽富维	502,600	9,604,686.00	0.12
140	000429	粤高速 A	1,093,800	9,341,052.00	0.11
141	601678	滨化股份	1,338,500	9,302,575.00	0.11
142	002458	益生股份	442,700	9,141,755.00	0.11
143	600668	尖峰集团	531,500	9,131,170.00	0.11
144	601515	东风股份	803,500	9,079,550.00	0.11
145	600067	冠城大通	1,321,200	9,076,644.00	0.11
146	600598	北大荒	813,500	9,037,985.00	0.11
147	600684	珠江实业	1,024,300	9,013,840.00	0.11
148	300252	金信诺	413,974	8,962,537.10	0.11
149	600611	大众交通	1,574,600	8,691,792.00	0.11
150	601158	重庆水务	1,204,800	8,614,320.00	0.10

151	600230	沧州大化	287,400	8,541,528.00	0.10
152	002390	信邦制药	963,200	8,389,472.00	0.10
153	002081	金螳螂	758,300	8,326,134.00	0.10
154	600523	贵航股份	441,300	8,168,463.00	0.10
155	600801	华新水泥	761,700	7,259,001.00	0.09
156	300200	高盟新材	494,186	7,244,766.76	0.09
157	600585	海螺水泥	307,100	6,980,383.00	0.08
158	300370	安控科技	1,414,140	6,872,720.40	0.08
159	002532	新界泵业	842,806	6,868,868.90	0.08
160	300326	凯利泰	711,442	6,680,440.38	0.08
161	300065	海兰信	260,400	6,674,052.00	0.08
162	300414	中光防雷	251,703	6,237,200.34	0.08
163	600900	长江电力	403,100	6,199,678.00	0.08
164	000488	晨鸣纸业	467,377	6,029,163.30	0.07
165	002310	东方园林	305,500	5,107,960.00	0.06
166	601601	中国太保	147,500	4,995,825.00	0.06
167	300440	运达科技	375,600	4,927,872.00	0.06
168	601668	中国建筑	483,000	4,675,440.00	0.06
169	300130	新国都	206,453	3,899,897.17	0.05
170	002084	海鸥卫浴	347,100	3,085,719.00	0.04
171	600276	恒瑞医药	57,700	2,919,043.00	0.04
172	601169	北京银行	315,800	2,895,886.00	0.04
173	002304	洋河股份	31,000	2,691,110.00	0.03
174	600015	华夏银行	270,140	2,490,690.80	0.03
175	002777	久远银海	34,791	2,421,453.60	0.03
176	002736	国信证券	178,400	2,363,800.00	0.03
177	600340	华夏幸福	64,600	2,169,268.00	0.03
178	601006	大秦铁路	236,700	1,985,913.00	0.02

179	002450	康得新	83,900	1,889,428.00	0.02
180	000725	京东方 A	442,900	1,842,464.00	0.02
181	603993	洛阳钼业	363,200	1,837,792.00	0.02
182	601633	长城汽车	135,600	1,802,124.00	0.02
183	601607	上海医药	59,200	1,709,696.00	0.02
184	601009	南京银行	151,900	1,702,799.00	0.02
185	601933	永辉超市	235,100	1,664,508.00	0.02
186	300258	精锻科技	99,300	1,639,443.00	0.02
187	601336	新华保险	31,800	1,634,520.00	0.02
188	300235	方直科技	97,390	1,605,961.10	0.02
189	002669	康达新材	53,500	1,566,480.00	0.02
190	601600	中国铝业	342,200	1,546,744.00	0.02
191	600362	江西铜业	82,400	1,389,264.00	0.02
192	600703	三安光电	67,600	1,331,720.00	0.02
193	000709	河钢股份	304,000	1,273,760.00	0.02
194	000046	泛海控股	145,400	1,269,342.00	0.02
195	601155	新城控股	66,800	1,238,472.00	0.02
196	600089	特变电工	117,400	1,212,742.00	0.01
197	002202	金风科技	77,800	1,203,566.00	0.01
198	600208	新湖中宝	252,700	1,137,150.00	0.01
199	600109	国金证券	96,400	1,129,808.00	0.01
200	000997	新大陆	47,000	1,066,430.00	0.01
201	002236	大华股份	46,100	1,051,541.00	0.01
202	600385	山东金泰	75,700	1,047,688.00	0.01
203	300014	亿纬锂能	57,600	1,045,440.00	0.01
204	002311	海大集团	56,900	1,039,563.00	0.01
205	000999	华润三九	32,700	1,038,225.00	0.01
206	000963	华东医药	20,800	1,033,760.00	0.01

207	600685	中船防务	37,700	1,032,226.00	0.01
208	000625	长安汽车	71,200	1,026,704.00	0.01
209	300083	劲胜精密	109,800	1,014,552.00	0.01
210	300145	中金环境	59,800	1,011,816.00	0.01
211	300124	汇川技术	39,100	998,614.00	0.01
212	300219	鸿利智汇	75,000	994,500.00	0.01
213	300388	国祯环保	47,000	994,050.00	0.01
214	002385	大北农	157,800	992,562.00	0.01
215	000581	威孚高科	38,300	991,970.00	0.01
216	600699	均胜电子	30,800	988,372.00	0.01
217	300112	万讯自控	84,700	985,061.00	0.01
218	002083	孚日股份	128,500	981,740.00	0.01
219	600808	马钢股份	276,600	979,164.00	0.01
220	600114	东睦股份	55,300	967,750.00	0.01
221	300188	美亚柏科	55,600	961,324.00	0.01
222	600741	华域汽车	39,600	959,904.00	0.01
223	300199	翰宇药业	62,500	958,750.00	0.01
224	300179	四方达	145,500	951,570.00	0.01
225	002373	千方科技	69,600	949,344.00	0.01
226	300238	冠昊生物	37,400	948,090.00	0.01
227	300285	国瓷材料	47,300	931,810.00	0.01
228	300473	德尔股份	19,300	918,680.00	0.01
229	002738	中矿资源	45,100	915,530.00	0.01
230	300445	康斯特	41,200	912,580.00	0.01
231	000008	神州高铁	124,500	906,360.00	0.01
232	300299	富春股份	40,500	771,525.00	0.01
233	000069	华侨城 A	71,900	723,314.00	0.01
234	600066	宇通客车	32,600	716,222.00	0.01

235	002242	九阳股份	11,200	220,304.00	0.00
236	603868	飞科电器	3,293	203,639.12	0.00
237	300510	金冠电气	2,730	95,140.50	0.00
238	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
239	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
240	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
241	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
242	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
243	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
244	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
245	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
246	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
247	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
248	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
249	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
250	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
251	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
252	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
253	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
254	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
255	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
256	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
257	603189	网达软件	98	2,105.04	0.00
258	300375	鹏翎股份	81	1,601.37	0.00
259	002281	光迅科技	35	777.70	0.00
260	002150	通润装备	64	752.00	0.00

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所有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	0	80,616,578.12	0.99%	50,896.52	0.89%	-

有限公司						
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 券有限公司	1	-	-	-	-	-
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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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	-	-	2,130,000,000.00	11.64%	-	-

融股份有限 公司						
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%		

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加西部证券为嘉实事件驱动股票型证券投资基金代销机构及开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年1月18日
2	关于增加“新浪基金”为嘉实旗下基金代销机构 并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年2月21日
3	关于调整凤凰金信基金代销的部分开放式基金转换补差费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年2月28日
4	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年3月16日
5	关于增加创金启富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2017年4月14日

	加费率优惠的公告	理人网站	
6	关于嘉实基金管理有限公司增加中金公司为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 19 日
7	关于增加北京肯特瑞为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 31 日
8	关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 28 日
9	关于增加中民财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实事件驱动股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实事件驱动股票型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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