

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数或基金份额净值预警说明无。

5.5 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 60,751,369.00 53.27

2 固定收益 60,751,369.00 53.27

3 固定收益投资 52,226,978.00 46.79

4 股票 52,226,978.00 46.79

5 买入返售金融资产 -

6 金融衍生品投资 -

7 衍生工具(可交债) -

8 回购证券 -

9 其他 -

10 合计 121,982,337.00 100.00

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股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 143006 177801 100,000 10,067,000.00 0.09

2 111912013 193500 100,000 9,707,000.00 0.08

3 111000108 190801 100,000 9,705,000.00 0.08

4 112734 178001 50,000 5,091,560.00 0.05

5 112626 177801 40,000 4,579,680.00 0.04

6 112626 177801 30,000 3,439,040.00 0.03

7 002098 00230 20,000 2,000,000.00 0.02

8 002658 002658 10,000 1,000,000.00 0.01

9 002727 111000 10,000 1,000,000.00 0.01

10 002946 002946 2,223 33,666.22 0.003

5.7 报告期内基金资产组合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 -

B 制造业 -

C 信息业 8,542,620.77 0.21

D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 -

E 建筑业 -

F 交通运输、仓储和邮政业 -

G 公用事业、金融、房地产业 -

H 白零售业 -

I 自营贸易、软件和信息技术服务业 -

J 其他服务业 52,188,807.72 0.016

K 采矿业 -

L 制造业和服务业 -

M 行业研究和试验发展服务 -

N 水利、环境和公共设施管理业 -

O 国防、公安、司法、教育、科学、文化、卫生、体育和娱乐业 -

P 财政、社会保障和住房保障业 -

Q 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 -

R 建筑业 -

S 交通运输、仓储和邮政业 -

T 信息业 -

U 公用事业、金融、房地产业 -

V 白零售业 -

W 交通运输、仓储和邮政业 -

X 信息业 -

Y 公用事业、金融、房地产业 -

Z 其他服务业 -

合计 60,751,369.00 53.27

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十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002300 002300 5,422,900.00 4.64

2 002098 002098 4,500,000.00 3.91

3 002658 002658 3,000,000.00 2.60

4 002727 002727 2,000,000.00 1.73

5 002946 002946 1,800,000.00 1.55

6 002098 002098 1,500,000.00 1.28

7 002658 002658 1,000,000.00 0.85

8 002727 002727 1,000,000.00 0.85

9 002946 002946 1,000,000.00 0.85

10 002098 002098 1,000,000.00 0.85

5.9 报告期内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组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 21,202,709.00 14.26

2 固定收益 21,202,709.00 14.26

3 固定收益投资 269,253,730.00 77.56

4 股票 269,253,730.00 77.56

5 买入返售金融资产 -

6 金融衍生品投资 -

7 衍生工具(可交债) -

8 回购证券 -

9 其他 -

10 合计 536,997,206.00 100.00

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十名股票投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家队基金 1,197,800.00 1.02

2 行业轮动 -

3 金融债券 13,010,000.00 1.20

4 企业债 25,044,900.00 2.31

5 企业短期融资券 6,020,000.00 0.46

6 中期票据 61,168,500.00 4.73

7 可转债(可交债) 262,972.00 0.02

8 回购证券 20,111,000.00 16.03

9 其他 -

10 合计 124,784,460.00 100.00

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十名股票投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家队基金 5,000,000.00 4.00

2 行业轮动 -

3 金融债券 13,010,000.00 1.20

4 企业债 25,044,900.00 2.31

5 企业短期融资券 6,020,000.00 0.46

6 中期票据 61,168,500.00 4.73

7 可转债(可交债) 262,972.00 0.02

8 回购证券 20,111,000.00 16.03

9 其他 -

10 合计 124,784,460.00 100.00

5.12 报告期内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组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家队基金 1,197,800.00 1.02

2 行业轮动 -

3 金融债券 13,010,000.00 1.20

4 企业债 25,044,900.00 2.31

5 企业短期融资券 6,020,000.00 0.46

6 中期票据 61,168,500.00 4.73

7 可转债(可交债) 262,972.00 0.02

8 回购证券 20,111,000.00 16.03

9 其他 -

10 合计 124,784,460.00 100.00

5.13 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 中国银河 50,041,24

2 中国光大银行 831,022,44

3 中国银行 500,000.00

4 中国建设银行 889,069,66

5 其他 -

6 合计 889,069,66

5.14 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 143006 177801 100,000 0.09

2 111912013 193500 100,000 0.09

3 111000108 190801 100,000 0.09

4 112734 178001 50,000 0.05

5 112626 177801 50,000 0.05

6 112626 177801 30,000 0.03

7 112626 177801 20,000 0.02

8 112626 177801 10,000 0.01

9 112626 177801 10,000 0.01

10 112626 177801 10,000 0.01

11 112626 177801 10,000 0.01

12 112626 177801 10,000 0.01

13 112626 177801 10,000 0.01

14 112626 177801 10,000 0.01

15 112626 177801 10,000 0.01

16 112626 177801 10,000 0.01

17 112626 177801 10,000 0.01

18 112626 177801 10,000 0.01

19 112626 177801 10,000 0.01

20 112626 177801 10,000 0.01

21 112626 177801 10,000 0.01

22 112626 177801 10,000 0.01

23 112626 177801 10,000 0.01

24 112626 177801 10,000 0.01