

嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金
基金简称	嘉实腾讯自选股大数据策略股票
基金主代码	001637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	238,263,245.01 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将腾讯自选股大数据和行为金融模型相结合，构建大数据量化投资策略模型，在此基础上生成基金股票组合，力争获得长期、持续的超额收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+中证综合债券指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010) 65215588	(010) 66105799

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01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-22,085,567.45
本期利润	-40,321,420.77
加权平均基金份额本期利润	-0.1371
本期加权平均净值利润率	-12.81%
本期基金份额净值增长率	-13.91%
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	-11,313,026.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0475
期末基金资产净值	226,950,218.47
期末基金份额净值	0.953
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	-4.70%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.02%	1.80%	-7.24%	1.25%	0.22%	0.55%
过去三个月	-11.92%	1.34%	-9.92%	1.04%	-2.00%	0.30%
过去六个月	-13.91%	1.38%	-12.14%	1.05%	-1.77%	0.33%
过去一年	-10.35%	1.17%	-6.05%	0.86%	-4.30%	0.31%

自基金合同生效起至今	-4.70%	1.04%	-10.49%	1.06%	5.79%	-0.02%
------------	--------	-------	---------	-------	-------	--------

注:本基金业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制, 它的样本选自沪深两个证券市场 800 只股票, 具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势, 适合作为本基金股票投资业绩比较基准。而中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。能够反映债券市场总体走势, 适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算, 计算方式如下:

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

$$\text{Return}(t)=90\% \times (\text{中证 800 指数}(t)/\text{中证 800 指数}(t-1)-1)+10\% \times (\text{中证综合债券指数}(t)/\text{中证综合债券指数}(t-1)-1)$$

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实腾讯自选股大数据策略股票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: 嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 12 月 7 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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、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		
龙昌伦	本基金、嘉实对冲套利定期混合基金经理	2017 年 6 月 22 日	—	4 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投资部。
刘斌	本基金、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实对冲套利定期混合、嘉实	2015 年 12 月 7 日	—	12 年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。

	润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合基金经理				2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作。博士具有基金从业资格。
--	-------------------------	--	--	--	--

注：（1）基金经理刘斌的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理龙昌伦的任职日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《嘉实腾讯自选股大数据策略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

上半年，A 股市场在多重因素叠加影响和冲击下，呈现出剧烈的波动，这种波动体现在指数的波动幅度、风格的切换方向以及投资者的风险偏好，整体来看，在短期和中期利空因素的集中反应下，权益市场录得较大跌幅，上证综指累计下跌达到 14%。

一方面，投资者对经济增长的预期从年初相对乐观转向经济下行，特别是随着中美贸易纠纷由

短期争端逐渐演变成中长期对峙，对未来经济的悲观情绪加重，这一定程度上导致强势龙头白马股走弱并使得投资者将注意力集中于受宏观经济及外贸影响更小和在经济下行中受益于利率下行的资产，包括消费类以及新兴成长类行业股票。而与此同时，资产管理新规和去杠杆等金融监管措施的持续推进，实体部门融资环境急剧变差，部分企业信用风险事件的爆发，对市场带来显著的流动性冲击，伴随的是股权质押风险的扩大。综合导致投资者风险偏向显著下降，市场也表现出下跌速度加快，投资者避险情绪较重的格局。

行业方面，仅少数行业取得正收益，消费类表现居前，而部分周期和通信行业则相对较差，餐饮旅游、医药和食品饮料相对较好，综合、电力设备、通信和有色金属则下跌幅度更大。总体而言，在预期经济增速下滑、去杠杆和贸易战加剧背景下，伴随着市场波动率的显著上行，投资者的投资偏好发生了明显转变，更加关注受经济波动影响偏小的行业和个股。

本基金始终依据腾讯自选股等相关数据，深入挖掘用户的选股行为模式，同时发挥嘉实基金的量化研究优势，结合价值、成长、流动性等传统金融数据指标，选取成长性较好的优质公司，剔除基本面和流动性较差的股票，最终构建大数据组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.953 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.91%，业绩比较基准收益率为-12.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在过去利空因素集中反应和消化后，这些因素逐渐从短期问题演化成中期变量，权益市场也已经在全面的下跌后进入长期绝对估值的底部区域，同时影响市场的主要负面因素正在出现边际缓和与改善，一是货币政策转向信号有所增强，货币政策态度有所缓和，无论是全面降准还是利率在美联储加息后按兵不动。二是市场经过大幅下跌之后，产业资本增持节奏正在加快，表明其对上市企业内在价值的认可。与此同时，在一系列紧缩政策后，管理层加强了过程中的政策协调，包括对股权质押平仓的关注，都是在极力避免市场过大波动。总体上看，我们认为以上方面出现的边际缓和有助于提升风险偏好，而优质个股会表现更佳，市场仍是结构性行情。

展望未来，去杠杆、信用违约和金融监管带来的流动性冲击仍将继续，而中美贸易战的不确定性也变成了压制市场风险偏好的重要变量。市场仍将在中期压制因素下经历不断的反复和波动，但股市整体估值已经回到长期底部区域的有利因素是未来市场演绎过程中的较好安全垫。面对分化的行情，进一步提高个股选择标准，提升选股确定性和准确度是当前行情中的优异策略。

具体操作上，本基金将继续在大数据行为策略与多因子量化策略相结合的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，力争为持有人创造更多的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为-40,321,420.77 元、3.1.2 “期末可供分配利润”为-11,313,026.54 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，本基金托管人在对嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

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	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,941,051.00	48,240,580.11
结算备付金		4,529,060.85	11,083,616.88
存出保证金		87,355.96	146,883.60
交易性金融资产	6.4.7.2	205,534,678.06	364,531,887.73
其中：股票投资		205,534,678.06	364,531,887.73
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		-	7,669.50
应收利息	6.4.7.5	5,060.99	13,819.89
应收股利		-	-
应收申购款		145,744.76	11,593,077.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		228,242,951.62	435,617,535.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	171,370.42
应付赎回款		365,711.13	21,078,409.37

应付管理人报酬		305,766.59	509,301.95
应付托管费		50,961.10	84,883.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	381,824.88	601,294.10
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	188,469.45	457,119.23
负债合计		1,292,733.15	22,902,378.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	238,263,245.01	372,724,742.09
未分配利润	6.4.7.10	-11,313,026.54	39,990,414.77
所有者权益合计		226,950,218.47	412,715,156.86
负债和所有者权益总计		228,242,951.62	435,617,535.61

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.953 元，基金份额总额 238,263,245.01 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

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		-35,675,454.27	4,645,380.68
1. 利息收入		180,154.26	936,285.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	132,875.09	361,494.99
债券利息收入		47,279.17	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	574,790.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,144,869.77	-36,914,418.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19,402,975.18	-39,613,602.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,220.09	-
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	-922,899.03	73,080.00
股利收益	6.4.7.15	2,179,784.35	2,626,103.94
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-18,235,853.32	39,375,580.69
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	525,114.56	1,247,932.46
减：二、费用		4,645,966.50	9,101,162.38
1. 管理人报酬		2,339,781.04	4,503,147.48
2. 托管费		389,963.45	750,524.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,722,654.72	3,643,988.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		141.48	-
7. 其他费用	6.4.7.19	193,425.81	203,501.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-40,321,420.77	-4,455,781.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-40,321,420.77	-4,455,781.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

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)	372,724,742.09	39,990,414.77	412,715,156.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-40,321,420.77	-40,321,420.77
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)	-134,461,497.08	-10,982,020.54	-145,443,517.62
其中：1. 基金申购款	91,902,142.05	6,725,669.23	98,627,811.28

2. 基金赎回款	-226,363,639.13	-17,707,689.77	-244,071,328.90
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）	238,263,245.01	-11,313,026.54	226,950,218.47
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）	645,307,859.23	48,974,489.65	694,282,348.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,455,781.70	-4,455,781.70
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）	-128,097,026.76	-11,788,124.72	-139,885,151.48
其中：1. 基金申购款	194,621,720.76	10,082,325.63	204,704,046.39
2. 基金赎回款	-322,718,747.52	-21,870,450.35	-344,589,197.87
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）	517,210,832.47	32,730,583.23	549,941,415.70

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 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 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

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交易。

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	2,339,781.04	4,503,147.48
其中：支付销售机构的客户维护费	607,270.59	1,307,853.98

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 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	389,963.45	750,524.57

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

6.4.4.3 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
中国工商银行股份有限公司_活期	17,941,051.00	93,522.57	12,027,210.59	60,262.09

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06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**

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
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
--------	----------	-----------------------	----------------------	-----	-------	-------	-------	-----------	-----------	------

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601727	上海 电气	2018 年 6 月 6 日	重大事 项停牌	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	437,400	2,562,600.00	2,773,116.00	-
300266	兴源 环境	2018 年 2 月 5 日	重大事 项停牌	16.67	2018 年 7 月 2 日	17.99	157,000	4,215,109.17	2,617,190.00	-
000426	兴业 矿业	2018 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	7.21	-	-	222,024	2,100,191.85	1,600,793.04	-
000603	盛达 矿业	2018 年 6 月 11 日	重大事 项停牌	10.83	2018 年 8 月 21 日	9.75	61,800	707,476.31	669,294.00	-
002310	东方 园林	2018 年 5 月 25 日	重大事 项停牌	13.08	-	-	44,000	797,649.00	575,520.00	-
002359	北讯 集团	2018 年 5 月 21 日	重大事 项停牌	19.58	2018 年 8 月 21 日	17.62	26,400	684,322.00	516,912.00	-
600745	闻泰 科技	2018 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	30.48	-	-	68,800	1,976,063.84	2,097,024.00	-

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	205,534,678.06	90.05
	其中：股票	205,534,678.06	90.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	22,470,111.85	9.84
8	其他各项资产	238,161.71	0.10
9	合计	228,242,951.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	475,543.00	0.21
B	采矿业	7,683,427.44	3.39
C	制造业	121,046,442.86	53.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,357,234.85	1.48
E	建筑业	6,147,005.60	2.71
F	批发和零售业	14,183,452.00	6.25
G	交通运输、仓储和邮政业	7,938,265.00	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,332,559.51	7.64
J	金融业	4,380,074.90	1.93
K	房地产业	9,442,263.41	4.16
L	租赁和商务服务业	4,425,840.03	1.95
M	科学研究和技术服务业	79,502.52	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	3,065,174.14	1.35
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	4,485,352.80	1.98
S	综合	1,492,540.00	0.66
	合计	205,534,678.06	90.56

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	000975	银泰资源	533,860	5,413,340.40	2.39
2	000631	顺发恒业	1,472,300	5,049,989.00	2.23
3	002585	双星新材	848,100	4,528,854.00	2.00
4	000738	航发控制	327,900	4,370,907.00	1.93
5	002626	金达威	249,000	4,320,150.00	1.90
6	002189	利达光电	289,900	3,794,791.00	1.67
7	600519	贵州茅台	5,100	3,730,446.00	1.64
8	000100	TCL 集团	1,213,700	3,519,730.00	1.55
9	300212	易华录	140,520	3,323,298.00	1.46
10	000078	海王生物	646,600	3,110,146.00	1.37

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300027	华谊兄弟	8,564,546.94	2.08
2	601818	光大银行	7,999,573.00	1.94
3	600208	新湖中宝	6,773,164.00	1.64
4	000975	银泰资源	6,661,399.47	1.61
5	600682	南京新百	6,311,332.00	1.53
6	601717	郑煤机	6,282,677.00	1.52
7	000021	深科技	6,174,906.74	1.50
8	000631	顺发恒业	6,114,662.09	1.48
9	002421	达实智能	5,359,600.00	1.30
10	600201	生物股份	5,327,425.42	1.29
11	002585	双星新材	5,231,799.39	1.27
12	002582	好想你	5,187,915.80	1.26
13	002434	万里扬	5,003,253.00	1.21

14	600231	凌钢股份	4,940,846.00	1.20
15	002626	金达威	4,880,389.00	1.18
16	300336	新文化	4,766,566.13	1.15
17	002045	国光电器	4,590,262.00	1.11
18	600280	中央商场	4,578,653.20	1.11
19	002189	利达光电	4,571,418.69	1.11
20	000426	兴业矿业	4,563,179.62	1.11

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600380	健康元	9,953,340.03	2.41
2	601818	光大银行	8,723,732.00	2.11
3	300036	超图软件	8,359,864.38	2.03
4	000060	中金岭南	7,680,104.00	1.86
5	000426	兴业矿业	7,470,448.43	1.81
6	300027	华谊兄弟	7,398,737.53	1.79
7	000021	深科技	7,086,865.87	1.72
8	000951	中国重汽	6,973,120.18	1.69
9	600737	中粮糖业	6,872,323.00	1.67
10	600572	康恩贝	6,732,890.96	1.63
11	000039	中集集团	6,695,758.07	1.62
12	300336	新文化	6,679,921.00	1.62
13	000671	阳光城	6,483,684.88	1.57
14	600990	四创电子	6,369,063.86	1.54
15	002582	好想你	6,315,283.71	1.53
16	600682	南京新百	6,283,137.00	1.52
17	000786	北新建材	6,187,170.06	1.50
18	000338	潍柴动力	6,048,765.12	1.47
19	002396	星网锐捷	5,639,679.73	1.37
20	000528	柳工	5,596,591.00	1.36

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	588,994,892.62
卖出股票收入（成交）总额	710,353,273.79

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-922,899.03
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,355.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,060.99
5	应收申购款	145,744.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	238,161.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
9,227	25,822.40	12,653,836.85	5.31	225,609,408.16	94.69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	153,794.71	0.06

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（2015 年 12 月 7 日）基金份额总额	1,262,565,521.03
本报告期期初基金份额总额	372,724,742.09
本报告期基金总申购份额	91,902,142.05
减：本报告期基金总赎回份额	226,363,639.13
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	238,263,245.01

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

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	3	576,608,657.31	44.47%	403,632.55	45.03%	-
中国国际金融股份有限公司	2	271,604,043.63	20.95%	190,124.61	21.21%	-
东方证券股份有限公司	2	166,621,270.48	12.85%	105,194.84	11.74%	-
中信建投证券股份有限公司	2	104,904,457.76	8.09%	73,433.16	8.19%	-
国金证券股份有限公司	1	98,385,436.80	7.59%	68,871.32	7.68%	-
光大证券股份有限公司	1	48,231,108.16	3.72%	33,761.79	3.77%	-
华泰证券股份有限公司	1	30,386,606.04	2.34%	21,270.65	2.37%	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

民生证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-
西藏东方 财富证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-

股份有限 公司						
国泰君安 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-

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。

注 3：中银国际证券有限责任公司更名为中银国际证券股份有限公司。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	6,098,779.91	100.00%	-	-	-	-

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