

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2019 年 半年度报告

2019 年 06 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：2019 年 08 月 29 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 2019 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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	6
2.4 境外资产托管人	7
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14

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	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	61
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	62
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前所有资产支持证券投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	62

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	62
7.11 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 备查文件目录	69
11.1 备查文件目录	69
11.2 存放地点	69
11.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票（QDII）	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 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	237,812,610.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-美元现汇
下属分级基金的交易代码	000043	000044
报告期末下属分级基金的份 额总额	233,893,347.80 份	3,919,262.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。其中，核心模型包括成长性模型、多因子 Alpha 模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。
业绩比较基准	95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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
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		经雷	刘连舸

2.4 境外资产托管人

本基金基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人。本基金的境外资产托管业务由基金托管人中国银行股份有限公司承担。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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

2.6 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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
本期已实现收益	-7,117,799.21	-665,059.18
本期利润	79,510,929.61	7,542,834.52
加权平均基金份额本期利润	0.3017	1.8308
本期加权平均净值利润率	16.35%	16.24%

本期基金份额净值增长率	17.95%	17.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	48,440,994.45	7,994,767.43
期末可供分配基金份额利润	0.2071	2.0399
期末基金资产净值	462,563,665.01	47,285,879.11
期末基金份额净值	1.978	1.755
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	97.80%	75.50%

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）嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额以人民币申购获得人民币份额，赎回获得人民币赎回款；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额以美元申购获得美元份额，赎回获得美元赎回款；（3）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（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）嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

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	5.66%	0.97%	6.42%	0.91%	-0.76%	0.06%
过去三个月	6.34%	0.87%	4.10%	0.84%	2.24%	0.03%
过去六个月	17.95%	0.91%	19.60%	0.91%	-1.65%	0.00%
过去一年	8.80%	1.19%	9.70%	1.13%	-0.90%	0.06%
过去三年	51.45%	0.95%	54.58%	0.86%	-3.13%	0.09%
自基金合同生效起至今	97.80%	0.90%	106.19%	0.84%	-8.39%	0.06%

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

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	5.98%	0.95%	6.42%	0.91%	-0.44%	0.04%
过去三个月	4.09%	0.86%	4.10%	0.84%	-0.01%	0.02%
过去六个月	17.63%	0.89%	19.60%	0.91%	-1.97%	-0.02%
过去一年	4.40%	1.17%	9.70%	1.13%	-5.30%	0.04%
过去三年	45.16%	0.92%	54.58%	0.86%	-9.42%	0.06%
自基金合同生 效起至今	75.50%	0.88%	106.19%	0.84%	-30.69%	0.04%

注：本基金业绩比较基准为：95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}(t)$$

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

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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币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：嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币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

（2013 年 6 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日）

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇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：嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇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

（2013 年 6 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（三）投资范围和（九）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、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 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（QDII）混合、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）、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、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、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、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、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、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、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、嘉实战略配售

混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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、嘉实事件驱动股票基金经理	2013年6月14日		23年	理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学。曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

注：（1）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、《嘉实美国成长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 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

2019 年上半年度，美国股票市场经历 18 年四季度的回撤后，快速上行，并创出美股历史新高。

美国实体经济数据，连续保持稳健向好，为美股市场投资者的风险偏好提升建立了基础，同时上市公司的业绩增速也稳健向好，是美股上行但估值保持稳定的根本动力。

上半年内，在五一期间发生的中美贸易摩擦升级，超出市场预期，美股在整个 5 月份经历回调，释放风险，其后在较好的经济数据、美联储鸽派转向的概率增大的背景下，在 6 月上行，部分指数创出历史新高。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了正超额收益，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响，组合净值层面的收益略有减损。

本基金以大盘成长股为投资方向，在行业上依然主要配置于信息技术、生物医药等行业，并以高科技行业内的龙头企业为主要配置，此外还配置非必须消费品等行业。

本报告期间，本基金运作主要包括应对净申购造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申购的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金在保证 90%股票仓位和 5%现金仓位的合规约束下，实现了流动性的稳健管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 1.978 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.95%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 1.755 美元，本报告期基金份额净值增长率为 17.63%；业绩比较基准收益率为 19.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，当前仍然是投资美股较好的进入机会，核心逻辑是建立在美国实体经济表现强劲、上市公司企业盈利依然稳健、美联储有增大的概率结束鹰派货币政策而转向鸽派。

宏观背景上，美国在全球产业链的顶层位置，高科技企业获取全球产业链最大的利润比例，同时美国能源资源及农产品独立不需要进口，科技水平全面领先，本届特朗普政府的减税政策和潜在的进一步刺激空间、美联储退出加息进程概率的增加和部分产业回流，以及美国近期披露的经济增长速度和失业率都非常靓丽，美股有较为坚实的实体经济基础。

在股票市场层面，随着美股整体上盈利能力的持续向好，企业盈利将足以消化此前持续上行的市场趋势，而四季度的大幅回调，则使估值水平进一步回落到历史平均位置，实质上减少了市场泡沫化的风险，从而在 19 年上半年度内有了再次上涨并突破历史高点的基础。

在风险层面，我们认为特朗普政府发动的所谓贸易战以及美国的贸易保护主义和当前呈现的贸易收缩态势，以及美国国内两党为下次大选提前布局的党争等事件，都不利于美国实体经济的进一步增长，也为资本市场的风险偏好带来不确定因素，是股票市场的重大宏观风险来源之一。

在行业层面，我们依然倾向于成长风格，科技、生物等依然是投资者最关注的区域，此外，随着减税政策的落地、GDP 增加和失业率降低，美国社会的消费水平逐步上升，消费板块的部分优秀区域也成为较好的增长点。

后续，我们将根据合同要求保持高仓位水平，坚持量化框架的纪律化操作，并积极调整和优化模型，控制风险，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

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；与估值相关的机构为纽约、纳斯达克交易所以及境内相关机构等。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实美国成长股票型证券投资基金（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：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	51,085,911.73	62,797,855.70
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	478,730,919.48	487,578,962.75
其中：股票投资		475,814,034.45	483,190,921.68
基金投资		2,916,885.03	4,388,041.07
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		-	10,004,819.71
应收利息	6.4.7.5	5,107.06	5,745.70
应收股利		209,809.74	297,641.73
应收申购款		3,584,518.67	6,711,003.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		533,616,266.68	567,396,029.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	-
应付赎回款		22,678,707.10	49,807,961.39
应付管理人报酬		766,552.35	857,947.37
应付托管费		149,051.83	166,823.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	172,411.28	401,850.97
负债合计		23,766,722.56	51,234,582.82
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	258,038,436.98	308,021,491.99
未分配利润	6.4.7.10	251,811,107.14	208,139,954.51
所有者权益合计		509,849,544.12	516,161,446.50
负债和所有者权益总计		533,616,266.68	567,396,029.32

注：报告截止日2019年6月30日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值1.978元，基金份额总额233,893,347.80份；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净

值 1.755 美元, 基金份额总额 3,919,262.56 份。基金份额总额合计为 237,812,610.36 份。

6.2 利润表

会计主体: 嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		92,845,282.75	16,676,494.91
1. 利息收入		68,386.88	28,151.10
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	68,386.88	28,151.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-2,672,393.49	-591,380.37
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-5,175,229.90	-991,378.94
基金投资收益	6.4.7.13	-210,769.00	-383,130.36
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	21,018.70
股利收益	6.4.7.16	2,713,605.41	762,110.23
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	94,836,622.52	16,999,995.00
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	55,534.27	83,565.19
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	557,132.57	156,163.99
减: 二、费用		5,791,518.62	1,935,019.31
1. 管理人报酬		4,763,021.61	1,522,294.09
2. 托管费		926,143.06	296,001.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,566.00	1,570.66
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.96	-

7. 其他费用	6. 4. 7. 20	95, 784. 99	115, 153. 01
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		87, 053, 764. 13	14, 741, 475. 60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		87, 053, 764. 13	14, 741, 475. 60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 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)	308, 021, 491. 99	208, 139, 954. 51	516, 161, 446. 50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	87, 053, 764. 13	87, 053, 764. 13
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）	-49, 983, 055. 01	-43, 382, 611. 50	-93, 365, 666. 51
其中：1. 基金申购款	163, 393, 637. 59	137, 309, 710. 30	300, 703, 347. 89
2. 基金赎回款	-213, 376, 692. 60	-180, 692, 321. 80	-394, 069, 014. 40
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)	258, 038, 436. 98	251, 811, 107. 14	509, 849, 544. 12
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 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)	87, 106, 320. 84	56, 723, 479. 82	143, 829, 800. 66

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	14,741,475.60	14,741,475.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	27,535,305.74	21,970,191.53	49,505,497.27
其中：1. 基金申购款	98,260,488.31	71,711,172.77	169,971,661.08
2. 基金赎回款	-70,725,182.57	-49,740,981.24	-120,466,163.81
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）	114,641,626.58	93,435,146.95	208,076,773.53

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：

经雷

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

嘉实美国成长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[2013]14 号《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,918,336.37 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 352 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 477,029,933.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 111,596.72 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《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和《嘉实美国成长股票型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、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于下列金融产品或工具：银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；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要求）。本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金主要投资于美国发行、上市的大盘成长型股票，所投资比例不低于权益类资产的 80%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率} + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}$ 。

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》、《嘉实美国成长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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：（1）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。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。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。（2）目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。（3）目前基金取得的源自境外的其他收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。（4）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019年6月30日
----	-------------------

活期存款	51,085,911.73
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	51,085,911.73

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 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	405,893,182.89	475,814,034.45	69,920,851.56
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	2,835,029.19	2,916,885.03	81,855.84
其他	-	-	-
合计	408,728,212.08	478,730,919.48	70,002,707.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末(2019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(2019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(2019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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,104.41
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.65
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	5,107.06

6.4.7.6 其他资产

本期末（2019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

本期末（2019年6月30日），本基金无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	80,455.19
预提费用	91,956.09
合计	172,411.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	282,208,216.72	282,208,216.72
本期申购	161,214,925.02	161,214,925.02
本期赎回（以“-”号填列）	-209,529,793.94	-209,529,793.94
本期末	233,893,347.80	233,893,347.80

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,189,957.79	25,813,275.27
本期申购	353,622.19	2,178,712.57
本期赎回（以“-”号填列）	-624,317.42	-3,846,898.66
本期末	3,919,262.56	24,145,089.18

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,410,707.07	125,629,902.94	191,040,610.01
本期利润	-7,117,799.21	86,628,728.82	79,510,929.61
本期基金份额交易产生的变动数	-9,851,913.41	-32,029,309.00	-41,881,222.41
其中：基金申购款	33,343,380.14	102,199,099.28	135,542,479.42
基金赎回款	-43,195,293.55	-134,228,408.28	-177,423,701.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,440,994.45	180,229,322.76	228,670,317.21
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,196,069.70	7,903,274.80	17,099,344.50
本期利润	-665,059.18	8,207,893.70	7,542,834.52
本期基金份额交易产生的变动数	-536,243.09	-965,146.00	-1,501,389.09
其中：基金申购款	726,734.46	1,040,496.42	1,767,230.88
基金赎回款	-1,262,977.55	-2,005,642.42	-3,268,619.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,994,767.43	15,146,022.50	23,140,789.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	68,275.99
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	-
其他	110.89
合计	68,386.88

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	245,850,965.77
减：卖出股票成本总额	251,027,242.76
减：买卖股票差价收入应缴纳增值税额	-1,047.09
买卖股票差价收入	-5,175,229.90

注：本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）“卖出股票成交总额”、“卖出股票成本总额”、“买卖股票差价收入应缴纳增值税额”、“买卖股票差价收入”包含投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）的情况。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	6,819,909.26
减：卖出/赎回基金成本总额	7,029,604.32
减：基金投资收益应缴纳增值税额	1,073.94
基金投资收益	-210,769.00

6.4.7.14 债券投资收益

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,713,596.00
基金投资产生的股利收益	9.41
合计	2,713,605.41

注：本期(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日)“股票投资产生的股利收益”包含投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）产生的收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	94,836,622.52
股票投资	95,123,266.03
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-286,643.51
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	94,836,622.52

注: 本期(2019年1月1日至2019年6月30日)“交易性金融资产—股票投资”包含投资房地产信托凭证(简称REITs)的情况。

6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	557,132.57
其他	-
合计	557,132.57

6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	6,566.00
银行间市场交易费用	-
合计	6,566.00

6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	57,243.91
银行划款手续费	3,828.90
合计	95,784.99

6.4.7.21 汇兑收益

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
汇兑收益	55,534.27
合计	55,534.27

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
德意志银行股份有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
德意志银行股份有限公司	392,277,648.58	100.00	117,001,565.94	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例(%)
德意志银行股份有限公司	11,067,235.30	100.00	5,858,369.48	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
德意志银行股份有限公司	2,457.40	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
德意志银行股份有限公司	768.39	100.00	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,763,021.61
其中:支付销售机构的客户维护费	1,761,276.92	560,910.35

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8%/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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	926,143.06	296,001.55

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.35%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.35%/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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1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。

6.4.10.4 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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年6月30日)及上年度末(2018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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
中国银行股份有限公司_活期	51,085,911.73	68,275.99	18,630,445.33	27,997.72

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1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。

6.4.11 利润分配情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2019 年 06 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

本期末（2019 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（2019 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（2019 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（2019 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

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。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主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建等方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。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境内和境外托管人，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与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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或柜台市场交易，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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2019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	51,085,911.73	-	-	-	51,085,911.73
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-478,730,919.48	478,730,919.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	5,107.06	5,107.06
应收股利	-	-	-	209,809.74	209,809.74
应收申购款	8,256.28	-	-	3,576,262.39	3,584,518.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	51,094,168.01	-	-	-482,522,098.67	533,616,266.68
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-22,678,707.10	22,678,707.10
应付管理人报酬	-	-	-	766,552.35	766,552.35
应付托管费	-	-	-	149,051.83	149,051.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	172,411.28	172,411.28
负债总计	-	-	-	-23,766,722.56	23,766,722.56
利率敏感度缺口	51,094,168.01	-	-	-458,755,376.11	509,849,544.12
上年度末 2018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	62,797,855.70	-	-	-	62,797,855.70
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-487,578,962.75	487,578,962.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,004,819.71	10,004,819.71
应收利息	-	-	-	5,745.70	5,745.70
应收股利	-	-	-	297,641.73	297,641.73
应收申购款	23,216.73	-	-	6,687,787.00	6,711,003.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产总计	62,821,072.43	-	-504,574,956.89	567,396,029.32
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	49,807,961.39	49,807,961.39
应付管理人报酬	-	-	857,947.37	857,947.37
应付托管费	-	-	166,823.09	166,823.09
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	401,850.97	401,850.97
负债总计	-	-	51,234,582.82	51,234,582.82
利率敏感度缺口	62,821,072.43	-	-453,340,374.07	516,161,446.50

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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：无）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 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。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				

银行存款	22,495,377.60	-	-	22,495,377.60
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	478,730,919.48	-	-	478,730,919.48
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	209,809.74	-	-	209,809.74
应收利息	1,636.18	-	-	1,636.18
应收申购款	19,708.39	-	-	19,708.39
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	501,457,451.39	-	-	501,457,451.39
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	1,200,045.43	-	-	1,200,045.43
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	2,230.63	-	-	2,230.63
负债合计	1,202,276.06	-	-	1,202,276.06
资产负债表外汇风险敞口净额	500,255,175.33	-	-	500,255,175.33
项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	53,556,645.93	-	-	53,556,645.93

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	487,578,962.75	-	-	487,578,962.75
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	297,641.73	-	-	297,641.73
应收利息	1,996.99	-	-	1,996.99
应收申购款	147,406.99	-	-	147,406.99
应收证券清算款	10,004,819.71	-	-	10,004,819.71
其它资产	-	-	-	-
资产合计	551,587,474.10	-	-	551,587,474.10
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	393,966.49	-	-	393,966.49
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	810.68	-	-	810.68
负债合计	394,777.17	-	-	394,777.17
资产负债表外汇风险敞口净额	551,192,696.93	-	-	551,192,696.93

6.4.13.4.2.2 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		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	25,012,758.77	27,559,634.85
	所有外币相对人民币贬值5%	-25,012,758.77	-27,559,634.85

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 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	475,814,034.45	93.32	483,190,921.68	93.61
交易性金融资产—基金投资	2,916,885.03	0.57	4,388,041.07	0.85
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	478,730,919.48	93.90	487,578,962.75	94.46

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		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	

分析	业绩比较基准上升 5%	24,656,371.25	28,534,453.91
	业绩比较基准下降 5%	-24,656,371.25	-28,534,453.91

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 478,730,919.48 元，无属于第二、第三层次的余额（上年度末：第一层次 487,578,962.75 元，无属于第二、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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) 除公允价值外，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	475,814,034.45	89.17
	其中：普通股	461,600,784.00	86.50
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	14,213,250.45	2.66
2	基金投资	2,916,885.03	0.55
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	51,085,911.73	9.57
8	其他各项资产	3,799,435.47	0.71
9	合计	533,616,266.68	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	475,814,034.45	93.32
合计	475,814,034.45	93.32

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
股票通信服务	58,263,318.17	11.43
股票非必需消费品	75,155,345.24	14.74
股票必需消费品	24,264,041.36	4.76

股票能源	2,316,096.05	0.45
股票金融	17,411,572.09	3.42
股票医疗保健	56,025,683.95	10.99
股票工业	37,160,442.17	7.29
股票信息技术	183,138,607.81	35.92
股票原材料	4,084,961.47	0.80
股票公用事业	3,780,715.69	0.74
房地产信托多元化类	855,670.13	0.17
房地产信托医疗保健类	28,043.62	0.01
房地产信托工业类	1,928,162.37	0.38
房地产信托住宅类	679,853.52	0.13
房地产信托零售类	616,392.48	0.12
房地产信托特殊类	10,105,128.33	1.98
合计	475,814,034.45	93.32

注:本基金持有的权益投资采用全球行业分类标准 (GICS) 进行行业分类。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位: 人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证券市 场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Microsoft Corp	微软	MSFT U W	纳斯达克证 券交易所	美国	42,419	39,065,133.79	7.66
2	Apple Inc	苹果公 司	AAPL U W	纳斯达克证 券交易所	美国	23,798	32,380,525.57	6.35
3	Amazon.com Inc	亚马逊 公司	AMZN U W	纳斯达克证 券交易所	美国	2,166	28,197,287.26	5.53
4	Alphabet Inc	Alphab et 公 司	GOOGL UW	纳斯达克证 券交易所	美国	2,772	20,634,560.54	4.05
5	Facebook Inc	Facebo ok 公 司	FB UW	纳斯达克证 券交易所	美国	13,317	17,669,223.32	3.47
6	Visa Inc	维萨公 司	V UN	纽约证券交 易所	美国	10,318	12,310,448.98	2.41
7	Mastercard Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证券交 易所	美国	5,274	9,591,108.60	1.88
8	UnitedHealth Group Inc	联合健 康	UNH UN	纽约证券交 易所	美国	4,176	7,005,221.40	1.37
9	Home Depo	家得宝	HD UN	纽约证券交	美国	4,880	6,977,089.03	1.37

	t Inc/The			易所				
10	Adobe Inc	奥多比	ADBE U W	纳斯达克证 券交易所	美国	3,420	6,927,655.81	1.36
11	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP U W	纳斯达克证 券交易所	美国	7,621	6,870,174.59	1.35
12	American Tower Corp	美国发 射塔公 司	AMT U N	纽约证券交 易所	美国	3,680	5,172,359.29	1.01
13	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股 份有限 公司	PYPL U W	纳斯达克证 券交易所	美国	6,398	5,034,446.48	0.99
14	Starbucks Corp	星巴克 -T	SBUX U W	纳斯达克证 券交易所	美国	8,646	4,982,742.55	0.98
15	Walt Disney Co/The	华特迪 士尼公 司	DIS U N	纽约证券交 易所	美国	4,944	4,746,156.49	0.93
16	Netflix Inc	奈飞公 司	NFLX U W	纳斯达克证 券交易所	美国	1,875	4,734,777.76	0.93
17	Costco Wholesale Corp	好市多 批发	COST U W	纳斯达克证 券交易所	美国	2,479	4,503,619.68	0.88
18	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有 限公司	VEEV U N	纽约证券交 易所	美国	3,966	4,419,938.91	0.87
19	NIKE Inc	耐克公 司	NKE U N	纽约证券交 易所	美国	7,604	4,388,504.62	0.86
20	Honeywell International Inc	霍尼韦 尔	HON U N	纽约证券交 易所	美国	3,595	4,314,912.67	0.85
21	Boeing Co /The	波音	BA U N	纽约证券交 易所	美国	1,669	4,176,604.98	0.82
22	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU U W	纳斯达克证 券交易所	美国	2,223	3,993,764.78	0.78
23	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP U N	纽约证券交 易所	美国	3,323	3,863,255.06	0.76
24	Lockheed Martin Corp	洛克希 德马丁	LMT U N	纽约证券交 易所	美国	1,459	3,646,374.29	0.72
25	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA U W	纳斯达克证 券交易所	美国	3,182	3,592,579.76	0.70

26	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	2,688	3,414,400.60	0.67
27	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	3,905	3,313,833.64	0.65
28	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,038	3,185,742.03	0.62
29	Twilio Inc	Twilio 股份有限公司	TWLO UN	纽约证券交易所	美国	3,213	3,011,754.85	0.59
30	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	8,530	2,986,009.45	0.59
31	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	3,776	2,946,071.84	0.58
32	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	3,074	2,914,216.95	0.57
33	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,265	2,869,459.91	0.56
34	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证券交易所	美国	2,369	2,715,392.17	0.53
35	salesforce.com Inc	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	2,519	2,627,564.44	0.52
36	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约证券交易所	美国	509	2,564,510.04	0.50
37	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	6,867	2,496,388.91	0.49
38	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统	CDNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,054	2,460,274.60	0.48

	c	股份有 限公司						
39	Progressiv e Corp/ The	前进保 险公司	PGR UN	纽约证券交 易所	美国	4,188	2,301,284.10	0.45
40	HEICO Cor p	海科航 空公司	HEI UN	纽约证券交 易所	美国	2,434	2,239,045.38	0.44
41	Bruker Co rp	布鲁克 公司	BRKR U W	纳斯达克证 券交易所	美国	6,472	2,222,428.27	0.44
42	Square In c	Square 股份有 限公司	SQ UN	纽约证券交 易所	美国	4,454	2,220,862.35	0.44
43	ServiceNow Inc	Service Now 公司	NOW UN	纽约证券交 易所	美国	1,163	2,195,262.96	0.43
44	Ensign Gr oup Inc /The	Ensign 集团股 份有限 公司	ENSG U W	纳斯达克证 券交易所	美国	5,463	2,137,715.19	0.42
45	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交 易所	美国	3,707	2,136,876.41	0.42
46	Okta Inc	Okta Inc	OKTA U W	纳斯达克证 券交易所	美国	2,505	2,126,980.96	0.42
47	Live Nati on Ente rtainment Inc	Live Nation 娱乐 公司	LYV UN	纽约证券交 易所	美国	4,549	2,071,836.93	0.41
48	Yum! Bran ds Inc	百胜全 球餐饮	YUM UN	纽约证券交 易所	美国	2,672	2,032,919.19	0.40
49	Fiserv In c	Fiserv 公司	FISV U W	纳斯达克证 券交易所	美国	3,164	1,982,871.37	0.39
50	VeriSign Inc	威瑞信 股份有 限公司	VRSN U W	纳斯达克证 券交易所	美国	1,364	1,961,312.31	0.38
51	Broadcom Inc	博通股 份有限 公司	AVGO U W	纳斯达克证 券交易所	美国	981	1,941,351.07	0.38
52	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI U N	纽约证券交 易所	美国	1,176	1,930,532.90	0.38
53	Aon PLC	怡安保 险	AON UN	纽约证券交 易所	美国	1,433	1,901,131.88	0.37
54	Intuitive Surgical Inc	直觉外 科手术 公司	ISRG U W	纳斯达克证 券交易所	美国	506	1,824,698.69	0.36

55	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	1,272	1,797,718.65	0.35
56	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	2,347	1,787,587.89	0.35
57	Americold Realty Trust	Americold Realty Trust	COLD UN	纽约证券交易所	美国	7,969	1,776,112.98	0.35
58	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,353	1,747,187.96	0.34
59	Zendesk Inc	Zendesk 公司	ZEN UN	纽约证券交易所	美国	2,844	1,740,683.11	0.34
60	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	5,882	1,737,981.63	0.34
61	IAC/InteractiveCorp	IAC/Interactive 公司	IAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,157	1,730,239.69	0.34
62	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,091	1,686,366.93	0.33
63	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	832	1,565,495.68	0.31
64	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约证券交易所	美国	6,357	1,547,504.39	0.30
65	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	569	1,545,827.31	0.30
66	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	1,657	1,539,658.64	0.30
67	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,354	1,538,948.48	0.30
68	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,504	1,514,330.32	0.30
69	Paycom Software	Paycom	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	964	1,502,521.23	0.29

	ftware Inc	软件股 份有限 公司	N		易所				
70	Insperty Inc	Insperty 股份有限 公司	NSP UN		纽约证券交 易所	美国	1,765	1,482,027.89	0.29
71	Lululemon Athlet ica Inc	Lulule mon Athl etica 股份有限	LULU U W		纳斯达克证 券交易所	美国	1,185	1,468,084.28	0.29
72	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN		纽约证券交 易所	美国	1,010	1,441,876.20	0.28
73	Incyte Co rp	Incyte 有限 公司	INCY U W		纳斯达克证 券交易所	美国	2,446	1,428,646.26	0.28
74	Tetra Tec h Inc	Tetra 科技有 限公司	TTEK U W		纳斯达克证 券交易所	美国	2,619	1,414,280.13	0.28
75	IDEXX Lab oratories Inc	爱德士 股份有 限公司	IDXX U W		纳斯达克证 券交易所	美国	746	1,412,037.12	0.28
76	Estee Lau der Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL UN		纽约证券交 易所	美国	1,108	1,394,779.56	0.27
77	Norfolk S outhern Corp	诺福克 南方	NSC UN		纽约证券交 易所	美国	1,017	1,393,629.63	0.27
78	Advanced Micro D evices In c	AMD 公 司	AMD UR		纳斯达克证 券交易所	美国	6,522	1,361,693.42	0.27
79	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW		纳斯达克证 券交易所	美国	2,541	1,351,546.56	0.27
80	Booz Alle n Hamil ton Holdi ng Corp	博思艾 伦咨询 控股公 司	BAH UN		纽约证券交 易所	美国	2,913	1,325,921.53	0.26
81	Kimberly-C lark Co rp	金佰利	KMB UN		纽约证券交 易所	美国	1,447	1,325,828.24	0.26
82	Bright Ho	光明地	BFAM U		纽约证券交	美国	1,245	1,291,296.56	0.25

	rizons Family Solutions Inc	平线家庭解决方案股份有	N		易所				
83	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN		纽约证券交易所	美国	169	1,277,390.96	0.25
84	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS UN		纽约证券交易所	美国	648	1,276,569.09	0.25
85	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST W U		纳斯达克证券交易所	美国	1,867	1,272,211.63	0.25
86	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD W U		纳斯达克证券交易所	美国	2,662	1,236,378.50	0.24
87	Nexstar Media Group Inc	Nexstar 媒体集团股份有限公司	NXST W U		纳斯达克证券交易所	美国	1,749	1,214,408.88	0.24
88	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN W U		纳斯达克证券交易所	美国	1,346	1,212,003.29	0.24
89	AbbVie Inc	艾伯维生物制药公司	ABBV N U		纽约证券交易所	美国	2,416	1,207,826.49	0.24
90	FleetCor Technologies Inc	FleetCor 技术公司	FLT UN		纽约证券交易所	美国	621	1,199,001.65	0.24
91	Altria Group Inc	高特利	MO UN		纽约证券交易所	美国	3,682	1,198,553.76	0.24
92	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD UN		纽约证券交易所	美国	2,359	1,184,844.51	0.23
93	Applied Materials Inc	应用材料股份有限公司	AMAT W U		纳斯达克证券交易所	美国	3,812	1,176,927.47	0.23
94	Ulta Beauty	Ulta	ULTA U		纳斯达克证	美国	488	1,163,765.17	0.23

	ty Inc	美容产品公司	W		券交易所				
95	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG	UN	纽约证券交易所	美国	2,425	1,141,140.05	0.22
96	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX	UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,998	1,130,306.69	0.22
97	Ecolab Inc	艺康化工	ECL	UN	纽约证券交易所	美国	822	1,115,734.11	0.22
98	American States Water Co	美洲国家水务公司	AWR	UN	纽约证券交易所	美国	2,111	1,091,919.88	0.21
99	L3Harris Technologies Inc	哈里斯公司	HRS	UN	纽约证券交易所	美国	837	1,088,277.45	0.21
100	Roper Technologies Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP	UN	纽约证券交易所	美国	427	1,075,155.09	0.21
101	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS	UN	纽约证券交易所	美国	1,187	1,046,717.69	0.21
102	Globant SA	Globant 股份有限公司	GLOB	UN	纽约证券交易所	美国	1,504	1,044,811.41	0.20
103	Euronet Worldwide Inc	Euronet 全球公司	EEFT	UN	纳斯达克证券交易所	美国	901	1,042,096.17	0.20
104	Public Storage	公共存储公司	PSA	UN	纽约证券交易所	美国	631	1,033,166.15	0.20
105	Waste Management Inc	废品管理	WM	UN	纽约证券交易所	美国	1,286	1,019,970.50	0.20
106	Biogen Inc	百健	BIIB	UN	纳斯达克证券交易所	美国	633	1,017,728.59	0.20
107	LendingTree Inc	LendingTree 公司	TREE	UN	纳斯达克证券交易所	美国	351	1,013,540.66	0.20
108	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW	UN	纽约证券交易所	美国	1,441	999,659.13	0.20
109	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公	CDW	UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,302	993,545.39	0.19

		司						
110	Hershey Co/The	好时食品	HSY UN	纽约证券交易所	美国	1,075	990,522.24	0.19
111	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,044	970,140.34	0.19
112	Maxim Integrated Products Inc	美信	MXIM UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,356	968,892.17	0.19
113	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE UW	纳斯达克证券交易所	美国	549	959,706.20	0.19
114	Aspen Technology Inc	艾斯本科技公司	AZPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,122	958,623.02	0.19
115	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	869	956,634.92	0.19
116	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	616	946,311.80	0.19
117	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	284	944,578.28	0.19
118	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	216	908,438.81	0.18
119	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,342	907,522.27	0.18
120	Crown Castle International Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	1,011	905,974.43	0.18
121	Under Armour Inc	安德玛公司	UAA UN	纽约证券交易所	美国	5,041	878,513.44	0.17
122	AES Corp/VA	爱伊斯	AES UN	纽约证券交易所	美国	7,586	874,058.71	0.17
123	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,298	871,009.23	0.17
124	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,057	867,849.00	0.17

125	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands 家庭与安全用品	FBHS UN	纽约证券交易所	美国	2,204	865,624.55	0.17
126	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约证券交易所	美国	2,624	864,799.86	0.17
127	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	869	855,134.72	0.17
128	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,120	844,268.16	0.17
129	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	11,683	843,329.76	0.17
130	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约证券交易所	美国	1,742	838,181.16	0.16
131	KLA-Tencor Corp	Kla-Tencor 公司	KLAC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,012	822,340.61	0.16
132	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	647	821,710.75	0.16
133	SPS Commerce Inc	SPS 商业股份有限公司	SPSC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,153	810,170.54	0.16
134	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约证券交易所	美国	1,328	797,470.70	0.16
135	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,061	793,593.37	0.16
136	Armstrong World Industries Inc	阿姆斯壮世界工业有限公司	AWI UN	纽约证券交易所	美国	1,180	788,500.59	0.15
137	Thermo Fisher	Thermo	TMO UN	纽约证券交易所	美国	390	787,395.14	0.15

	sher Scientific Inc	Fisher Scientific 公司		易所				
138	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	纽约证券交易所	美国	698	772,085.18	0.15
139	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	347	766,754.13	0.15
140	Ingersoll-Rand PLC	英格索兰	IR UN	纽约证券交易所	美国	878	764,578.42	0.15
141	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	1,582	758,367.82	0.15
142	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	538	757,544.92	0.15
143	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	291	738,838.58	0.14
144	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	405	738,662.45	0.14
145	Twitter Inc	推特公司	TWTR UN	纽约证券交易所	美国	2,971	712,823.21	0.14
146	Everbridge Inc	Everbridge 股份有限公司	EVBG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,155	710,019.70	0.14
147	PS Business Parks Inc	PS 商业园股份有限公司	PSB UN	纽约证券交易所	美国	610	706,741.85	0.14
148	New York Times Co/The	纽约时报	NYT UN	纽约证券交易所	美国	3,133	702,583.75	0.14
149	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	924	701,857.10	0.14
150	Hill-Rom	美国屹	HRC UN	纽约证券交	美国	951	683,988.79	0.13

	Holdings Inc	龙国际有限公司		易所				
151	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	889	683,277.81	0.13
152	Anaplan Inc	Anaplan Inc	PLAN UN	纽约证券交易所	美国	1,963	681,094.47	0.13
153	Equity Lifestyle Properties Inc	Equity Lifestyle 房地产公司	ELS UN	纽约证券交易所	美国	815	679,853.52	0.13
154	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证券交易所	美国	853	673,904.57	0.13
155	Fortinet Inc	飞塔股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,269	670,264.48	0.13
156	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UW	纳斯达克证券交易所	美国	826	669,608.98	0.13
157	ServiceMaster Global Holdings Inc	ServiceMaster 全球控股公司	SERV UN	纽约证券交易所	美国	1,843	659,984.06	0.13
158	Charles River Laboratories International Inc	查理斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	659	642,867.63	0.13
159	Paylocity Holding Corp	Paylocity 控股公司	PCTY UW	纳斯达克证券交易所	美国	986	635,954.57	0.12
160	Planet Fitness Inc	Planet 健身股份有限公司	PLNT UN	纽约证券交易所	美国	1,274	634,456.16	0.12
161	Hexcel Corp	Hexcel 公司	HXL UN	纽约证券交易所	美国	1,141	634,425.36	0.12
162	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	2,639	628,994.70	0.12

	ial							
163	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约证券交易所	美国	516	616,812.38	0.12
164	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证券交易所	美国	1,300	616,392.48	0.12
165	Amedisys Inc	Amedisys 股份有限公司	AMED U W	纳斯达克证券交易所	美国	735	613,473.14	0.12
166	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN U W	纳斯达克证券交易所	美国	242	612,482.83	0.12
167	Cisco Systems Inc	思科-T	CSCO U W	纳斯达克证券交易所	美国	1,616	608,023.77	0.12
168	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI U W	纳斯达克证券交易所	美国	1,861	603,868.15	0.12
169	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	862	603,325.18	0.12
170	Bio-Techne Corp	Bio-technique 公司	TECH U W	纳斯达克证券交易所	美国	420	601,988.61	0.12
171	Coupa Software Inc	Coupa 软件股份有限公司	COUP U W	纳斯达克证券交易所	美国	690	600,579.98	0.12
172	Becton Dickinson and Co	碧迪	BDX UN	纽约证券交易所	美国	345	597,710.14	0.12
173	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	997	593,631.51	0.12
174	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	375	593,226.46	0.12

175	Match Group Inc	Match 集团股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,282	592,875.09	0.12
176	Zscaler Inc	Zscaler Inc	ZS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,108	583,779.72	0.11
177	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	168	582,429.53	0.11
178	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	583	581,794.04	0.11
179	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	278	573,636.65	0.11
180	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约证券交易所	美国	294	570,392.07	0.11
181	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	644	569,750.11	0.11
182	DENTSPLY SIRONA Inc	登士柏西诺德公司	XRAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,410	565,702.56	0.11
183	Lennox International Inc	Lennox 国际股份有限公司	LII UN	纽约证券交易所	美国	297	561,491.12	0.11
184	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约证券交易所	美国	946	554,485.53	0.11
185	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	1,144	550,761.92	0.11
186	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,082	545,236.58	0.11
187	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	377	542,948.20	0.11
188	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UN	纽约证券交易所	美国	234	541,948.14	0.11
189	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	592	539,780.54	0.11
190	Lennar Co	Lennar	LEN UN	纽约证券交	美国	1,601	533,369.89	0.10

	rp	公司		易所				
191	Autodesk Inc	欧特克	ADSK U W	纳斯达克证 券交易所	美国	475	531,947.10	0.10
192	Celanese Corp	塞拉尼 斯公司	CE UN	纽约证券交 易所	美国	717	531,363.44	0.10
193	Wayfair Inc	Wayfair 股 份有限公 司	W UN	纽约证券交 易所	美国	524	525,942.05	0.10
194	JM Smucker Co/The	JM 斯 马克公 司	SJM UN	纽约证券交 易所	美国	661	523,443.71	0.10
195	Varian Medical Systems Inc	瓦里安 医疗设 备有限 公司	VAR UN	纽约证券交 易所	美国	555	519,398.37	0.10
196	Hanesbrands Inc	汉佰有 限公司	HBI UN	纽约证券交 易所	美国	4,196	496,732.27	0.10
197	HubSpot Inc	HubSpot 公 司	HUBS U N	纽约证券交 易所	美国	409	479,460.00	0.09
198	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交 易所	美国	1,737	478,490.05	0.09
199	Marathon Oil Corp	Marathon 石 油公司	MRO UN	纽约证券交 易所	美国	4,826	471,449.46	0.09
200	Chemed Corp	Chemed 公 司	CHE UN	纽约证券交 易所	美国	177	439,078.01	0.09
201	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex 制 药股份 有限公 司	VRTX U W	纳斯达克证 券交易所	美国	336	423,589.32	0.08
202	New Jersey Resources Corp	新泽西 资源公 司	NJR UN	纽约证券交 易所	美国	1,230	420,849.20	0.08
203	Allegion PLC	安朗杰 公共有 限公司	ALLE U N	纽约证券交 易所	美国	547	415,718.95	0.08
204	Array BioPharma Inc	Array 生 物制 药股份 有限公 司	ARRY U Q	纳斯达克证 券交易所	美国	1,287	409,915.74	0.08
205	Hess Corp	赫斯公 司	HES UN	纽约证券交 易所	美国	921	402,499.73	0.08

206	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UN	纳斯达克证券交易所	美国	283	399,964.13	0.08
207	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	1,814	394,323.72	0.08
208	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约证券交易所	美国	982	385,682.08	0.08
209	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	562	385,392.24	0.08
210	Cable One Inc	Cable One 股份有限公司	CABO UN	纽约证券交易所	美国	46	370,309.43	0.07
211	Wyndham Destinations Inc	温德姆目的地股份有限公司	WYND UN	纽约证券交易所	美国	1,179	355,821.41	0.07
212	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	831	349,056.71	0.07
213	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	363	342,659.32	0.07
214	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	1,339	337,095.28	0.07
215	Celgene Corp	新基医药	CELG UN	纳斯达克证券交易所	美国	530	336,813.55	0.07
216	Ubiquiti Networks Inc	优博通网络股份有限公司	UBNT UN	纳斯达克证券交易所	美国	369	333,584.51	0.07
217	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UN	纳斯达克证券交易所	美国	324	331,482.08	0.07
218	Four Corners Pro	Four Corn	FCPT UN	纽约证券交易所	美国	1,743	327,484.52	0.06

	erty Trust Inc	ers 房地产信托股份有						
219	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	278	327,459.29	0.06
220	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证券交易所	美国	228	314,740.27	0.06
221	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	138	314,164.85	0.06
222	Oshkosh Corp	豪士科集团公司	OSK UN	纽约证券交易所	美国	530	304,203.41	0.06
223	Cabot Oil & Gas Corp	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约证券交易所	美国	1,907	301,006.81	0.06
224	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD U W	纳斯达克证券交易所	美国	362	297,094.01	0.06
225	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半导体公司	LSCC U W	纳斯达克证券交易所	美国	2,933	294,185.39	0.06
226	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约证券交易所	美国	812	294,129.09	0.06
227	Exact Sciences Corp	Exact 科学公司	EXAS U R	纳斯达克证券交易所	美国	362	293,759.23	0.06
228	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE U W	纳斯达克证券交易所	美国	141	290,072.81	0.06
229	Haemonetics Corp	Haemonetics 公司	HAE UN	纽约证券交易所	美国	349	288,728.19	0.06
230	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR U W	纳斯达克证券交易所	美国	759	282,288.24	0.06
231	Universal Display Corp	美国通用显示器公司	OLED U W	纳斯达克证券交易所	美国	218	281,842.63	0.06
232	Keysight	是德科	KEYS U	纽约证券交	美国	455	280,924.65	0.06

	Technologies Inc	技公司	N		易所				
233	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN		纽约证券交易所	美国	130	280,643.13	0.06
234	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UW		纳斯达克证券交易所	美国	378	279,067.58	0.05
235	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW		纳斯达克证券交易所	美国	357	278,633.03	0.05
236	frontdoor Inc	frontdoor Inc	FTDR UW		纳斯达克证券交易所	美国	928	277,836.88	0.05
237	Alteryx Inc	Alteryx 股份有限公司	AYX UN		纽约证券交易所	美国	367	275,311.39	0.05
238	Seagate Technology PLC	希捷科技公司	STX UW		纳斯达克证券交易所	美国	835	270,486.45	0.05
239	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN		纽约证券交易所	美国	918	270,172.82	0.05
240	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN		纽约证券交易所	美国	748	270,072.31	0.05
241	Moody's Corp	穆迪	MCO UN		纽约证券交易所	美国	201	269,882.23	0.05
242	Sinclair Broadcast Group Inc	Sinclair 广播集团股份有限公司	SBGI UW		纳斯达克证券交易所	美国	731	269,512.51	0.05
243	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW		纳斯达克证券交易所	美国	523	268,725.29	0.05
244	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig 澎泉思蓝宝公司	KDP UN		纽约证券交易所	美国	1,352	268,613.78	0.05
245	Switch Inc	Switch Inc	SWCH UN		纽约证券交易所	美国	2,983	268,439.64	0.05
246	Johnson C	江森自	JCI UN		纽约证券交	美国	940	266,954.23	0.05

	ontrols Internat ional plc	控国际 有限公司		易所				
247	Worldpay Inc	Worldp ay 股 份有限 公司	WP UN	纽约证券交 易所	美国	316	266, 228. 26	0. 05
248	Bank of America Corp	美国银 行	BAC UN	纽约证券交 易所	美国	1, 335	266, 154. 01	0. 05
249	Analog De vices Inc	模拟器 件	ADI UW	纳斯达克证 券交易所	美国	342	265, 374. 01	0. 05
250	Glaukos C orp	Glauko s 公司	GKOS U N	纽约证券交 易所	美国	511	264, 878. 07	0. 05
251	Ford Moto r Co	福特汽 车	F UN	纽约证券交 易所	美国	3, 764	264, 715. 27	0. 05
252	Progress Software Corp	Progre ss 软 件公司	PRGS U W	纳斯达克证 券交易所	美国	875	262, 390. 11	0. 05
253	Coty Inc	科蒂集 团	COTY U N	纽约证券交 易所	美国	2, 791	257, 109. 66	0. 05
254	Avalara I nc	Avalar a Inc	AVLR U N	纽约证券交 易所	美国	504	250, 162. 08	0. 05
255	Essent Gr oup Ltd	Essent 集团有 限公司	ESNT U N	纽约证券交 易所	美国	756	244, 219. 87	0. 05
256	Extra Spa ce Stor age Inc	额外空 间仓储 公司	EXR UN	纽约证券交 易所	美国	332	242, 162. 68	0. 05
257	Trade Des k Inc/The	Trade Desk 股份有 限公司	TTD UQ	纳斯达克证 券交易所	美国	154	241, 151. 55	0. 05
258	Pinnacle West Ca pital Cor p	Pinnac le 西 部资本	PNW UN	纽约证券交 易所	美国	372	240, 624. 67	0. 05
259	Berkshire Hathaway Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证券交 易所	美国	150	219, 821. 97	0. 04
260	Clorox Co /The	高乐氏 公司	CLX UN	纽约证券交 易所	美国	167	175, 781. 75	0. 03
261	CoreSite Realty	Coresite 房	COR UN	纽约证券交 易所	美国	196	155, 184. 80	0. 03

	Corp	地产公司						
262	Innovative Industrial Properties Inc	Innovative 工业地产股份有限公司	IIPR UN	纽约证券交易所	美国	179	152,049.39	0.03
263	Essential Properties Realty Trust Inc	Essential Properties Realty	EPRT UN	纽约证券交易所	美国	1,081	148,928.28	0.03
264	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	551	146,177.36	0.03
265	Hillenbrand Inc	Hillenbrand 公司	HI UN	纽约证券交易所	美国	532	144,720.96	0.03
266	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	143	117,920.70	0.02
267	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	378	112,079.20	0.02
268	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	65	62,238.03	0.01
269	Omega Healthcare Investors Inc	Omega Healthcare Investors 有	OHI UN	纽约证券交易所	美国	111	28,043.62	0.01
270	Chesapeake Utilities Corp	切萨皮克气业公司	CPK UN	纽约证券交易所	美国	28	18,290.55	0.00
271	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	30	11,749.55	0.00

注:本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Facebook Inc	FB UW	5,149,542.97	1.00
2	Texas Instruments Inc	TXN UW	3,193,302.18	0.62
3	Altria Group Inc	MO UN	2,146,436.68	0.42
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	2,089,609.94	0.40
5	Cadence Design Systems Inc	CDNS UW	2,060,795.07	0.40
6	Fiserv Inc	FISV UW	1,866,213.95	0.36
7	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	1,828,292.27	0.35
8	Lockheed Martin Corp	LMT UN	1,819,374.61	0.35
9	Bruker Corp	BRKR UW	1,817,915.08	0.35
10	Best Buy Co Inc	BBY UN	1,641,591.66	0.32
11	Lam Research Corp	LRCX UW	1,603,247.62	0.31
12	International Business Machines Corp	IBM UN	1,600,517.38	0.31
13	Micron Technology Inc	MU UW	1,584,742.85	0.31
14	Apple Inc	AAPL UW	1,576,767.31	0.31
15	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UW	1,509,983.74	0.29
16	Xerox Corp	XRX UN	1,358,340.68	0.26
17	Incyte Corp	INCY UW	1,330,294.28	0.26
18	Stryker Corp	SYK UN	1,328,621.59	0.26
19	Deere & Co	DE UN	1,323,263.62	0.26
20	IDEXX Laboratories Inc	IDXX UW	1,309,017.49	0.25

7.5.2 累计卖出金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Alphabet Inc	GOOGL UW	9,085,873.17	1.76
2	Apple Inc	AAPL UW	6,308,963.46	1.22
3	Boeing Co/The	BA UN	6,027,304.98	1.17
4	Microsoft Corp	MSFT UW	5,857,251.30	1.13

5	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	5,553,185.08	1.08
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	5,546,381.71	1.07
7	Facebook Inc	FB UW	4,637,618.81	0.90
8	Clorox Co/The	CLX UN	4,216,796.85	0.82
9	Amazon.com Inc	AMZN UW	3,917,355.37	0.76
10	Cigna Corp	CI UN	3,652,142.31	0.71
11	Eli Lilly & Co	LLY UN	3,479,263.85	0.67
12	Altria Group Inc	MO UN	3,175,688.87	0.62
13	Coca-Cola Co/The	KO UN	2,955,194.16	0.57
14	Advance Auto Parts Inc	AAP UN	2,903,687.04	0.56
15	Merck & Co Inc	MRK UN	2,871,651.99	0.56
16	AbbVie Inc	ABBV UN	2,663,317.66	0.52
17	Amgen Inc	AMGN UW	2,650,231.07	0.51
18	Home Depot Inc/The	HD UN	2,626,718.82	0.51
19	Broadcom Inc	AVGO UW	2,625,470.40	0.51
20	Credit Acceptance Corp	CACC UW	2,529,753.80	0.49

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	148,527,089.50
卖出收入（成交）总额	245,850,965.77

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 项“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	VanEck Vector s Gold Miners ETF	ETF 基 金	交易型开 放式	Van Eck A ssociates Co rp	1,349,157.68	0.26
2	iPath Series B S&P 500 V IX Short- Term Futures ETN	ETF 基 金	交易型开 放式	Barclays Cap ital Inc	896,749.62	0.18
3	VanEck Vector s Rare Earth/ Strategi c Metal s ETF	ETF 基 金	交易型开 放式	Van Eck Ass ociates Co rp	669,792.81	0.13
4	iShares Russel l 3000 ETF	ETF 基 金	交易型开 放式	BlackRock Fu nd Advisors	1,184.92	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 只基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	209,809.74
4	应收利息	5,107.06
5	应收申购款	3,584,518.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,799,435.47

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名权益性投资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(%)
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	268,283	871.82	-	-	233,893,347.80	100.00
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	338	11,595.45	-	-	3,919,262.56	100.00
合计	268,621	885.31	-	-	237,812,610.36	100.00

注：(1) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币：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美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例；

(2) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇：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美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例。

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	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	45,667.50	0.02
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	-	-
	合计	45,667.50	0.02

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	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
基金合同生效日（2013年6月14日）基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66
本报告期期初基金份额总额	282,208,216.72	4,189,957.79
本报告期基金总申购份额	161,214,925.02	353,622.19
减：本报告期基金总赎回份额	209,529,793.94	624,317.42
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	233,893,347.80	3,919,262.56

§ 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

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019 年 6 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、托管人的托管业务部门及其相关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	
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	392,277,648.58	100.00%	2,457.40	100.00%	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	
金贝塔证券有限公司	-	-	-	-	-	

司 iGoldenbeta Securities Company Limited						
--	--	--	--	--	--	--

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。

2. 交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	11,067,235.30	100.00%

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	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换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	2019年1月4日
2	嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票（QDII）2019年1月21日暂停申购、赎回及定投业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月17日
3	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	证券日报、管理人网站	2019年1月28日
4	嘉实基金管理有限公司关于嘉实美国成长股票（QDII）2019年2月18日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券日报、管理人网站	2019年2月14日
5	关于增加唐鼎耀华为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加	证券日报、管理人网站	2019年2月28日

	费率优惠的公告		
6	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	证券日报、管理人网站	2019 年 3 月 8 日
7	关于嘉实美国成长股票（QDII）2019 年 4 月 19 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券日报、管理人网站	2019 年 4 月 17 日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2019 年 5 月 27 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券日报、管理人网站	2019 年 5 月 23 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实美国成长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) 报告期内嘉实美国成长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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 08 月 29 日