

嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 3 月 14 日（基金合同生效日）起至 2018 年 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实金融精选股票	
基金主代码	005662	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 14 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	1,049,526,578.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实金融精选股票 A	嘉实金融精选股票 C
下属分级基金的交易代码	005662	005663
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,016,368,502.51 份	33,158,076.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于金融行业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金综合运用定性和定量分析方法，对宏观经济因素进行充分研究，依据经济周期理论，判断宏观周期所处阶段，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时间内各大类资产风险预期收益率水平和风险因素，确定组合中沪深 A 股、港股、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。按照预期收益、风险和置信水平相匹配的方法构建基金投资组合。
业绩比较基准	中证全指一级行业金融指数收益率×70% +中债综合财富指数收益率×10% +恒生金融行业指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，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。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

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

责人	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65215588	(010) 66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年03月14日(基金合同生效日)-2018年06月30日)	
	嘉实金融精选股票 A	嘉实金融精选股票 C
本期已实现收益	55,592.03	-57,245.21
本期利润	-29,365,967.47	-1,026,455.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0276	-0.0282
本期加权平均净值利润率	-2.80%	-2.85%
本期基金份额净值增长率	-2.82%	-2.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-28,653,514.70	-986,796.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0282	-0.0298
期末基金资产净值	987,714,987.81	32,171,279.86
期末基金份额净值	0.9718	0.9702
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.82%	-2.98%

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) 嘉实金融精选股票 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实金融精选股票 C 从本类基金资产中计提销售服务费，不收取认（申）购费用但收取赎回费；(3) 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；(4) 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。(5) 本基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日, 本报告期自 2018 年 3 月 14 日起至 2018 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

嘉实金融精选股票 A

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	-1.17%	0.53%	-6.59%	1.06%	5.42%	-0.53%
过去三个月	-1.48%	0.38%	-10.78%	1.00%	9.30%	-0.62%
自基金合同生效起至今	-2.82%	0.35%	-14.92%	0.99%	12.10%	-0.64%

嘉实金融精选股票 C

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	-1.22%	0.52%	-6.59%	1.06%	5.37%	-0.54%
过去三个月	-1.62%	0.38%	-10.78%	1.00%	9.16%	-0.62%
自基金合同生效起至今	-2.98%	0.35%	-14.92%	0.99%	11.94%	-0.64%

注:本基金业绩比较基准为: 中证全指一级行业金融指数收益率×70%+中债综合财富指数收益率×10%+恒生金融行业指数收益率×20%

本基金股票部分主要投资于金融行业股票。中证全指一级行业金融指数反映沪深 A 股中金融行业公司股票的整体表现, 对金融行业股票具有较强的代表性, 恒生金融行业指数反映恒生综合指数里主要经营金融业务成分股公司的表现, 两者适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。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。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资债、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资债、中央企业债等债券, 综合反映了

债券市场整体价格和回报情况。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：

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

$$\text{Return}(t)=70\%*(\text{中证全指一级行业金融指数}(t)/\text{中证全指一级行业金融指数}(t-1)-1)+10\%*(\text{中债综合财富指数}(t)/\text{中债综合财富指数}(t-1)-1)+20\%*(\text{恒生金融行业指数}(t)/\text{恒生金融行业指数}(t-1)-1)$$

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

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

嘉实金融精选股票A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

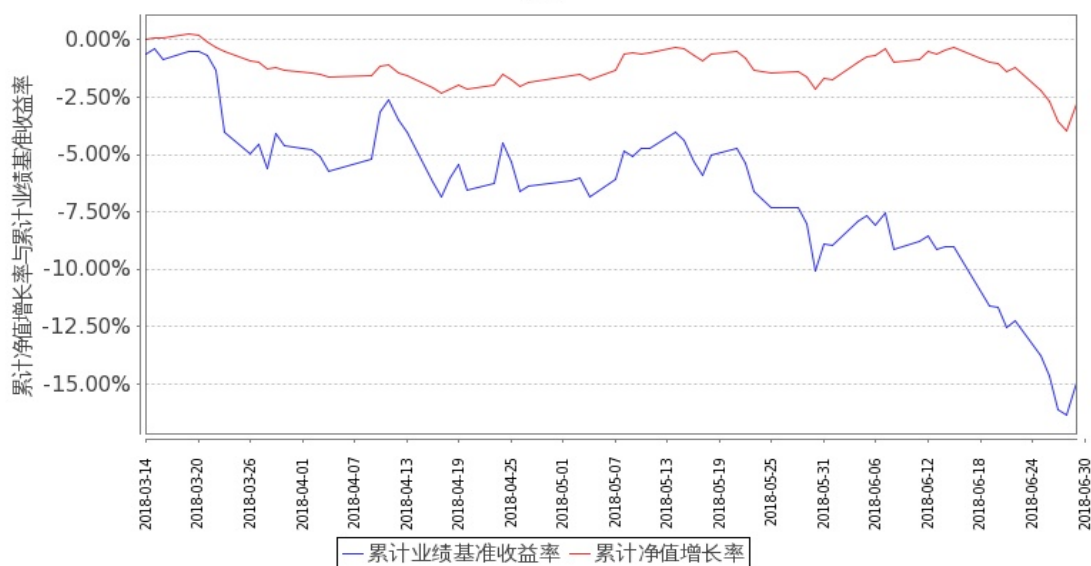


图 1：嘉实金融精选股票 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 3 月 14 日至 2018 年 6 月 30 日)

嘉实金融精选股票C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

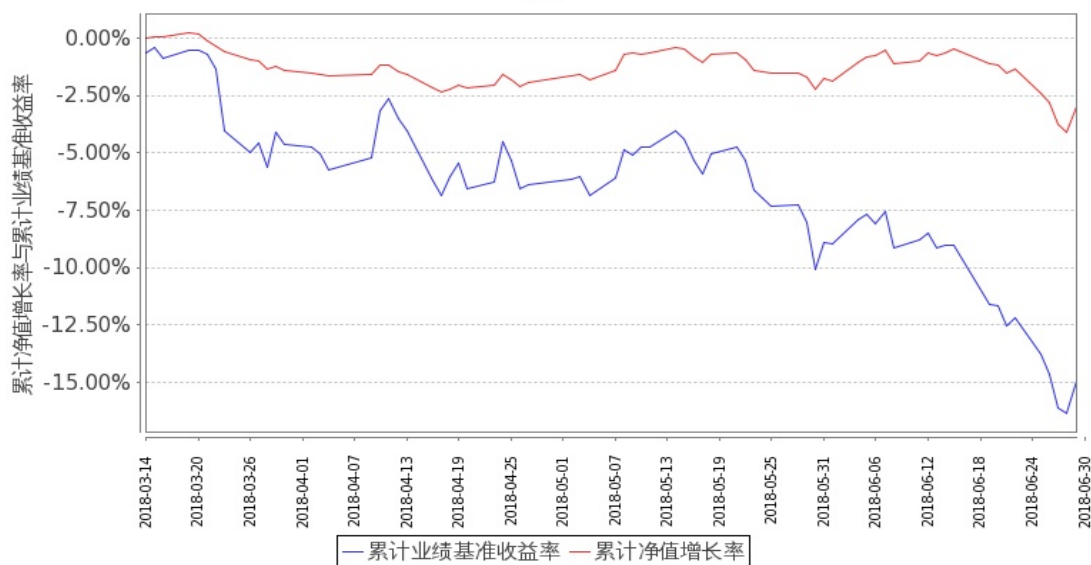


图 2：嘉实金融精选股票 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 3 月 14 日至 2018 年 6 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日 2018 年 3 月 14 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。

§ 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、北京怀柔设有分公司。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 2018 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、142 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 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合 (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)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、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)、嘉实信用债券、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、嘉实惠泽混合（LOF）、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、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。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		
李欣	本基金、嘉实沪深300指数研究增强基金经理	2018年3月14日	-	7年	硕士研究生。曾任普华永道高级精算师、中国国际金融有限公司研究员、海通证券股份有限公司高级分析师。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司研究部，任研究员一职。具有基金从业资格，中国国籍

注：（1）基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日；（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、《嘉实金融精选股票型发起式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 4 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

在欧日增长放缓、全球地缘政治冲突加剧、中美贸易战快速升级的背景下，上半年全球股票市场走势出现明显分化。美股在二月份急跌后持续盘整一个季度，期间纳斯达克指数创出新高；与此同时，受贸易战影响最为直接的东亚市场普遍疲软。国内市场在中美贸易战、信用与广义社融快速收缩、资管新规落地带来的金融体系流动性收缩三大利空因素压制下连续大幅回撤。板块上，大小风格在二季度表现均不理想，普跌特征显著。季初一度表现强势的 TMT 和军工中后段出现快速下跌，随后避险情绪升温叠加后周期属性凸显的大众消费和医药板块崛起，金融周期板块年初受挫后持续阴跌。

本基金上半年处在建仓期中，一方面通过低仓位规避系统风险，另一方面自下而上精选个股，配置估值安全、业绩稳健增长的金融标的，在市场下跌过程中超额收益较为明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实金融精选股票 A 基金份额净值为 0.9718 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.82%；截至本报告期末嘉实金融精选股票 C 基金份额净值为 0.9702 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.98%；业绩比较基准收益率为-14.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，从宏观增长到中观景气短期仍体现出一定韧性，企业盈利全年有较大概率实现两位数增长，目前全 A 股估值已进入历次熊市底部区域，体现的是市场领先于基本面反应对未来增长下行的担忧。伴随着产业资本开始大量回购增持、股息率/无风险利率快速弥合、中报披露期来临市场重新拾起对业绩关注，前期恐慌式杀跌的趋势基本告一段落。但在中期利空因素压制下，市场尽管已经足够便宜，但恐怕仍会在不断尝试反弹后迎来新的探底。坚持以防守反击为纲，不对仓位做激进变动，积极寻找潜在的结构性的机会。

更为复杂的市场环境下，我们将继续在金融行业中坚持自下而上精选个股的投资策略，更精细和严格控制风险，以降低最大回撤和净值波动幅度。

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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告嘉实金融精选股票 A 3.1.1 “本期利润”为-29,365,967.47 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-28,653,514.70 元；嘉实金融精选股票 C 3.1.1 “本期利润”为 -1,026,455.57 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-986,796.29 元，以及本基金基金合同（十六

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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：嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	233,323,117.38
结算备付金		7,556,428.53
存出保证金		321,452.88
交易性金融资产	6.4.7.2	402,963,590.45
其中：股票投资		342,783,590.45
基金投资		-
债券投资		60,180,000.00
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	381,200,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,358,383.13
应收股利		839,478.06
应收申购款		548,360.49
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,028,110,810.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 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		20.87
应付赎回款		6,365,538.93
应付管理人报酬		1,323,811.66
应付托管费		220,635.29
应付销售服务费		14,379.89
应付交易费用	6.4.7.7	247,508.39

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	52,648.22
负债合计		8,224,543.25
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,049,526,578.66
未分配利润	6.4.7.10	-29,640,310.99
所有者权益合计		1,019,886,267.67
负债和所有者权益总计		1,028,110,810.92

注：本基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日，本报告期自基金合同生效日 2018 年 3 月 14 日起至 2018 年 6 月 30 日止。报告截止日 2018 年 6 月 30 日，嘉实金融精选股票 A 基金份额净值

0.9718 元，基金份额总额 1,016,368,502.51 份；嘉实金融精选股票 C 基金份额净值 0.9702 元，基金份额总额 33,158,076.15 份。基金份额总额合计为 1,049,526,578.66 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 3 月 14 日（基金合同生效日） 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-24,073,156.92
1. 利息收入		5,840,489.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,100,764.85
债券利息收入		598,882.20
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,140,842.05
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		317,150.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-977,567.68
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	1,294,718.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-30,390,769.86

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	159, 973. 46
减: 二、费用		6, 319, 266. 12
1. 管理人报酬		4, 823, 421. 53
2. 托管费		803, 903. 57
3. 销售服务费		53, 260. 47
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	594, 157. 07
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	44, 523. 48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-30, 392, 423. 04
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-30, 392, 423. 04

注:本基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日, 本期是指 2018 年 3 月 14 日至 2018 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: 嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金

本报告期: 2018 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 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)	1, 104, 988, 590. 69	-	1, 104, 988, 590. 69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-30, 392, 423. 04	-30, 392, 423. 04
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)	-55, 462, 012. 03	752, 112. 05	-54, 709, 899. 98
其中: 1. 基金申购款	4, 289, 908. 95	-64, 891. 16	4, 225, 017. 79
2. 基金赎回款	-59, 751, 920. 98	817, 003. 21	-58, 934, 917. 77
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)	1, 049, 526, 578. 66	-29, 640, 310. 99	1, 019, 886, 267. 67

注:本基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日, 本期是指 2018 年 3 月 14 日至 2018 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:

<u>经雷</u>	<u>王红</u>	<u>张公允</u>
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

嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金(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[2018]165 号《关于准予嘉实金融精选股票型发起式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《嘉实金融精选股票型发起式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 1,104,688,310.04 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(2018)第 0180 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 14 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,988,590.69 份基金份额, 其中认购资金利息折合 300,280.65 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《嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉实金融精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案, 本基金根据认购 / 申购费用、销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额类别为在投资人认购 / 申购时收取认购 / 申购费用, 且从本类别基金资产净值中不计提销售服务费的基金份额; C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费, 且不收取认购 / 申购费用的基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码, 分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购 / 申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实金融精选股票型发起式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：股票资产的比例不低于基金资产的 80%（其中投资于港股通标的股票占资产比例不高 50%，投资于本基金界定的金融产业股票不低于非现金资产的 80%）。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 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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：中证全指一级行业金融指数收益率×70% + 中债综合财富指数收益率×10% + 恒生金融行业指数收益率×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》、《嘉实金融精选股票型发起式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 2018 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2018 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、资产支持证券投资和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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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金额可供分配利润的 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。本基金同一类别的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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月26日前，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。自2017年12月26日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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 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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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

6.4.7 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。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2018年3月14日（基金合同生效日）至2018年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月14日（基金合同生效日）至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,823,421.53
其中：支付销售机构的客户维护费	2,356,311.02

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的1.50%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×1.50%/当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月14日（基金合同生效日）至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	803,903.57

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的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。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期		
	2018年3月14日（基金合同生效日）至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实金融精选股票 A	嘉实金融精选股票 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	15,122.35	15,122.35
中国银行	-	4,832.06	4,832.06
合计	-	19,954.41	19,954.41

注：（1）本基金C类份额销售服务费年费率为0.50%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.50%/当年天数。（2）本基金A类基金份额不收取销售服务费。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2018年03月14日（基金合同生效日）至2018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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	
	2018年3月14日（基金合同生效日）至2018年6月30日	
	嘉实金融精选股票 A	嘉实金融精选股票 C
基金合同生效日（2018年3月14日）	10,000,450.04	-

持有的基金份额		
期间申购/买入总份额		-
期间因拆分变动份额		-
减：期间赎回/卖出总份额		-
期末持有的基金份额	10,000,450.04	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.98%	-

注：本报告期内（2018年3月14日（基金合同生效日）至2018年6月30日），基金管理人于基金发售期内认购本基金基金份额总额10,000,450.04份，认购费1000元。

6.4.7.4.2 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（2018年6月30日）其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 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 2018年3月14日（基金合同生效日）至2018年6月 30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	233,323,117.38	1,053,595.67

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2018年3月14日（基金合同生效日）至2018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。

6.4.8 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
002120	韵达股份	2018年4月20日	2019年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	48.89	125,786	4,999,993.50	6,149,677.54	-
002120	韵达股份	2018年4月20日	2020年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	46.53	125,786	4,999,993.50	5,852,822.58	-

603105	芯能科技	2018年 6月 29日	2018年 7月 9日	未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	网下申购
603693	江苏新能	2018年 6月 25日	2018年 7月 3日	未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	网下申购
603706	东方环宇	2018年 6月 29日	2018年 7月 9日	未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	网下申购

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	342,783,590.45	33.34
	其中：股票	342,783,590.45	33.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,180,000.00	5.85

	其中：债券	60,180,000.00	5.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	381,200,000.00	37.08
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	240,879,545.91	23.43
8	其他各项资产	3,067,674.56	0.30
9	合计	1,028,110,810.92	100.00

注：本基金本报告期末无通过沪港通交易机制投资的港股；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 117,634,172.48 元，占基金资产净值的比例为 11.53%。

7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,459.26	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,002,500.12	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	199,041,852.60	19.52
K	房地产业	13,884,820.00	1.36
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	81,226.14	0.01
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	225,149,417.97	22.08

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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	86,159,731.90	8.45
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	31,474,440.58	3.09
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	117,634,172.48	11.53

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1336 HK	新华保险	1,339,900.00	36,883,715.38	3.62
2	601336	新华保险	745,416.00	31,963,438.08	3.13
3	601398	工商银行	5,917,500.00	31,481,100.00	3.09
4	1030 HK	新城发展控股	5,258,000.00	31,474,440.58	3.09
5	601318	中国平安	514,500.00	30,139,410.00	2.96
6	601939	建设银行	3,456,900.00	22,642,695.00	2.22
7	601288	农业银行	6,246,800.00	21,488,992.00	2.11
8	601601	中国太保	659,720.00	21,012,082.00	2.06
9	601009	南京银行	2,696,700.00	20,845,491.00	2.04
10	600036	招商银行	736,333.00	19,468,644.52	1.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	50,027,391.14	4.91
2	1336 HK	新华保险	41,178,652.76	4.04
3	601398	工商银行	37,698,552.00	3.70
4	601336	新华保险	33,631,407.70	3.30
5	601318	中国平安	31,494,437.96	3.09

6	1030 HK	新城发展控股	28,402,426.51	2.78
7	2328 HK	中国财险	27,319,985.17	2.68
8	601939	建设银行	27,257,804.00	2.67
9	966 HK	中国太平	22,828,388.42	2.24
10	601288	农业银行	22,440,140.00	2.20
11	601009	南京银行	21,651,252.36	2.12
12	600036	招商银行	20,998,921.13	2.06
13	600048	保利地产	16,375,148.00	1.61
14	3908 HK	中金公司	13,379,828.34	1.31
15	998 HK	中信银行	10,821,716.46	1.06
16	002120	韵达股份	9,999,987.00	0.98
17	6066 HK	中信建投证券	7,482,837.53	0.73
18	000001	平安银行	5,410,784.00	0.53
19	603259	药明康德	102,405.60	0.01
20	601066	中信建投	101,299.80	0.01

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	601601	中国太保	22,050,293.43	2.16
2	2328 HK	中国财险	16,572,069.62	1.62
3	998 HK	中信银行	9,910,290.99	0.97
4	000001	平安银行	4,889,090.00	0.48
5	603259	药明康德	615,368.70	0.06
6	601066	中信建投	211,151.20	0.02
7	603486	科沃斯	130,542.21	0.01
8	603587	地素时尚	109,200.38	0.01
9	601990	南京证券	100,625.60	0.01
10	603013	亚普股份	98,524.30	0.01
11	603045	福达合金	50,571.90	0.00

注：报告期内（2018 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日），本基金累计卖出金额前 20 名的股票明细仅包括上述 11 只股票。

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	428,914,436.32
卖出股票收入（成交）总额	54,737,728.33

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	60,180,000.00	5.90
	其中：政策性金融债	60,180,000.00	5.90
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	60,180,000.00	5.90

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	180201	18 国开 01	600,000	60,180,000.00	5.90

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1) 2018 年 1 月 29 日，南京银行股份有限公司发布《南京银行股份有限公司关于镇江分行行政处罚事项公告》，公司镇江分行收到中国银行业监督管理委员会江苏监管局行政处罚决定

书（苏银监罚决字【2018】1号），对镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款3230万元人民币。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银监罚决字（2018）1号），对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实，于2018年2月12日作出行政处罚决定，罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”、“南京银行（601009）”的决策程序说明：基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“招商银行”、“南京银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	321,452.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	839,478.06
4	应收利息	1,358,383.13
5	应收申购款	548,360.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,067,674.56

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

份额级别	持有人户	户均持有的基	持有人结构
------	------	--------	-------

	数(户)	金份额	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 (%)
嘉实金融精选股票 A	32,888	30,903.93	22,282,328.23	2.19	994,086,174.28	97.81
嘉实金融精选股票 C	1,440	23,026.44	2,000,090	6.03	31,157,986.15	93.97
合计	34,025	30,845.75	24,282,418.23	2.31	1,025,244,160.43	97.69

注：(1) 嘉实金融精选股票 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实金融精选股票 A 份额占嘉实金融精选股票 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实金融精选股票 A 份额占嘉实金融精选股票 A 总份额比例；

(2) 嘉实金融精选股票 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实金融精选股票 C 份额占嘉实金融精选股票 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实金融精选股票 C 份额占嘉实金融精选股票 C 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实金融精选股票 A	1,318,992.98	0.13
	嘉实金融精选股票 C	3.00	0.00
	合计	1,318,995.98	0.13

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情况

项目	份额级别	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	嘉实金融精选股票 A	>=100
	嘉实金融精选股票 C	0
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实金融精选股票 A	0
	嘉实金融精选股票 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.04	0.95	10,000,450.04	0.95	3年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.04	0.95	10,000,450.04	0.95	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实金融精选股票 A	嘉实金融精选股票 C
基金合同生效日（2018年3月14日）基金份额总额	1,068,140,626.04	36,847,964.65
本报告期基金总申购份额	3,732,398.19	557,510.76
减：本报告期基金总赎回份额	55,504,521.72	4,247,399.26
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	1,016,368,502.51	33,158,076.15

注：报告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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

（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	198,235,828.81	41.90%	138,765.07	41.90%	新增
东吴证券股份有限公司	3	155,067,807.38	32.77%	108,547.38	32.77%	新增
方正证券股份有限公司	5	73,831,496.09	15.60%	51,682.05	15.60%	新增
国泰君安证券股份有限公司	2	33,128,262.42	7.00%	23,190.45	7.00%	新增
国元证券股份有限公司	1	12,874,007.11	2.72%	9,011.81	2.72%	新增
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	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

有限公司						
广发证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-新增
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-新增
国海证券股份 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
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
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-新增
申万宏源证券 有限公司	3	-	-	-	-	-新增
天风证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-新增

西南证券股份 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
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
中国国际金融 股份有限公司	3	-	-	-	-	-	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	4	-	-	-	-	-	新增
中信证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-	新增
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	新增
长城证券股份	3	-	-	-	-	-	新增

有限公司						
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
中银国际证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	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

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
华泰证券 股份有限公司	-	-	3,620,500,000.00	60.19%	-	-
方正证券 股份有限公司	-	-	778,200,000.00	12.94%	-	-

国元证券 股份有限 公司	-	-	1,616,500,000.00	26.87%	-	-
--------------------	---	---	------------------	--------	---	---

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

2018 年 8 月 25 日