

# 嘉实全球房地产证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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1月1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	嘉实全球房地产证券投资基金
基金简称	嘉实全球房地产(QDII)
基金主代码	070031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月24日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,407,476.19份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球房地产证券，在严格控制投资风险和保障资产流动性的基础上，力争长期、持续战胜业绩比较基准，为国内投资者分享全球房地产相对稳定的现金流收益和资本增值收益。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合的主动投资策略，结合境外投资顾问的全球房地产证券投资管理经验和各地区的团队，在严格控制风险的同时为投资人提高分红收益和长期资本增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index（经汇率调整后的）
风险收益特征	本基金为股票型基金，主要投资于以REITs为代表的全球房地产证券，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的基金品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010)65215588	010-68121816

### 2.4 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	中文
	英文

摩根大通银行  
JPMorgan Chase Bank, National Association

注册地址	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址	270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码	10017

## 2.5 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-1,390,147.22
本期利润	522,105.15
加权平均基金份额本期利润	0.0176
本期加权平均净值利润率	1.69%
本期基金份额净值增长率	2.37%
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	-913,975.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0333
期末基金资产净值	30,449,580.96
期末基金份额净值	1.111
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	36.63%

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）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；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	4.32%	0.72%	5.96%	0.64%	-1.64%	0.08%
过去三个月	9.35%	0.59%	12.67%	0.68%	-3.32%	-0.09%
过去六个月	2.37%	0.79%	2.41%	0.81%	-0.04%	-0.02%
过去一年	3.60%	0.67%	3.41%	0.66%	0.19%	0.01%
过去三年	24.79%	0.79%	32.72%	0.82%	-7.93%	-0.03%
自基金合同生效起至今	36.63%	0.73%	65.70%	0.75%	-29.07%	-0.02%

### 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

嘉实全球房地产(QDII)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：嘉实全球房地产(QDII)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

(2012年7月24日至2018年6月30日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十四（三）投资范围和（八）投资禁止行为与限制

2、基金投资组合比例限制)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300ETF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		
蔡德森	本基金基金经理	2012年7月24日		17年	曾任摩根大通高级会计师、索罗斯基金管理公司会计师、美国国际集团(AIG)子公司南山人寿保险股份有限公司资深投资经理。2008年12月加入嘉实基金管理有限公司。哥伦比亚大学房地产开发学硕士，CFA，具有基金从业资格，中国香港国籍。

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、《嘉实全球房地产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

2018 年上半年全球经济复苏延续，市场主要关注中美和全球贸易战爆发和其他美国针对中国的声明、美国考虑出台新的措施限制中国在美投资来解决美国科技被盗的问题、美国国会通过政府预算案避免两年内政府关门危险、美元走势、特朗普解除蒂勒森国务卿职务、特朗普通俄门调查深化、朝鲜最高领导人金正恩与韩国总统文在寅会谈、金特会金正恩和特朗普签署历史性文件包括朝鲜承诺完全无核化、欧美央行货币政策正常化进程、欧盟和英国就脱欧过渡条款达成协议、德国组阁谈判协议、意大利反建制政党组阁成功推升市场对意大利政治风险的担忧、西班牙议会投票罢免现任首相拉霍伊、马来西亚反对党 60 年来首度赢得大选、南非总统祖玛宣布辞职、A 股被纳入 MSCI 指数等事件。

货币和财政政策方面，货币政策分化，收紧信号渐增。鲍威尔任联储主席后如期加息两次，调升经济预期，预计今年加息四次高于前次预期。美联储主席鲍威尔释放的鹰派信号包括：美国经济非常好；明年 1 月起每次 FOMC 会后都有记者会；可能相对较快删除声明中“宽松政策”的修饰语。鸽派信号包括：加息过快有危险；重点是保持通胀不低于 2%；模型没显示通胀会飙升。美联储半年度货币政策报告：上半年美国经济稳健扩张，但高度杠杆率的公司借贷水平高企。预计渐进式加息将与目标相吻合，财政政策可能会在 2018 年支持 GDP 增速。美联储主席鲍威尔重

申渐进加息立场，称美联储发现商界对贸易政策变化带来的影响越来越担忧，但他认为很难预测结果，只能观望；若贸易政策导致经济走弱，联储可以降息、可以放慢加息步伐。特朗普四万亿预算计划公布：白宫预算计划预计十年后预算赤字逾 7 万亿美元，几乎较此前预期翻倍，届时政府债务约 30 万亿美元；计划提出，未来十年基建投入 2000 亿美元；提议 2019 财年国防预算 6860 亿美元，斥 180 亿美元修美墨边境墙。加拿大央行加息 25 个基点，但 NAFTA 重新谈判的不确定性为加息前景蒙上阴影。在之后的议息会加拿大央行虽暂不加息，但声明弃用了政策调整将保持“谨慎”及“随着时间推进”需要升息的措辞，还弃用了“需要一些宽松货币政策以保持通胀在目标水准”的措辞。欧洲央行维持三大利率不变，且将保持利率不变至少至 2019 年夏天。对于 QE 的时间表，声明表示每月 300 亿欧元的资产购买规模将持续到 9 月份，将在 12 月末结束 QE。欧央行行长德拉吉表示欧元区在实现通胀可持续调整方面取得重大进展，目前没有讨论何时加息，且仍有必要保持大量货币刺激措施。德拉吉警告 27 个欧盟国家的领导人，贸易战升级对信心的影响可能难以衡量，全球经济所受影响可能因供应链错综复杂被放大。他敦促完成欧元区体制改革，让它很快见效。欧洲央行考虑“扭转操作”，考虑明年购买更多长期债券，作为 QE 再投资的一部分，来维持资产组合的存续期，并抑制欧元区借款成本在较低位。英国央行按兵不动，维持基准利率 0.5% 不变，但立场显然更偏鹰派，英国央行行长重申将更早、更快加息，但未明确加息时点。澳联储按兵不动，维持现金利率目标 1.5%，符合市场预期。日央行行长称 2019 财年考虑退出策略。之后安抚市场重申对 2019 财年退出宽松的言论，只是表明若通胀如期达标时会考虑退出，绝非立即实施退出。日本央行维持利率在 -0.1% 不变，维持 10 年期国债收益率目标不变，维持经济评估不变，但下调通胀预期，表明日本在实现通胀目标上再遇挫折。日本央行行长黑田东彦称，经济温和扩张，CPI 同比增速处于 0.5% 至 1% 之间。他重申，将在必要时调整货币政策，不认为目前需要重新考虑货币政策。中国央行召开会议，正式宣布易纲担任行长、党委书记，郭树清担任党委书记、副行长。中国央行货币政策委员会二季度例会：国际经济金融形势更加错综复杂，综合运用多种货币政策工具，把握好结构性去杠杆的力度和节奏，促进经济平稳健康发展，稳定市场预期。中国央行会议提到，稳健的货币政策保持中性，要松紧适度，管好货币供给总闸门，保持流动性合理充裕，引导货币信贷及社融规模合理增长。李克强：进一步减税降费，通过优化营商环境带动有效投资增加。国务院常务会议部署缓解小微企业融资难、融资贵，称要坚持稳健中性的货币政策，保持经济运行在合理区间。

发达经济体经济复苏态势持续，但主要经济体表现存在差异。世界银行上调 2018 年中国、美国、欧洲和日本的 GDP 预期，预计 2018 年全球经济将增长 3.1%，高于 2017 年。美国 6 月非农就业人口变动 21.3 万人，预期 19.5 万人，失业率升至 4%。美国 6 月平均每小时工资环比



0.2%，预期 0.3%。美国 6 月 ISM 制造业指数升破 60.0，是仅次于今年 2 月的 2004 年以来第二高水平，显示制造业连续 22 个月扩张。但对于关税影响企业活动及未来将继续影响业务，受访制造商有压倒性的担忧。美国 6 月 ISM 非制造业指数接近逾十二年来最高水平，受访企业对美国整体经济感到乐观，仍有关税相关担忧。美国 6 月 CPI 环比上涨 0.1%，不及预期和前值，但 6 月同比上涨 2.9%，是自 2012 年 2 月以来的最大年度涨幅。美国 6 月 PPI 同比增长 3.4%，高于预期和前值 3.1%，创 2011 年 11 月来最大增幅。欧元区 6 月制造业 PMI 令人失望。欧元区、德国和法国 6 月制造业和服务业出现显著分歧，制造业纷纷创近一年半新低，但综合和服务业全线好于预期。欧元区 6 月 CPI 初值同比增长 2%，为 2017 年 2 月以来首次。受恶劣天气、欧元走强和罢工等因素影响，欧元区一季度经济增速创一年半来新低。英国 6 月 CPI 同比增速持平于上月，核心 CPI 则从 5 月份的 2.1% 降至 1.9%，创 2017 年 3 月以来的最低水平。连续八个季度复苏后，日本一季度实际 GDP 季环比下滑 0.20%，低于市场预期。中国二季度 GDP 6.7%，预期值为 6.7%，一季度增幅为 6.8%。中国 6 月财新制造业 PMI 录得 51，较上月略降 0.1 个百分点。中国 6 月财新服务业 PMI 为 53.9，综合 PMI 录得 53。制造业产出与服务业经营活动皆创下四个月高点，显示产出增速进一步改善。中国 6 月 CPI 同比 1.9%，略高于前值，但是连续第三个月低于 2%；中国 6 月 PPI 同比 4.7%，高于预期且连续第二个月环比上涨。

2018 年上半年全球主要发达国家股市在波动中下跌。美国 10 年期国债收益率上涨，上半年末收益率为 2.8601%，相比 2017 年上涨 45 个基点。人民币下跌，在岸人民币兑美元 6.6210，离岸人民币 6.6357。受美联储可能更快的加息步伐和中美贸易战爆发的担忧等因素影响，全球市场避险情绪高涨，REITs 在上半年先跌后涨，各地区表现不一。

考虑到全球贸易战升温，货币政策分化，收紧信号渐增，美联储渐进加息，房地产市场基本面在短期持平，REITs 的价格处于合理水平，本基金对投资策略作出以下调整：一是在上半年维持房地产证券仓位在 90% 以上；二是在地区资产配置方面高配基本面相对向好的地区如欧洲，平配货币政策收紧信号渐增的地区如美国；三是在业态资产配置方面低配医疗保健、零售和长期租约等盈利增长性较低的 REITs；四是在证券选择上增加配置拥有优质资产、增长潜力、估值相对吸引的中小市值房地产证券。

#### 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 1.111 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.37%，业绩比较基准收益率为 2.41%。

#### 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 2018 年下半年，全球经济不确定事件、不可预见性风险复杂严峻。中美和全球贸易战、

美联储退出量化宽松货币政策的步伐、欧美央行货币政策正常化进程、英国脱欧进程等事件将是2018年下半年的关注点中心。如果特朗普的扩张性财政政策能够被推进，带动经济复苏增速，增加通胀压力，美联储有可能维持加息步伐。即使美联储进一步加息，其步伐将是渐进而且取决于经济复苏的走势。美国10年期国债收益率将随经济进一步增长而逐步上行，但特朗普新政的执行情况能否如期实现、地缘政治局势、财政和货币政策等不确定因素将影响投资环境，增加美国10年期国债收益率的波动性。在房地产市场方面，机构投资者如主权基金，养老基金，保险公司等对房地产的投资性需求没有减少，而新供给在大部分市场仍然有限。过去几年房地产价格增长主要受利率下降和估值修复所带动，未来全球房地产投资的收益将更多取决于经济和租金增长。2018年仍然是REITs过渡的一年：一方面，财政政策加快经济复苏和通胀，推动全球REITs的现金流和估值提升，而风险事件也有可能影响投资者对REITs资产配置的需求；但另一方面，利率政策正常化有可能对REITs价格带来下压风险。综上所述，我们对全球REITs市场的总体表现持谨慎的态度。

#### 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；与估值相关的机构为美国、新加坡、加拿大、德国、挪威、香港、日本、英国、澳大利亚、法国等基金投资市场的证券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

(1) 本基金的基金管理人于2018年1月12日发布《嘉实全球房地产证券投资基金2017年第四次收益分配公告》，收益分配基准日为2017年12月31日，每10份基金份额发放现金红利0.0360元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 根据本基金基金合同（十九（二）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

报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2018-1-1 至 2018-6-30；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

### § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### § 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：嘉实全球房地产证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2018年6月30日	2017年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,733,599.39	1,825,316.29
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	28,825,448.10	34,111,036.45
其中: 股票投资		28,825,448.10	34,111,036.45
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		422,026.58	224,522.82
应收利息	6.4.7.5	81.46	83.99
应收股利		197,523.15	221,172.61
应收申购款		390,958.41	75,385.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	328,912.97	-
资产总计		31,898,550.06	36,457,517.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		994,255.95	620,740.64
应付管理人报酬		42,043.42	52,396.92
应付托管费		8,656.02	10,787.61
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	404,013.71	151,107.62
负债合计		1,448,969.10	835,032.79
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	27,407,476.19	32,702,020.07
未分配利润	6.4.7.10	3,042,104.77	2,920,464.99
所有者权益合计		30,449,580.96	35,622,485.06

负债和所有者权益总计		31,898,550.06	36,457,517.85
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.111 元，基金份额总额 27,407,476.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实全球房地产证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		982,855.57	1,188,240.70
1. 利息收入		1,681.17	2,184.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,681.17	2,184.47
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）		-914,040.70	1,762,819.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,439,910.23	849,963.70
基金投资收益	6.4.7.13	-	-93,738.88
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	-	21,595.23
股利收益	6.4.7.16	525,869.53	984,999.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,912,252.37	-547,685.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-25,335.65	-54,300.67
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,298.38	25,223.19
减：二、费用		460,750.42	822,219.80
1. 管理人报酬		259,993.21	524,720.33
2. 托管费		53,528.01	108,030.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	71,482.39	113,308.74
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. 20	75, 746. 81	76, 159. 98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		522, 105. 15	366, 020. 90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		522, 105. 15	366, 020. 90

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实全球房地产证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	32, 702, 020. 07	2, 920, 464. 99	35, 622, 485. 06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	522, 105. 15	522, 105. 15
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）	-5, 294, 543. 88	-287, 112. 19	-5, 581, 656. 07
其中：1. 基金申购款	3, 831, 991. 75	164, 585. 96	3, 996, 577. 71
2. 基金赎回款	-9, 126, 535. 63	-451, 698. 15	-9, 578, 233. 78
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）	-	-113, 353. 18	-113, 353. 18
五、期末所有者权益（基金净值）	27, 407, 476. 19	3, 042, 104. 77	30, 449, 580. 96
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	65, 862, 153. 83	7, 029, 503. 64	72, 891, 657. 47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	366, 020. 90	366, 020. 90

期净利润)			
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)	-18,740,829.11	-2,001,044.19	-20,741,873.30
其中：1. 基金申购款	360,443.00	40,292.53	400,735.53
2. 基金赎回款	-19,101,272.11	-2,041,336.72	-21,142,608.83
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)	-	-1,035,622.35	-1,035,622.35
五、期末所有者权益(基金净值)	47,121,324.72	4,358,858.00	51,480,182.72

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人、基金代销机构
JPMorgan Chase Bank, National Association(摩根大通银行)	境外资产托管人
金贝塔证券有限公司	基金管理人的子公司

#### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 (%)
金贝塔证券有限公司	719,107.40	1.68	-	-

注：上年度可比期间（2017年1月1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。

##### 6.4.4.1.2 债券交易

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.4.1.3 债券回购交易

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017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。

##### 6.4.4.1.4 基金交易

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 6.4.4.1.5 权证交易

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
金贝塔证券有限公司	477.24	0.87	-	-

注：（1）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。

（2）上年度可比期间（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无应支付关联方的佣金。



#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	259,993.21	524,720.33
其中：支付销售机构的客户维护费	79,047.90	163,274.91

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1.7%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×1.7%/当年天数。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	53,528.01	108,030.75

注：支付基金托管人中国农业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。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1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。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1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。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2018年6月30日）及上年度末（2017年12月31日），其他关联方未持有本基金。

## 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国农业银行股份有限公司_活期	1,396,834.04	1,665.40	1,071,861.08	2,184.47
摩根大通银行_活期	336,765.35	-	1,792,950.03	-

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

## 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2018年1月1日至2018年6月30日）及上年度可比期间（2017年1月1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。

## 6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2018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。

## 6.4.5.2 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。

## 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2018年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

## 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（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	28,825,448.10	90.37
	其中：普通股	6,827,204.05	21.40

	存托凭证	1,465,498.69	4.59
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	20,532,745.36	64.37
2	基金投资	-	-
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	1,733,599.39	5.43
8	其他各项资产	1,339,502.57	4.20
9	合计	31,898,550.06	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	19,810,838.69	65.06
中国香港	2,515,768.25	8.26
澳大利亚	1,484,442.46	4.88
德国	1,438,793.80	4.73
英国	805,030.85	2.64
日本	794,028.26	2.61
西班牙	697,786.19	2.29
法国	501,565.01	1.65
奥地利	296,572.14	0.97
新加坡	265,462.27	0.87
爱尔兰	215,160.18	0.71
合计	28,825,448.10	94.67

## 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（%）
房地产信托特殊类	4,687,299.94	15.39
房地产信托工业类	4,097,908.88	13.46
房地产信托住宅类	3,938,324.12	12.93
房地产信托写字楼类	2,915,875.67	9.58
房地产信托多元化类	1,756,949.94	5.77
房地产信托零售类	1,251,820.34	4.11

房地产信托酒店及度假村类	955,226.63	3.14
房地产信托医疗保健类	929,339.84	3.05
存托凭证信息技术	1,465,498.69	4.81
股票房地产	4,417,845.83	14.51
股票非必须消费品	1,480,089.83	4.86
股票信息技术	929,268.39	3.05
合计	28,825,448.10	94.67

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前十名权益投资明细

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	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX	纳斯达克证券交易所	美国	550	1,564,425.60	5.14
2	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT	纽约证券交易所	美国	1,000.00	953,915.22	3.13
3	InterXion Holding NV	InterXion 控股	INXN	纽约证券交易所	美国	2,250.00	929,268.39	3.05
4	GDS Holdings Ltd	GDS Holdings Ltd	GDSUQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,202.00	849,360.90	2.79
5	Prologis Inc	普洛斯公司	PLD	纽约证券交易所	美国	1,800.00	782,360.02	2.57
6	Times China Holdings Ltd	时代中国控股	1233 HK	香港证券交易所	中国香港	75,000.00	736,026.30	2.42
7	UDR Inc	UDR 公司	UDR	纽约证券交易所	美国	2,700.00	670,645.34	2.20
8	Invitation Homes Inc	Invitation Homes Inc	INVH	纽约证券交易所	美国	4,200.00	640,830.94	2.10
9	21Vianet Group Inc	北京世纪互联宽带数据中心有限	VNET	纳斯达克证券交易所	美国	9,600.00	616,137.79	2.02

10	Aroundtown SA	Aroundtown 股份公司	AT1 GR	德国证券交易所	德国	10,650.00	573,271.42	1.88
----	---------------	-----------------	--------	---------	----	-----------	------------	------

注：（1）本表所使用的证券代码为彭博代码。（2）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。

## 7.5 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	Times China Holdings Ltd	1233 HK	1,625,293.14	4.56
2	Equinix Inc	EQIX UW	1,391,879.52	3.91
3	InterXion Holding NV	INXN UN	933,360.15	2.62
4	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	81 HK	702,743.82	1.97
5	CIFI Holdings Group Co Ltd	884 HK	695,280.28	1.95
6	China Jinmao Holdings Group Ltd	817 HK	636,440.02	1.79
7	Vonovia SE	VNA GY	535,358.14	1.50
8	21Vianet Group Inc	VNET UW	533,390.55	1.50
9	Melia Hotels International SA	MEL SQ	531,051.53	1.49
10	Logan Property Holdings Co Ltd	3380 HK	472,004.24	1.33
11	UDR Inc	UDR UN	447,334.46	1.26
12	Yuzhou Properties Co Ltd	1628 HK	400,794.32	1.13
13	Chatham Lodging Trust	CLDT UN	391,555.80	1.10
14	American Campus Communities Inc	ACC UN	370,208.12	1.04
15	Aroundtown SA	AT1 GR	369,066.49	1.04
16	Ventas Inc	VTR UN	352,544.07	0.99
17	Frasers Logistics & Industrial Trust	FLT SP	336,262.47	0.94
18	Nippon Healthcare Investment Corp	3308 JP	335,598.90	0.94
19	IWG PLC	IWG LN	331,799.83	0.93
20	Deutsche Wohnen SE	DWNI GY	330,839.09	0.93

### 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	Times China Holdings Ltd	1233 HK	1,207,051.17	3.39
2	Aroundtown SA	AT1 GR	1,051,939.34	2.95
3	ADO Properties SA	ADJ GR	866,671.13	2.43
4	GGP Inc	GGP UN	789,154.86	2.22
5	Pure Multi-Family REIT LP	RUF-U CV	786,971.57	2.21
6	GDS Holdings Ltd	GDS UQ	753,474.00	2.12
7	Capital & Counties Properties PLC	CAPC LN	591,926.53	1.66
8	Great Portland Estates PLC	GPOR LN	565,059.94	1.59
9	Link REIT	823 HK	558,064.87	1.57
10	Mirvac Group	MGR AT	556,132.08	1.56
11	Industria REIT	IDR AT	552,340.40	1.55
12	Kilroy Realty Corp	KRC UN	496,348.70	1.39
13	Simon Property Group Inc	SPG UN	496,232.74	1.39
14	NH Hotel Group SA	NHH SQ	478,766.44	1.34
15	China Jinmao Holdings Group Ltd	817 HK	436,461.97	1.23
16	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	81 HK	425,272.71	1.19
17	Hufvudstaden AB	HUFVA SS	420,630.62	1.18
18	CIFI Holdings Group Co Ltd	884 HK	408,877.21	1.15
19	Mandarin Oriental International Ltd	MAND SP	364,659.59	1.02
20	Hammerson PLC	HMSO LN	360,818.17	1.01

### 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	18,616,340.25
卖出收入（成交）总额	24,374,270.74

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。

## 7.9 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

报告期末，本基金未持有基金。

## 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	422,026.58
3	应收股利	197,523.15
4	应收利息	81.46
5	应收申购款	390,958.41
6	其他应收款	328,912.97
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,339,502.57

### 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	持有份额	占总份额

			比例 (%)		比例 (%)
2,685	10,207.63	-	-	27,407,476.19	100.00

## 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	1,369.63	0.00

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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 (2012年7月24日) 基金份额总额	835,974,696.22
本报告期期初基金份额总额	32,702,020.07
本报告期基金总申购份额	3,831,991.75
减：本报告期基金总赎回份额	9,126,535.63
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	27,407,476.19

注：报告期间基金总申购份额含红利再投。

## §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

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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	33,085,130.37	77.12%	35,326.49	64.34%	
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	1,783,921.55	4.16%	3,362.56	6.12%	
野村国际（香港）有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	220,193.21	0.51%	440.39	0.80%	

瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	665,553.21	1.55%	1,331.07	2.42%	
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	1,673,096.53	3.90%	4,246.76	7.73%	
中信建投(国际)证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	305,002.20	0.71%	410.55	0.75%	
大和资本市场香港有限	-	-	-	-	-	

公司						
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited						
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	719,107.40	1.68%	477.24	0.87%	
Sanford C. Bernstein and Co., Inc	-	224,859.91	0.52%	337.29	0.61%	新增
法国巴黎证券(亚洲) 有限公司	-	352,632.15	0.82%	705.26	1.28%	新增
极讯公司	-	1,150,262.74	2.68%	2,300.50	4.19%	新增
里昂证券有限公司	-	364,659.59	0.85%	911.66	1.66%	新增
摩根士丹利有限公司	-	1,539,960.86	3.59%	3,079.92	5.61%	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。

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

2018年8月25日