

嘉实主题新动力混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 20 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 16 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 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实主题新动力混合
基金主代码	070021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 7 日
报告期末基金份额总额	430,693,677.39 份
投资目标	充分把握驱动中国经济发展和结构转型所带来的主题性投资机会，并在主题的指引下精选具有高成长潜力的上市公司，力争获取长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	<p>本基金通过发掘驱动经济增长及结构转型的新兴增长动力，并以新兴增长动力所指引的主题性投资机会作为主要的投资线索，将主题投资策略融入本基金自上而下的管理流程中。首先，本基金力求前瞻性研判驱动经济发展及转型的新兴增长动力所带来的投资主题；其次，根据投资主题的广度及数量、以及经济周期与市场因素决定大类资产配置决策，其中本基金优先考虑股票类资产的配置；再次，在股票投资上，本基金将深入挖掘有望受益于该主题的上市公司股票；最后，在综合考量投资组合的风险与收益的原则下，完成构建并定期调整本基金的投资组合。</p> <p>具体包括：主题发掘、资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数*95%+上证国债指数*5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、较高收益的品种。
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
-------	--------------

§ 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（2021年4月1日-2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	79,495,721.60
2. 本期利润	254,453,456.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.6111
4. 期末基金资产净值	1,622,477,590.26
5. 期末基金份额净值	3.767

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

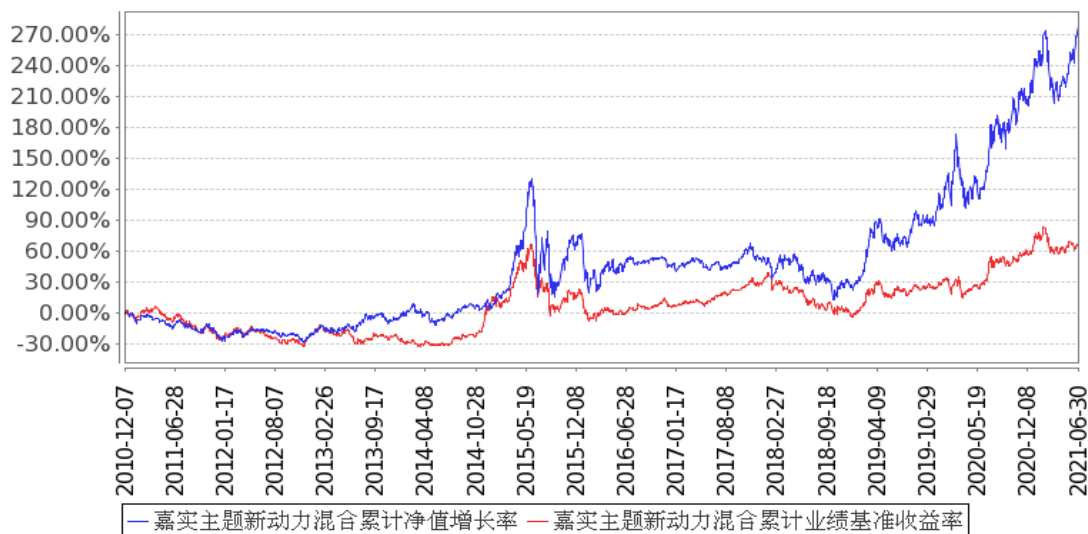
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	19.28%	1.10%	3.36%	0.93%	15.92%	0.17%
过去六个月	16.70%	1.57%	0.36%	1.25%	16.34%	0.32%
过去一年	56.37%	1.81%	24.32%	1.27%	32.05%	0.54%
过去三年	181.12%	1.87%	47.24%	1.30%	133.88%	0.57%
过去五年	149.31%	1.61%	63.55%	1.12%	85.76%	0.49%
自基金合同 生效起至今	276.70%	1.71%	66.24%	1.36%	210.46%	0.35%

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

嘉实主题新动力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

(2010年12月07日至2021年06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 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
曲盛伟	本基金、嘉实逆向策略股票基金经理	2017年12月12日	-	10年	曾任融通基金管理有限公司、泰康资产管理有限责任公司、长盛基金管理有限公司、上海磐信投资管理有限公司股票研究员，海富通基金管理有限公司投资经理，上海盘京投资管理中心基金经理助理。2017年10月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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

实主题新动力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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内资本市场趋于平稳，宏观流动性没有像预期中大幅收紧，甚至美国继续保持较高的宽松水平。经历一季报业绩考验，高估值的核心资产出现分化。而二级市场的超额收益来源，出现在了新兴的戴维斯双击领域，尤其是低估值赛道切换好赛道类资产。虽然该类超额收益充满短期主义色彩，但从市场的估值和企业自身发展向往角度，产生了股价对基本面引领性的“反身性”。越来越多的企业，向着新兴成长领域，向着高质量发展方向前进，是资本市场对于企业正积极的影响。

报告期内涨幅前五的行业分别为基础化工 25.73%，钢铁 24.69%，电力设备与新能源 24.32%，综合 20.95%，煤炭 17.51%。其中基础化工领域主要涨幅居前为新能源，化妆品等新兴化工细分行业。体现低估值修复和高景气弹性的双重驱动。涨幅后五分别非银金融-17.49%，家电-14.38%，国防军工-10.44%，房地产-9.87%，农林牧渔-9.02%。体现高估值阶段性被杀和行业景气下滑与以上涨幅居前恰巧相反的内在逻辑。

A 股是市经济发展的缩影，中国经济正进入高质量发展时期。好的趋势带来结构性受益行业和公司的高歌猛进，我们会伴随其一同向前。但再好的趋势，也会有一些好行业好公司阶段性会遇到小的困难，对于第二类公司我们也会以合适的仓位与之共同前进，以不拘一格的眼光发现其潜在价值，等待他们的绽放。报告期内我们增加了具备合理安全价格伟大格局观践行者的储备，我们组合的公司、行业、资产类别相比过去成倍数扩张。不同行业不同类型的优质资产组合让组

合整体表现更加丰富多彩。

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 3.767 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.28%，业绩比较基准收益率为 3.36%。

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	1,525,065,440.40	92.59
	其中：股票	1,525,065,440.40	92.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,212,473.60	0.80
	其中：债券	13,212,473.60	0.80
	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	95,014,078.69	5.77
8	其他资产	13,792,797.29	0.84
9	合计	1,647,084,789.98	100.00

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,274,192,673.55	78.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	33,843,500.77	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	50,754,489.00	3.13

H	住宿和餐饮业	32,540,120.92	2.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,194,208.54	4.26
J	金融业	34,721.10	0.00
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	64,444,264.00	3.97
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	0.00
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	1,525,065,440.40	94.00

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	601012	隆基股份	1,157,491	102,831,500.44	6.34
2	600438	通威股份	2,263,114	97,924,942.78	6.04
3	002459	晶澳科技	1,744,200	85,465,800.00	5.27
4	002597	金禾实业	2,305,841	80,012,682.70	4.93
5	002180	纳思达	2,456,257	79,091,475.40	4.87
6	601233	桐昆股份	3,280,962	79,038,374.58	4.87
7	603113	金能科技	4,333,886	78,269,981.16	4.82
8	601038	一拖股份	4,337,763	71,573,089.50	4.41
9	300416	苏试试验	2,814,160	64,444,264.00	3.97
10	603906	龙蟠科技	1,765,220	61,782,700.00	3.81

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

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	10,006,000.00	0.62
	其中：政策性金融债	10,006,000.00	0.62
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）	3,206,473.60	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,212,473.60	0.81

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	210201	21 国开 01	100,000	10,006,000.00	0.62
2	113574	华体转债	31,240	3,206,473.60	0.20

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	460,675.33
2	应收证券清算款	12,472,648.13
3	应收股利	-
4	应收利息	119,365.17
5	应收申购款	740,108.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,792,797.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113574	华体转债	3,206,473.60	0.20

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	417,341,436.10
报告期期间基金总申购份额	70,607,394.67
减：报告期期间基金总赎回份额	57,255,153.38
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	430,693,677.39

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实主题新动力混合型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实主题新动力混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实主题新动力混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实主题新动力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) 报告期内嘉实主题新动力混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 7 月 20 日