

## 嘉实泰和混合型证券投资基金

### 2019年第二季度报告

(四) 投资限制)的有关约定。

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职本基金的基金经理日期	证券从业资格	说明
刘斌	本基金、嘉实成长优选混合型证券投资基金、嘉实新兴产业混合型证券投资基金基金经理	2019年03月10日	13年	曾任泰达宏利基金研究员、基金经理, 2014年6月加入嘉实基金管理有限公司, 历任研究员、基金经理、基金经理

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,006,261,272.31	93.86
2	其中:股票	1,006,261,272.31	93.86
3	基金投资	--	--
4	固定收益投资	47,989,654.40	4.54
5	其中:债券	47,989,654.40	4.54
6	货币市场工具	--	--
7	衍生品投资	--	--
8	其他资产	3,949,056.73	0.37
9	合计	1,058,200,983.44	100.00

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	7,426,654.40	6.97
2	央行票据	--	--
3	金融债	40,064,000.00	3.80
4	其中:政策性金融债	40,064,000.00	3.80
5	企业债	--	--
6	央行定向债	--	--
7	可转债(可交换债)	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	47,989,654.40	4.57

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	医药、化学制药	4,062,000.00	3.84
B	农林牧渔	9,326,280.00	1.19
C	制造业	136,419,233.88	50.47
D	电力、热力、燃气及水务供应	9,307,273.00	3.47
E	建筑业	5,687,628.00	2.12
F	批发和零售业	10,969,948.00	4.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,896,003.00	1.82
H	金融业	14,321,022.50	5.32
I	信息技术业	9,779,320.00	3.62
K	房地产业	13,146,153.00	4.84
L	批发和零售业	8,694,588.00	3.24
M	科学研究和技术服务业	1,094,098.00	0.40
N	采矿业	2,340,000.00	0.86
O	国防军工	1,461,260.00	0.54
P	教育	1,611,260.00	0.64
Q	卫生和社会工作	2,340,000.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	7,942,868.00	2.96
S	综合	5,601,463.17	2.10
合计		244,129,369.20	90.58

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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	债券品种	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	7,426,654.40	6.97
2	央行票据	--	--
3	金融债	40,064,000.00	3.80
4	其中:政策性金融债	40,064,000.00	3.80
5	企业债	--	--
6	央行定向债	--	--
7	可转债(可交换债)	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	47,989,654.40	4.57

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	医药、化学制药	4,062,000.00	3.84
B	农林牧渔	9,326,280.00	1.19
C	制造业	136,419,233.88	50.47
D	电力、热力、燃气及水务供应	9,307,273.00	3.47
E	建筑业	5,687,628.00	2.12
F	批发和零售业	10,969,948.00	4.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,896,003.00	1.82
H	金融业	14,321,022.50	5.32
I	信息技术业	9,779,320.00	3.62
K	房地产业	13,146,153.00	4.84
L	批发和零售业	8,694,588.00	3.24
M	科学研究和技术服务业	1,094,098.00	0.40
N	采矿业	2,340,000.00	0.86
O	国防军工	1,461,260.00	0.54
P	教育	1,611,260.00	0.64
Q	卫生和社会工作	2,340,000.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	7,942,868.00	2.96
S	综合	5,601,463.17	2.10
合计		244,129,369.20	90.58

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《证券投资基金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守了《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约定,不存在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,本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流程和流程独立决策,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未超过该证券当日成交量的5%,合计3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内经济仍有下行压力,宏观流动性延续一季度相对宽松局面。但因中美贸易谈判前出现反复,市场风险偏好受到压制,市场出现明显回调。

从市场表现看,二季度板块结构分化较大,具备“核心资产”属性的个股,特别是消费类优质个股逆势走强,而受宏观周度下行和贸易战影响较大的板块跌幅较大。市场的分化其实在微观层面可以得到验证,比如年初以来高端白酒、高档汽车、医疗服务等细分领域保持较好的景气度,消费升级趋势明显。

本基金年初以来以大消费、医药、科技、先进制造为重点投资方向,精选个股并保持结构上的相对均衡,二季度取得显著的正相对收益。

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2.620元;本报告期基金份额净值增长率为10.88%,业绩比较基准收益率为-0.48%。

4.6 报告期内基金持有人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

5.1.4 报告期末未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。

5.1.5 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。

5.6 开放式基金份额变动

项目	报告期末基金份额总额	报告期初基金份额总额
报告期末基金份额总额	462,361,474.19	38,007,678.58
报告期基金份额申购总额	38,007,678.58	38,007,678.58
报告期基金份额赎回总额	38,007,678.58	38,007,678.58
报告期基金份额净申购(赎回)额	0.00	0.00
报告期基金份额转入	0.00	0.00
报告期基金份额转出	0.00	0.00
报告期基金份额折算	0.00	0.00
报告期基金份额其他变动	0.00	0.00

注:报告期内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。

5.7 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。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

2019年6月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019年6月12日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》,公司法定代表人变更为徐晋先生。

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准嘉实基金转型的文件;

(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。

9.2 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)北京市西城区南口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

9.3 查阅方式

(1)书面查询:查询时间为工作日8:30-11:30,13:00-17:30,投资者可免费查阅,也可拨打本客服购买印件。

(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7月17日

## 嘉实泰和混合型证券投资基金

### 2019年第二季度报告

(四) 投资限制)的有关约定。

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职本基金的基金经理
----	----	------------