

嘉实沪港深回报混合型证券投资基金 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 3 月 29 日(基金合同生效日)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.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
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.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	61
§11 备查文件目录.....	62
11.1 备查文件目录.....	62
11.2 存放地点.....	62

11.3 查阅方式.....	62
----------------	----

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪港深回报混合型证券投资基金
基金简称	嘉实沪港深回报混合
基金主代码	004477
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,938,567,420.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过跨市场资产配置，发掘内地与香港股票市场互联互通机制下的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金主要投资于 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过跨市场资产配置，发掘内地与香港股票市场互联互通机制下的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%
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，属于较高风险、较高收益的品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		邓红国	田国立

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3月29日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	26,488,360.64
本期利润	102,289,994.52
加权平均基金份额本期利润	0.0300
本期加权平均净值利润率	2.99%
本期基金份额净值增长率	3.10%
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	25,094,166.79
期末可供分配基金份额利润	0.0085
期末基金资产净值	3,029,756,606.87
期末基金份额净值	1.0310
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	3.10%

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；(4) 本基金合同生效日为2017年3月29日，本报告期自2017年3月29日起至2017年6月30日止。

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	3.62%	0.73%	2.54%	0.49%	1.08%	0.24%
过去三个月	3.10%	0.55%	5.88%	0.46%	-2.78%	0.09%
自基金合同 生效起至今	3.10%	0.54%	5.23%	0.45%	-2.13%	0.09%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×45% +恒生指数收益率×45% +中债综合财富指数收益率×10%

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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：

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

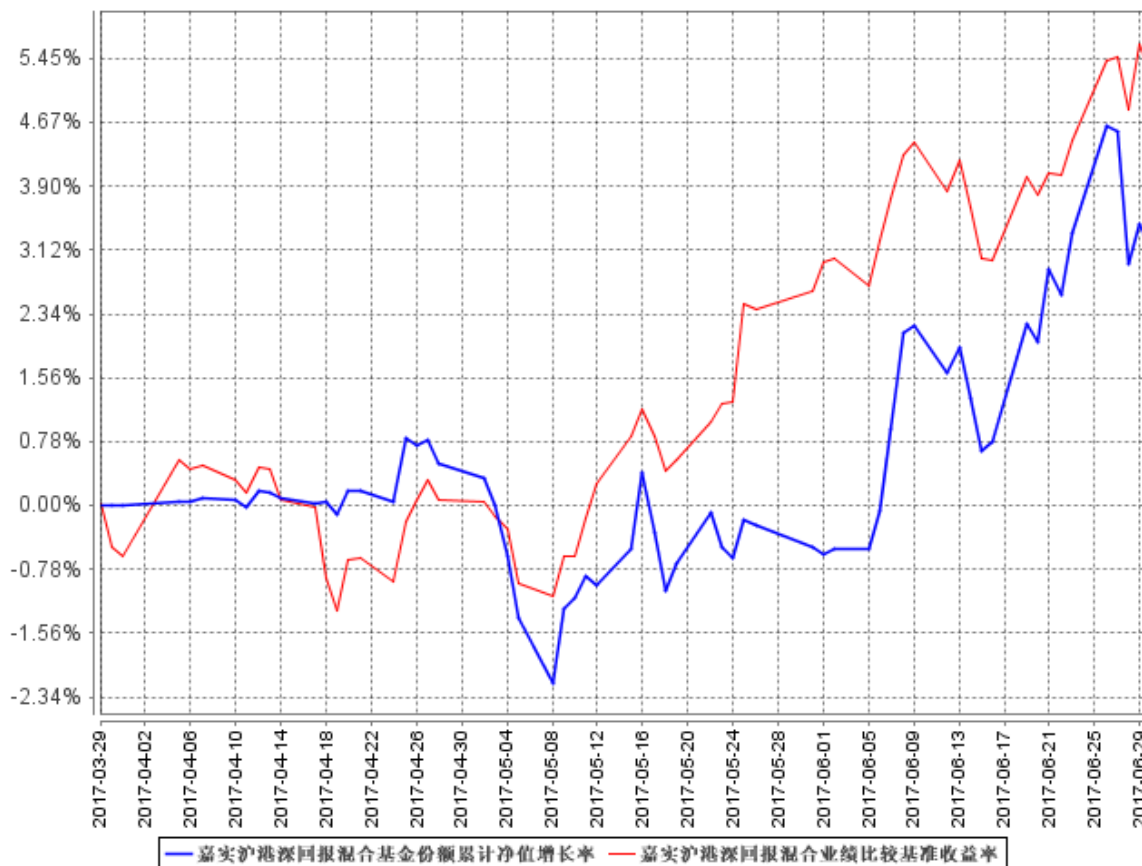
$$\text{Return}(t)=45\%*(\text{沪深 300 指数}(t)/\text{沪深 300 指数}(t-1)-1)+45%*(\text{恒生指数}(t)/\text{恒生指数}(t-1)-1)+10%*(\text{中债综合财富指数}(t)/\text{中债综合财富指数}(t-1)-1)$$

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

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

嘉实沪港深回报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：嘉实沪港深回报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

(2017年3月29日至2017年6月30日)

注 1：本基金基金合同生效日 2017 年 3 月 29 日至报告期末未满 1 年。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，本报告期处于建仓期内。

注 2：2017 年 6 月 21 日，本基金管理人发布《关于增聘嘉实沪港深回报混合基金经理的公告》，增聘谭丽女士担任本基金基金经理职务，与基金经理张金涛先生共同管理本基金。

§ 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、嘉实原由 (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		
张金涛	本基金、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券基金经理	2017 年 3 月 29 日	-	15 年	曾任中金公司研究部能源组组长。润晖投资高级副总裁,负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金,现任海外研究组组长,负责海外投资策略以及能源原材料行业研究。
谭丽	本基金、嘉实新消费股票基金经理	2017 年 6 月 21 日	-	15 年	曾在北京海问投资咨询有限公司、国信证券股份有限公司及泰达荷银基金管理有限公司任研究员、基金经理助理职务。2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司,曾任研究员、投资经理。

注：（1）基金经理张金涛的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理谭丽的任职日期是

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。

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、《嘉实沪港深回报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

2017 年上半年，港股市场表现强劲，跑赢 A 股及大部分发达国家市场。港股持续上涨的原因主要是整体估值相对便宜加上港股通和海外资金的流入。期间中国经济企稳回升，人民币汇率稳定，企业盈利持续改善，都为股市上涨创造了有利环境。期内表现较好的是地产、电子、汽车、博彩等盈利增长较快的行业，电信、能源、公用事业等行业表现落后。

报告期内 A 股市场小幅震荡，市场风格分化明显，家电、食品饮料、电子等估值较低增长明确的行业涨幅较大。计算机、传媒、纺织服装、农林牧渔、商贸零售等高估值行业表现落后。

本基金目前仍在建仓期，在港股上配置较高，港股主要持股行业包括电子、软件、保险、电信、博彩等，在 A 股则重点布局了电子、食品饮料、家电等行业，均取得了较好的回报。

投资策略上，我们以价值投资为主，优先选择低估值伴有基本面边际改善的股票，以期享受盈利和估值的双升，在股价上涨获利空间降低后及时获利了结。我们在深入研究的支持下，致力

于挖掘领先市场的投资机会。鉴于港股市场流动性较差，交易成本较高，在买入港股股票时特别注意回避有治理问题的公司。在买入流动性较差的中小盘港股时，仓位要同时兼顾风险收益比和流动性指标。

行业选择上，我们相信未来很长一段时间，中国都处于经济转型期，因此产业升级和消费升级是长期发展方向，能够主动进行产业升级、符合消费升级方向的公司值得长期关注。报告期内，基金大幅超配了电子和消费这两个行业，获得一定的超额回报。对于周期股，我们的投资也是基于深入研究的基础上进行投资，对于持续性存疑的周期反弹保持谨慎。

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 1.0310 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.10%，业绩比较基准收益率为 5.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场展望：展望 2017 年下半年，企业盈利仍能维持正增长，但增速可能会见顶回落。股票市场资金方面，金融去杠杆大背景下，股票市场也不是受杠杆抽离冲击最快，压力最大的资产，股市资金面有望因相对吸引力的提升面临改善。因此，从股票市场自身的总体盈利和流动性趋势而言，两者都有经历过往两年的超高双向波动后向一个比较温和的平稳趋势过度的可能。两大因素相互抵消下市场处于平衡市状态，全年上证指数涨跌幅可能会在个位数范围。但全年的市场过程可能仍将十分曲折，主要的风险在于货币政策阶段性收紧过度（通胀、汇率、房价等因素牵制），以及金融去杠杆的加速推进造成金融体系整体的流动性收紧。外部主要的风险在于地缘政治风险。结构上看，2017 年下半年的 A 股市场相比过去几年也是一个更难寻找清晰机会的市场——低估值价值股和强周期类股票经历了一年多的估值修复和业绩上升，但考虑到逐渐见顶的盈利增速和告别底部的市盈率，要靠景气度大幅超预期来继续提升估值的机会不大，未来个股分化会加剧。另一方面，小市值成长股系统性的估值消化尽管已经有了较大进展，但其外延并购业绩在 2017 年以后存在较大不确定性，且在一个流动性偏于收紧的市场，预计尚未告别继续去化泡沫的阶段，个股开始明显分化，部分优质成长股已经具备了选股价值。就下半年收益率而言，我们认为大小市值风格仍将整体胜出、但优势会比上半年要弱，应当深入行业和个股仔细分辨相对收益的机会。

港股市场展望：在 2017 年上半年经历了明显的上涨，整体估值已经趋于合理，但是由于企业盈利增长仍较为强劲，我们对港股 2017 年下半年的表现仍保持相对乐观，但是行业和个股的分化将会加剧，有持续业绩增长的股票有望继续上涨，而业绩不达预期或不能持续增长的股票则有可能下跌。港股仍有很大机会继续跑赢 A 股，这是因为港股估值水平仍较 A 股便宜，国内资金对海外资产配置的热情不减，而在其他渠道不通畅的情况下，资金仍会通过港股通南下，从而逐渐抬

升港股的估值水平和交易活跃度。此外在经历了几年对香港中国股票的低配以后，国际资金也有望持续回流香港市场，进一步推动港股的行情。

我们将在基金契约的范围内，继续以价值投资为主要策略，深入研究行业发展趋势，挖掘结构性的投资机会。行业选择上，我们将继续关注产业升级和消费升级这两个长期方向，同时加大对深度价值的周期性投资机会的研究。在 2017 年下半年相对看好港股电子、医药、博彩、保险、农业和原材料等行业的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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，香港联合交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实沪港深回报混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪港深回报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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	719,884,717.20
结算备付金		37,299,500.29
存出保证金		396,661.09
交易性金融资产	6.4.7.2	2,315,267,824.49
其中：股票投资		2,315,267,824.49
基金投资		-
债券投资		-
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		15,560,587.71
应收利息	6.4.7.5	69,725.43
应收股利		5,375,008.04
应收申购款		3,598,737.32
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,097,452,761.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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		129,680.41
应付赎回款		59,956,705.29
应付管理人报酬		4,058,342.98
应付托管费		676,390.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,689,193.45
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	185,842.08
负债合计		67,696,154.70
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,938,567,420.77
未分配利润	6.4.7.10	91,189,186.10
所有者权益合计		3,029,756,606.87
负债和所有者权益总计		3,097,452,761.57

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，本报告期自基金合同生效日 2017 年 3 月 29 日起至 2017 年 6 月 30 日止。报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0310 元，基金份额总额 2,938,567,420.77 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实沪港深回报混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年3月29日(基金合同生 效日)至2017年6月30日
一、收入		123,320,868.87
1.利息收入		7,768,404.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,265,431.04
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,502,973.46
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,364,578.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,237,973.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	17,126,604.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	75,801,633.88
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	2,386,252.46
减：二、费用		21,030,874.35
1. 管理人报酬		13,085,941.98
2. 托管费		2,180,990.32
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,705,429.26
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	58,512.79

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		102,289,994.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		102,289,994.52

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，本期是指 2017 年 3 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪港深回报混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)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)	3,523,043,789.83	-	3,523,043,789.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	102,289,994.52	102,289,994.52
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)	-584,476,369.06	-11,100,808.42	-595,577,177.48
其中：1.基金申购款	95,454,042.00	1,140,517.32	96,594,559.32
2.基金赎回款	-679,930,411.06	-12,241,325.74	-692,171,736.80
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	2,938,567,420.77	91,189,186.10	3,029,756,606.87

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，本期是指 2017 年 3 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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 基金基本情况

嘉实沪港深回报混合型证券投资基金(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[2017]300号《关于准予嘉实沪港深回报混合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《嘉实沪港深回报混合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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,522,843,711.33 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(2017)第 335 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实沪港深回报混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,523,043,789.83 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,078.50 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《嘉实沪港深回报混合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），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、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)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 50%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%）。每个交易日日终，在扣除股指期

货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。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×45% + 恒生指数收益率×45% + 中债综合财富指数收益率×10%。

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》、《嘉实沪港深回报混合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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，

参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券

投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[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[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	719,884,717.20
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	719,884,717.20

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	2,239,466,190.61	2,315,267,824.49	75,801,633.88
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,239,466,190.61	2,315,267,824.49	75,801,633.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

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	57,558.69
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	2,362.36
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	57.46
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9,746.92
合计	69,725.43

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	2,689,193.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,689,193.45

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	150,338.28
预提费用	35,503.80
应付指数使用费	-
其他	-
合计	185,842.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,523,043,789.83	3,523,043,789.83
本期申购	95,454,042.00	95,454,042.00
本期赎回(以“-”号填列)	-679,930,411.06	-679,930,411.06
本期末	2,938,567,420.77	2,938,567,420.77

注 1：申购含转换入，赎回含转换出份额。

注 2：本基金于 2017 年 3 月 22 日至 2017 年 3 月 23 日向社会公开募集，截至 2017 年 3 月 29 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,522,843,711.33 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 200,078.50 元，以上实收基金合计 3,523,043,789.83 元，折合为 3,523,043,789.83 份嘉实沪港深回报混合基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	26,488,360.64	75,801,633.88	102,289,994.52
本期基金份额交易	-1,394,193.85	-9,706,614.57	-11,100,808.42

产生的变动数			
其中：基金申购款	105,008.51	1,035,508.81	1,140,517.32
基金赎回款	-1,499,202.36	-10,742,123.38	-12,241,325.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,094,166.79	66,095,019.31	91,189,186.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6 月30日
活期存款利息收入	2,055,578.92
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	60,503.40
其他	149,348.72
合计	2,265,431.04

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
卖出股票成交总额	826,294,976.79
减：卖出股票成本总额	806,057,002.95
买卖股票差价收入	20,237,973.84

6.4.7.13 债券投资收益

本期(2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日),本基金无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本期(2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日),本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,126,604.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,126,604.19

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3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	75,801,633.88
——股票投资	75,801,633.88
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	75,801,633.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
基金赎回费收入	2,206,834.62
基金转出费收入	38,338.29
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	141,079.55
合计	2,386,252.46

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
交易所市场交易费用	5,705,429.26
银行间市场交易费用	-
合计	5,705,429.26

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
审计费用	35,503.80

信息披露费	-
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	23,008.99
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	-
合计	58,512.79

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

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 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 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,085,941.98
其中：支付销售机构的客户维护费	5,501,927.84

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 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,180,990.32

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 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）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 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	719,884,717.20	2,055,578.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 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 3 月 29 日（基金合同生效日）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

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。

6.4.12.3 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，属于较高风险、较高收益的品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。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在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。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工作流程、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

金持有由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	719,884,717.20	-	-	-	719,884,717.20
结算备付金	37,299,500.29	-	-	-	37,299,500.29
存出保证金	396,661.09	-	-	-	396,661.09
交易性金融资产	-	-	-	2,315,267,824.49	2,315,267,824.49

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,560,587.71	15,560,587.71
应收利息	-	-	-	69,725.43	69,725.43
应收股利	-	-	-	5,375,008.04	5,375,008.04
应收申购款	130,354.40	-	-	3,468,382.92	3,598,737.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	757,711,232.98	-	-	2,339,741,528.59	3,097,452,761.57
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	-	-	-	129,680.41	129,680.41
应付赎回款	-	-	-	59,956,705.29	59,956,705.29
应付管理人报酬	-	-	-	4,058,342.98	4,058,342.98
应付托管费	-	-	-	676,390.49	676,390.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,689,193.45	2,689,193.45
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	185,842.08	185,842.08
负债总计	-	-	-	67,696,154.70	67,696,154.70
利率敏感度缺口	757,711,232.98	-	-	2,272,045,373.89	3,029,756,606.87

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，本基金未持有交易性债券投资。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	1,391,324,386.96	-	1,391,324,386.96
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	5,375,008.04	-	5,375,008.04
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	1,396,699,395.00	-	1,396,699,395.00
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,396,699,395.00	-	1,396,699,395.00

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值 5%	69,834,969.75
	所有外币相对人民币贬值 5%	-69,834,969.75

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,315,267,824.49	76.42
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	2,315,267,824.49	76.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

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 2,315,144,141.39 元，属于第二层次的余额为 123,683.10 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。

(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	2,315,267,824.49	74.75
	其中：股票	2,315,267,824.49	74.75
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	757,184,217.49	24.45
7	其他各项资产	25,000,719.59	0.81
8	合计	3,097,452,761.57	100.00

注：通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,391,324,386.96 元，占基金资产净值的比例为 45.92%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 71,774,171.94 元，占基金资产净值的比例为 2.37%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	94,219,153.98	3.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	757,903,693.75	25.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	38,778.24	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	852,169,265.59	28.13

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	197,792,878.67	6.53
必需消费品	76,873,306.09	2.54
能源	-	-
金融	510,845,620.14	16.86
医疗保健	99,496,179.00	3.28
工业	-	-
信息技术	472,898,671.00	15.61

原材料	-	-
房地产	-	-
电信服务	-	-
公用事业	105,191,904.00	3.47
合计	1,463,098,558.90	48.29

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	H00966	中国太平	12,906,600	221,573,508.26	7.31
2	000651	格力电器	4,999,977	205,849,053.09	6.79
3	H00700	腾讯控股	650,000	157,510,121.60	5.20
4	H01336	新华保险	3,381,600	116,517,843.40	3.85
5	000858	五粮液	2,075,815	115,539,862.90	3.81
6	002241	歌尔股份	5,868,429	113,143,311.12	3.73
7	H02238	广汽集团	9,358,000	111,271,336.43	3.67
8	H00371	北控水务集团	20,000,000	105,191,904.00	3.47
9	002008	大族激光	2,999,950	103,918,268.00	3.43
10	H03968	招商银行	5,000,000	102,197,580.00	3.37
11	000998	隆平高科	4,278,799	94,219,153.98	3.11
12	002035	华帝股份	3,465,742	83,870,956.40	2.77
13	H00606	中国粮油控股	27,337,000	76,873,306.09	2.54
14	H00165	中国光大控股	4,782,000	70,556,688.48	2.33
15	H02018	瑞声科技	800,000	67,767,193.60	2.24

16	H01128	永利澳门	4,231,600	66,989,870.56	2.21
17	H00732	信利国际	27,124,000	63,561,947.62	2.10
18	H00354	中国软件国际	17,104,000	61,457,901.24	2.03
19	H00981	中芯国际	6,532,500	51,310,670.97	1.69
20	000807	云铝股份	7,007,970	50,597,543.40	1.67
21	000568	泸州老窖	999,976	50,578,786.08	1.67
22	H02196	复星医药	1,734,000	45,525,441.72	1.50
23	H00522	ASM PACIFIC	491,500	45,004,472.74	1.49
24	H01530	三生制药	4,855,000	43,654,466.58	1.44
25	300433	蓝思科技	999,962	29,088,894.58	0.96
26	H00285	比亚迪电子	1,956,500	26,286,363.23	0.87
27	H00751	创维数码	4,640,000	19,531,671.68	0.64
28	H03933	联邦制药	2,308,000	10,316,270.70	0.34
29	601799	星宇股份	112,930	4,993,764.60	0.16
30	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
31	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
32	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
33	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
34	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
35	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
36	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
37	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
38	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
39	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
40	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
41	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
42	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00

43	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
44	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
45	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
46	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
47	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	H00966	中国太平	215,076,199.06	7.10
2	000651	格力电器	187,653,864.87	6.19
3	H00700	腾讯控股	178,458,764.39	5.89
4	000858	五粮液	173,414,491.39	5.72
5	H01336	新华保险	163,148,963.93	5.38
6	H00371	北控水务集团	150,300,914.93	4.96
7	002241	歌尔股份	141,414,214.80	4.67
8	000998	隆平高科	113,258,335.31	3.74
9	H02238	广汽集团	111,726,392.56	3.69
10	000807	云铝股份	104,187,131.32	3.44
11	002008	大族激光	96,110,995.00	3.17
12	H03968	招商银行	92,975,897.10	3.07
13	H00606	中国粮油控股	92,718,344.00	3.06
14	002035	华帝股份	91,437,141.14	3.02
15	000568	泸州老窖	89,231,209.68	2.95
16	600390	五矿资本	80,422,637.08	2.65
17	H00165	中国光大控股	73,021,413.22	2.41

18	H00981	中芯国际	70,394,284.02	2.32
19	H01128	永利澳门	68,039,365.94	2.25
20	H00354	中国软件国际	64,881,346.83	2.14
21	H02018	瑞声科技	64,479,344.04	2.13
22	H00732	信利国际	62,758,663.91	2.07

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	100,820,487.66	3.33
2	600390	五矿资本	65,669,964.54	2.17
3	002396	星网锐捷	52,228,152.84	1.72
4	H00175	吉利汽车	51,829,067.70	1.71
5	002048	宁波华翔	51,819,342.50	1.71
6	H00700	腾讯控股	49,387,807.31	1.63
7	002415	海康威视	43,492,456.20	1.44
8	H01336	新华保险	41,775,543.22	1.38
9	000568	泸州老窖	41,127,453.84	1.36
10	000807	云铝股份	38,893,381.94	1.28
11	603160	汇顶科技	38,309,466.24	1.26
12	002241	歌尔股份	37,806,521.66	1.25
13	H00371	北控水务集团	37,789,281.29	1.25
14	601600	中国铝业	30,503,788.26	1.01
15	300433	蓝思科技	29,763,266.10	0.98
16	000998	隆平高科	21,738,629.22	0.72
17	000651	格力电器	20,103,977.52	0.66
18	002035	华帝股份	15,720,743.71	0.52

19	H00981	中芯国际	14,647,463.89	0.48
20	603579	荣泰健康	13,133,599.13	0.43

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	3,045,523,193.56
卖出股票收入（成交）总额	826,294,976.79

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

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	396,661.09
2	应收证券清算款	15,560,587.71
3	应收股利	5,375,008.04
4	应收利息	69,725.43
5	应收申购款	3,598,737.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,000,719.59

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
37,449	78,468.52	4,381,337.29	0.15%	2,934,186,083.48	99.85%

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	281,436.81	0.01%

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（2017年3月29日）基金份额总额	3,523,043,789.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	95,454,042.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	679,930,411.06
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,938,567,420.77

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

2017 年 6 月 21 日, 本基金管理人发布《关于增聘嘉实沪港深回报混合基金经理的公告》, 增聘谭丽女士担任本基金基金经理, 与基金经理张金涛先生共同管理本基金。

(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

报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 为本基金的审计机构。

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	
华泰证券股份有 限公司	4	1,856,880,177.76	47.97%	1,299,816.45	48.33%	新增
长江证券股份有 限公司	1	518,056,356.63	13.38%	362,641.20	13.49%	新增
广发证券股份有 限公司	5	396,928,032.41	10.25%	277,852.64	10.33%	新增
东方证券股份有 限公司	4	355,881,515.25	9.19%	249,117.91	9.26%	新增
方正证券股份有 限公司	3	252,885,591.95	6.53%	177,021.03	6.58%	新增
天风证券股份有 限公司	1	237,107,653.85	6.12%	149,686.79	5.57%	新增
东吴证券股份有 限公司	3	101,774,726.03	2.63%	71,242.33	2.65%	新增
国泰君安证券股 份有限公司	2	88,251,408.40	2.28%	61,775.25	2.30%	新增
中国国际金融股 份有限公司	3	63,419,463.14	1.64%	40,039.85	1.49%	新增
安信证券股份有 限公司	3	-	-	-	-	新增
北京高华证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增
渤海证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	新增

限公司						
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
平安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	新增

申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	新增
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
中泰证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增
中银国际证券有	2	-	-	-	-	新增

限责任公司						
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	新增

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。

注 3：平安证券有限责任公司更名为平安证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租深圳交易单元 1 个。

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
广发证券股 份有限公司	-	-	1,000,000,000.00	14.54%	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	1,100,000,000.00	16.00%	-	-
华泰证券股	-	-	4,776,100,000.00	69.46%	-	-

份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

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	关于增加工商银行等为嘉实沪港深回报混合型证券投资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3月22日
2	关于增加华泰证券为嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）和嘉实沪港深回报混合型证券投资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3月23日
3	嘉实基金管理有限公司关于嘉实沪港深回报混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年3月23日
4	嘉实沪港深回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年3月30日
5	关于嘉实沪港深回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年5月11日
6	关于嘉实沪港深回报混合型证券投资基金 2017 年 5 月 25 日至 5 月 30 日暂停申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年5月23日
7	关于增聘嘉实沪港深回报混合基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年6月21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沪港深回报混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实沪港深回报混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪港深回报混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实沪港深回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实沪港深回报混合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