

嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资 基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 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

报告送出日期：2019 年 10 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实瑞享定期混合
场内简称	嘉实瑞享
基金主代码	160726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 3 日
报告期末基金份额总额	1,309,159,660.49 份
投资目标	本基金通过优选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% + 恒生指数收益率×40%（人民币计价）+ 中债综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 7 月 1 日 - 2019 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	27,052,973.89
2. 本期利润	120,865,001.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0923
4. 期末基金资产净值	1,612,463,352.65
5. 期末基金份额净值	1.2317

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。

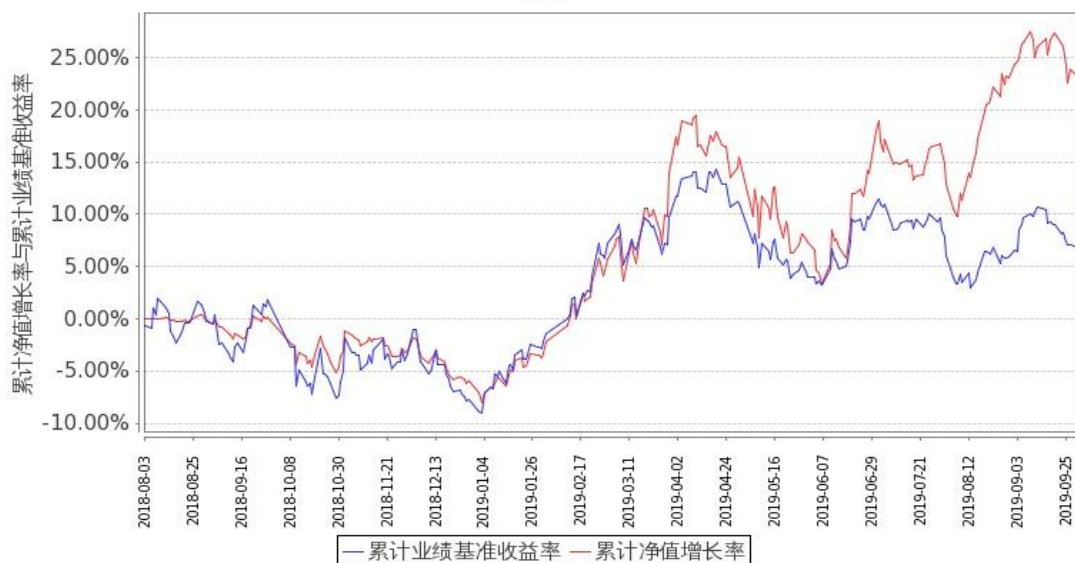
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	8.10%	1.06%	-2.47%	0.76%	10.57%	0.30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

嘉实瑞享定期混合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：嘉实瑞享定期混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 8 月 3 日至 2019 年 9 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（十三（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张金涛	本基金、嘉实沪港深精选股票、嘉实沪港深回报混合基金经理	2018 年 8 月 3 日	—	17 年	曾任中金公司研究部能源组组长。润晖投资高级副总裁，负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金，曾任海外研究组组长，负责海外投资策略以及能源原材料行业研究。现任策略组投资总监。

注：（1）基金经理的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、《嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

港股七月震荡过后，八月随中美贸易战升温，加上本地社会事件日趋紧张，大市自高位迅速回落，恒指 8 月中一度失守 25000 点关口，低见 24900 点。9 月初随中美新一轮贸易谈判前双方互释善意，提振市场乐观情绪，加上环球央行货币宽松政策持续，市场风险偏好回暖，在空头回补下港股九月自月初反弹，恒指月中突破 27000 点关口，高见 27366 点，但其后中美贸易局势阴晴不定，加上经济数据偏弱，本地社会事件影响下，大盘九月下旬录得十连阴。资金流入持续减弱，九月份港股通净流入资金仅 82.14 亿，较八月份显著减少 503.83 亿，市场情绪逐步偏淡。整体第三季恒指累计下跌 2450 点，跌幅 8.6%；国企指数指累计下跌 681 点，跌幅 6.3%。相对而言 A 股市场走势较为平稳，三季度沪深 300 指数仅小幅下跌 0.3%。

报告期内，本基金增持了电子行业股票，减持了消费、医药和周期股，取得了一定的超额收益。

4.5 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 1.2317 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.10%，业绩比较基准收益率为-2.47%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,565,467,949.28	96.87
	其中：股票	1,565,467,949.28	96.87
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	846,278.40	0.05
	其中：债券	846,278.40	0.05
	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	49,224,576.63	3.05
8	其他资产	549,949.79	0.03
9	合计	1,616,088,754.10	100.00

注：本基金本报告期末无通过沪港通交易机制投资的港股；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 324,222,285.39 元，占基金资产净值的比例为 20.11%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,176,000.00	0.38
B	采矿业	—	—
C	制造业	969,351,209.94	60.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	123,769,847.78	7.68
G	交通运输、仓储和邮政业	22,356,869.60	1.39
H	住宿和餐饮业	30,220,304.21	1.87
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,851,432.36	2.84
J	金融业	43,520,000.00	2.70
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,241,245,663.89	76.98

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	52,608,132.18	3.26
必需消费品	58,365,819.86	3.62
医疗保健	35,178,390.00	2.18
工业	31,119,345.00	1.93
信息技术	78,972,779.52	4.90
原材料	22,000,023.90	1.36
房地产	45,977,794.93	2.85
合计	324,222,285.39	20.11

5.3 报告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

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	000651	格力电器	2,128,533	121,964,940.90	7.56
2	002475	立讯精密	3,906,015	104,524,961.40	6.48
3	600519	贵州茅台	70,000	80,500,000.00	4.99
4	2382 HK	舜宇光学科技	760,000	78,972,779.52	4.90
5	600276	恒瑞医药	959,812	77,437,632.16	4.80
6	000963	华东医药	2,882,321	75,516,810.20	4.68
7	000858	五粮液	500,000	64,900,000.00	4.02
8	168 HK	青岛啤酒股份	1,368,000	58,365,819.86	3.62
9	603345	安井食品	999,773	47,739,160.75	2.96
10	601318	中国平安	500,000	43,520,000.00	2.70

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	846,278.40	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	846,278.40	0.05

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113543	欧派转债	7,040	846,278.40	0.05

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	297,436.33
2	应收证券清算款	111,201.05
3	应收股利	102,582.09
4	应收利息	12,789.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	25,940.70
8	其他	-
9	合计	549,949.79

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,309,159,660.49
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,309,159,660.49

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，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。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实瑞享定期开放灵活配置混合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)报告期内嘉实瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 10 月 22 日