

嘉实策略增长混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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的规定，于2019年7月15日核对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。投资人投资于基金前应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告期间的财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：嘉实策略混合

基金主代码：070011

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年12月12日

报告期末基金份额总额：9,132,267,894.80份

投资目标：通过有效的风险控制并代偿其未来表现，投资于风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本报告的招募说明书。

本报告期间的财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期2019年4月1日至2019年6月30日

1.本期已实现收益 -11,072,026.08

2.本期利润 -214,888,676.09

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0662

4.期末基金资产净值 3,287,391,636.00

5.期末基金份额净值 1.040

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)上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

过去三个月 -6.14% 1.80% -0.59% 1.10% -5.66% 0.06%

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1:嘉实策略混合基金成立以来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

注：嘉实策略混合基金份额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

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。投资人投资于基金前应仔细阅读基金的招募说明书。

本基金管理人根据香港《证券及期货条例》第104条在香港获得证券及期货事务监察委员会认可，不可代表本公司持有的证券或期货买卖。

基金管理人不可向香港公众销售证券或期货买卖，除非获证券及期货事务监察委员会认可或其作出相应的豁免。此外，不接受本公司持有的证券或期货买卖的所有投资者，亦不可代表本公司持有的证券或期货买卖。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)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

邵淳海 嘉实基金管理有限公司 副总经理兼基金总经理 2006年1月加入嘉实基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理、基金经理、研究总监、公司总经理助理、公司总经理，现为公司副总经理兼基金总经理。

注：(1)任职业日期、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《证券从业人员资格管理办法》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

报告期内，基金管理人严格遵循《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实策略增长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，诚实信用、勤勉尽责的履行管理责任和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定和约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，公平对待旗下所有管理的基金，未发生不公平对待旗下不同基金的情况。

4.4 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.5 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.6 报告期内基金的费用情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金费用的情况。

4.7 其他费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他费用的情况。

4.8 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.9 其他费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他费用的情况。

4.10 报告期内发生的会计师费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生会计师费用的情况。

4.11 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给会计师的费用。

4.12 报告期内发生的诉讼费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生诉讼费用的情况。

4.13 报告期内因基金估值或计算错误而支付给诉讼参与人的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给诉讼参与人的费用。

4.14 报告期内发生的税项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生税项的情况。

4.15 报告期内计提的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未计提法定基金会计盈余公积。

4.16 报告期内返还的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未返还法定基金会计盈余公积。

4.17 报告期内发生的其他重要事项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他重要事项。

4.18 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.19 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.20 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.21 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给会计师的费用。

4.22 报告期内发生的诉讼费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生诉讼费用的情况。

4.23 报告期内返还的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未返还法定基金会计盈余公积。

4.24 报告期内发生的其他重要事项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他重要事项。

4.25 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.26 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.27 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.28 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给会计师的费用。

4.29 报告期内发生的诉讼费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生诉讼费用的情况。

4.30 报告期内返还的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未返还法定基金会计盈余公积。

4.31 报告期内发生的其他重要事项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他重要事项。

4.32 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.33 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.34 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.35 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给会计师的费用。

4.36 报告期内发生的诉讼费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生诉讼费用的情况。

4.37 报告期内返还的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未返还法定基金会计盈余公积。

4.38 报告期内发生的其他重要事项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他重要事项。

4.39 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.40 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.41 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.42 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金估值或计算错误而支付给会计师的费用。

4.43 报告期内发生的诉讼费用

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生诉讼费用的情况。

4.44 报告期内返还的法定基金会计盈余公积

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未返还法定基金会计盈余公积。

4.45 报告期内发生的其他重要事项

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生其他重要事项。

4.46 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未进行利润分配。

4.47 报告期内基金的税收情况

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生基金应纳税款的情况。

4.48 报告期内信息披露费

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，未发生信息披露费的情况。

4.49 报告期内因基金估值或计算错误而支付给会计师的费用