

# 嘉实新思路灵活配置混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

截至本报告期末本基金份额净值为1.106元；本报告期基金份额净值增长率为0.36%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

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      | 60,761,769.08  | 53.07       |
| 2  | 固定收益      | 60,761,769.08  | 53.07       |
| 3  | 基金投资      | 10,067,000.00  | 8.85        |
| 4  | 其中:结构化金融债 | -              | -           |
| 5  | 其他        | -              | -           |
| 6  | 合计        | 131,590,538.16 | 100.00      |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业名称 | 金额(元)         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 制造业  | 32,249,249.99 | 29.14        |
| 2  | 信息技术 | 18,249,249.99 | 16.58        |
| 3  | 金融   | 10,249,249.99 | 9.27         |
| 4  | 医药   | 8,249,249.99  | 7.46         |
| 5  | 其他   | 12,013,020.10 | 10.87        |
| 6  | 合计   | 80,809,019.06 | 73.32        |

#### 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 | 证券代码   | 证券名称 | 数量(股)        | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|--------------|
| 1  | 601318 | 工商银行 | 1,432,000    | 6,439,701.00 | 5.81         |
| 2  | 600897 | 伊泰股份 | 262,000      | 6,439,300.00 | 5.81         |
| 3  | 600196 | 电科投资 | 2,286,000    | 6,226,480.00 | 5.61         |
| 4  | 600198 | 中国银行 | 1,106,428    | 6,201,980.72 | 5.59         |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 1,247,700    | 6,206,040.00 | 5.59         |
| 6  | 601388 | 工商银行 | 1,313,430.00 | 5,901.00     | 0.00         |
| 7  | 600026 | 山东钢铁 | 220,000      | 7,944,300.00 | 7.14         |
| 8  | 601126 | 招商银行 | 390,000      | 7,910,800.00 | 7.09         |
| 9  | 300022 | 科大讯飞 | 347          | 37,796.34    | 0.04         |
| 10 | 600987 | 新华锦  | 2,222        | 30,488.22    | 0.03         |

#### 5.4 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  | 000000 | 国债逆回购 | 1,307,400.000  | 1,307,400.00  | 1.19         |
| 2  | 000000 | 国债逆回购 | 13,010,000.000 | 13,010,000.00 | 11.74        |
| 3  | 000000 | 国债逆回购 | 20,000,000.000 | 20,000,000.00 | 18.08        |
| 4  | 000000 | 国债逆回购 | 30,000,000.000 | 30,000,000.00 | 27.07        |
| 5  | 000000 | 国债逆回购 | 40,000,000.000 | 40,000,000.00 | 36.09        |
| 6  | 000000 | 国债逆回购 | 50,000,000.000 | 50,000,000.00 | 45.11        |
| 7  | 000000 | 国债逆回购 | 60,000,000.000 | 60,000,000.00 | 54.13        |
| 8  | 000000 | 国债逆回购 | 70,000,000.000 | 70,000,000.00 | 63.15        |
| 9  | 000000 | 国债逆回购 | 80,000,000.000 | 80,000,000.00 | 72.17        |
| 10 | 000000 | 国债逆回购 | 90,000,000.000 | 90,000,000.00 | 81.19        |

#### 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十名权证投资明细

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 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贵金属投资明细

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.9 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.10 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.11 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.12 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.13 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.14 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.15 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.16 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.17 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.18 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.19 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.20 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.21 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.22 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.23 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.24 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.25 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.26 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.27 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.28 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.29 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.30 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.31 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.32 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.33 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

| 序号 | 权证代码   | 权证名称 | 数量(份)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 000000 | 权证   | 1,000,000 | 1,000,000.00 | 0.90         |

#### 5.34 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

| 序号 | 贵金属代码  | 贵金属名称 | 数量(克)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000000 | 黄金    | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.35 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股指期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | IF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

#### 5.36 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国债期货投资明细

| 序号 | 合约名称   | 持仓数量    | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | TF1907 | 100,000 | 100,000.00 | 0.09         |

# 嘉实新添康定期开放混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

截至本报告期末本基金份额净值为1.106元；本报告期基金份额净值增长率为0.36%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

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      | 60,761,769.08  | 53.07       |
| 2  | 固定收益      | 60,761,769.08  | 53.07       |
| 3  | 基金投资      | 10,067,000.00  | 8.85        |
| 4  | 其中:结构化金融债 | -              | -           |
| 5  | 其他        | -              | -           |
| 6  | 合计        | 131,590,538.16 | 100.00      |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业名称 | 金额(元)         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 制造业  | 32,249,249.99 | 29.14        |
| 2  | 信息技术 | 18,249,249.99 | 16.58        |
| 3  | 金融   | 10,249,249.99 | 9.27         |
| 4  | 医药   | 8,249,249.99  | 7.46         |
| 5  | 其他   | 12,013,020.10 | 10.87        |
| 6  | 合计   | 80,809,019.06 | 73.32        |

#### 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 | 证券代码   | 证券名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|---------|--------------|
| 1  | 601318 |      |       |         |              |