嘉实事件驱动股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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2019年4月17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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实事件驱动股票
基金主代码	001416
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
报告期末基金份额总额	6,398,972,853.89份
投资目标	立足于中国特定的投资环境,将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内,在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会,通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式,选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资,力争实现投资者的长期稳定增值。
投资策略	事件性投资是主题性投资在标的股票上的具体表现形式。而相对于主题性投资相对宽泛的投资概念而言,事件性投资更加具体,与标的股票的联系更加紧密。在事件分析的投资决策框架内,事件性投资可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益,以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性,从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性,确保了超额收益的渐进式稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
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。
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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-171,765,494.66
2.本期利润	1,095,978,193.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.1685
4.期末基金资产净值	4,611,139,929.21
5.期末基金份额净值	0.721

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	30.62%	1.45%	22.78%	1.24%	7.84%	0.21%

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

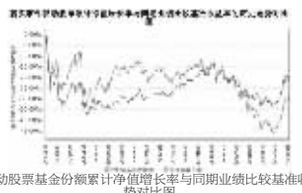

图:嘉实事件驱动股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月9日至2019年3月31日)

注:1.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。

2.2019年1月17日,本基金管理人发布《关于新增嘉实事件驱动股票基金经理的公告》,增聘张楠先生担任本基金基金经理职务,与基金经理张自力先生共同管理本基金。

§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		
张自力	本基金、嘉实美国成长股票(QDII)基金经理	2015年6月9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。
张楠	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理	2019年1月17日	-	7年	2012年1月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理张自力的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理张楠的任职日期是指公司做出决定后公告之日;(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、《嘉实事件驱动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 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,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1次,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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,A股市场整体上行,投资者情绪逐步转暖。

进入2019年后,基本面基本没有新增的强势负面信息,来自外部的中美贸易摩擦已逐步转入相持谈判并伴有相互让步妥协同时减缓关税的潜在利好预期,国内方面年初即有货币政策的推出,政府对民营企业、高科技研发、产业自主权等方面延续了2018年工作力度,市场也在大幅回撤后有了一定的估值上升空间。

风格上,一月份仍为大盘主导上行,二月份则转入小盘、成长风格上行,业绩稳健成长及超预期、长期反转、流动性、市值等风格因子在二月份开始快速上行。TMT板块、5G概念、猪周期主题等在一季度内都有很强的上行弹性,传统优质白马股及白酒白电板块在一季度内也稳健上行。

报告期内,本组合严格遵守基金合同的约定,基于量化模型,构建多类事件驱动子策略,包括但不限于财报业绩加速事件、扭亏事件、股东高管增持事件、股权激励事件、重大重组事件、定向增发事件、限售股解禁事件、重大诉讼和关联交易事件、企业变革事件、国企改革国资注入事件、指数成分股调整事件、宏观对冲事件等,建立自下而上的主动选股模型。同时,本组合通过行业、风格、风险等维度的控制,进行组合优化,避免个别风格过于集中的风险暴露。本期内,组合根据国家政策、宏观经济周期以及对市场风格、境外资金、机构投资者的监控,积极布局市场发展方向。

组合作为股票型基金,在一季度内满足80%-95%的股票仓位约束,后续将坚持主动股票型的高仓位运作,坚持整体稳健的投资风格,对各类事件驱动型策略进行相应调整和优化,进一步控制风险和波动,希望取得更好的投资效果,回馈投资者。

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0.721元;本报告期基金份额净值增长率为30.62%,业绩比较基准收益率为22.78%。

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	4,064,985,460.34	87.87
	其中:股票	4,064,985,460.34	87.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	225,415,879.60	4.87
	其中:债券	225,415,879.60	4.87
	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	288,170,562.41	6.23
8	其他资产	47,737,996.03	1.03
9	合计	4,626,309,898.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	190,373,813.35	4.13
B	采矿业	101,292,213.26	2.20
C	制造业	2,360,778,129.80	51.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,734,871.00	0.17
E	建筑业	367.20	0.00
F	批发和零售业	27,594,836.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	15,521,298.78	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	603,582,111.53	13.09
J	金融业	367,107,556.83	7.96
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	161,975,528.00	3.51
N	水利、环境和公共设施管理业	4,431,633.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	224,593,101.59	4.87
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,064,985,460.34	88.16

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	000661	长春高新	648,439	205,548,678.61	4.46
2	300012	华测检测	18,406,310	161,975,528.00	3.51
3	600763	通策医疗	2,292,568	161,626,044.00	3.51
4	002475	立讯精密	6,291,186	156,021,412.80	3.38
5	601318	中国平安	1,851,820	142,775,322.00	3.10
6	600276	恒瑞医药	1,930,297	126,280,029.74	2.74
7	002179	中航光电	2,138,519	86,909,412.16	1.88
8	600519	贵州茅台	98,020	83,708,099.80	1.82
9	002415	海康威视	2,327,138	81,612,729.66	1.77
10	300059	东方财富	4,037,380	78,244,424.40	1.70

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	225,415,879.60	4.89
	其中:政策性金融债	225,415,879.60	4.89
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,415,879.60	4.89

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	180209	18国开09	1,300,000	130,351,000.00	2.83
2	018005	国开1701	499,460	49,950,994.60	1.08
3	180312	18进出12	400,000	40,112,000.00	0.87
4	108603	国开1804	49,770	5,001,885.00	0.11

注:报告期末,本基金仅持有上述4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

5.9.1 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
IC1904	IC1904	138	152,666,640.00	6,185,600.00	-
IF1904	IF1904	80	93,062,400.00	3,656,280.00	-
IC1906	IC1906	20	21,928,000.00	400,520.00	-
公允价值变动总额合计(元)					10,242,400.00
股指期货投资本期收益(元)					24,750,407.76
股指期货投资本期公允价值变动(元)					10,242,400.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

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

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	37,070,961.14
2	应收证券清算款	4,288,582.31
3	应收股利	-
4	应收利息	5,808,761.78
5	应收申购款	569,690.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,737,996.03

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	6,566,381,649.04
报告期期间基金总申购份额	22,711,623.00
减:报告期期间基金总赎回份额	190,120,418.15
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	6,398,972,853.89

注:报告期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。

§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事件驱动股票型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实事件驱动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) 报告期内嘉实事件驱动股票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4月20日

嘉实泰和混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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。

嘉实泰和混合型证券投资基金由泰和证券投资基金转型而成。

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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实泰和混合
基金主代码	000595
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月4日
报告期末基金份额总额	452,301,472.19份
投资目标	分享中国改革与发展成果,密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要参考公司股票投资决策委员会形成的大类资产配置建议,综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+上证国债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,218,571.34
2.本期利润	251,940,993.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.5367
4.期末基金资产净值	1,063,807,194.30
5.期末基金份额净值	2.352

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	29.73%	1.50%	19.90%	1.09%	9.83%	0.41%

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

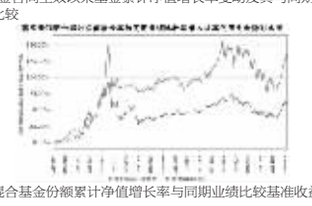

图:嘉实泰和混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年4月4日至2019年3月31日)

注:1.本基金转型日期为2014年4月4日。

2.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		
归凯	本基金、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实新兴产业股票基金经理	2016年3月10日	-	12年	曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014年5月加入嘉实基金管理有限公司,任机构投资部投资经理一职。

注:(1)任职日期、离任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、《嘉实泰和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,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1次,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 报告期内基金投资策略和运作分析

年初至今国内经济下行压力仍大,但宏观流动性和市场的风险偏好出现了积极的变化。一方面是决策层去年底开始强调逆周期调控以来,国内去杠杆进程开始放缓,市场无风险利率和金融机构加权贷款利率都显著下降,流动性紧张的局面得到缓解;另一方面是市场对中美贸易谈判的前景以及中国深化改革的预期开始乐观,市场的风险偏好大幅提升。上述因素叠加A股较低的估值水平,是年初以来市场大幅反弹的主要因素。另外,虽然宏观经济仍有压力,但微观层面出现一些转好迹象,比如年初以来居民消费数据明显好于市场预期。考虑到减税降费客观上会增加居民收入,其对居民消费的影响需要重点关注。

本基金年初以来仓位提升,在持仓结构上超配消费、医药健康、TMT等受宏观经济影响相对较小的行业,规避中上游顺周期或过度依赖政府投资的行业。

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2.352元;本报告期基金份额净值增长率为29.73%,业绩比较基准收益率为19.90%。

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	991,329,274.46	92.57
	其中:股票	991,329,274.46	92.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,451,733.90	4.43
	其中:债券	47,451,733.90	4.43
	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	30,659,067.00	2.86
8	其他资产	1,421,717.99	0.13
9	合计	1,070,861,793.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	61,620,522.00	5.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	590,159,446.24	55.48
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	88,312,596.00	8.30
G	交通运输、仓储和邮政业	28,045,084.22	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,912,623.20	4.69
J	金融业	62,499,762.00	5.88
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	103,640,952.80	9.74
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	7,138,288.00	0.67
S	综合	-	-
	合计	991,329,274.46	93.19

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	300012	华测检测	11,777,381	103,640,952.80	9.74
2	000661	长春高新	219,969	69,727,973.31	6.55
3	601933	永辉超市	7,555,400	65,278,656.00	6.14
4	601318	中国平安	808,890	62,365,419.00	5.86
5	000998	隆平高科	3,789,700	61,620,522.00	5.79
6	600872	中炬高新	1,605,990	58,747,114.20	5.52
7	002179	中航光电	1,343,909	54,616,461.76	5.13
8	300285	国瓷材料	2,435,240	53,331,756.00	5.01
9	600519	贵州茅台	59,545	50,850,834.55	4.78
10	000063	中兴通讯	1,471,600	42,970,720.00	4.04

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	47,451,733.90	4.46
	其中:政策性金融债	47,451,733.90	4.46
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,451,733.90	4.46

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	180312	18进出12	400,000	40,112,000.00	3.77
2	018005	国开1701	73,390	7,339,733.90	0.69

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

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	177,216.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	924,846.16
5	应收申购款	319,655.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,421,717.99

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	477,052,480.23
报告期期间基金总申购份额	11,836,624.70
减:报告期期间基金总赎回份额	36,587,632.74
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	452,301,472.19

注:报告期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。

§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)中国证监会核准泰和证券投资基金转型的文件;

(2)《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实泰和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) 报告期内嘉实泰和混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

(1)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)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

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4月20日

嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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2019年4月17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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	230,651,137.14份
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。
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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	16,285,227.11
2.本期利润	61,422,432.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.2531
4.期末基金资产净值	244,366,547.40
5.期末基金份额净值	1.059

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	31.06%	1.52%	31.36%	1.63%	-0.30%	-0.11%

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

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