

# 嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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

送出日期：2019 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金
基金简称	嘉实量化阿尔法混合
基金主代码	070017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 20 日
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
报告期末基金份额总额	171,104,633.66 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配置大类资产：股票投资以“定量投资”为主，依托内部自主研发的嘉实行业选择模型、嘉实 Alpha 多因素模型以及嘉实组合优化器以及强大的数据库系统，同时辅以“定性投资”策略；债券投资采取“自上而下”的策略。
业绩比较基准	中证 800 指数*95%+上证国债指数*5%
风险收益特征	较高风险，较高收益

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	21,161,241.27
本期利润	43,986,722.87
加权平均基金份额本期利润	0.2509
本期加权平均净值利润率	21.29%
本期基金份额净值增长率	24.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配利润	39,021,273.34
期末可供分配基金份额利润	0.2281
期末基金资产净值	210,125,907.00
期末基金份额净值	1.228
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)
基金份额累计净值增长率	53.41%

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）所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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	4.42%	1.17%	4.10%	1.13%	0.32%	0.04%
过去三个月	-3.61%	1.48%	-3.35%	1.49%	-0.26%	-0.01%
过去六个月	24.80%	1.49%	23.65%	1.49%	1.15%	0.00%
过去一年	0.57%	1.43%	11.21%	1.32%	-10.64%	0.11%

过去三年	-8.36%	1.17%	22.37%	0.91%	-30.73%	0.26%
自基金合同生效起至今	53.41%	1.62%	69.07%	1.16%	-15.66%	0.46%

注:本基金业绩比较基准为:中证 800 指数×95%+上证国债指数×5%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制,它的样本选自沪深两个证券市场 800 只股票,具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。由于本基金优先配置股票资产,债券、现金类资产主要作为流动性管理工具,因此本基金采用上述两个指数组成的复合指数作为业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

$$\text{Return}(t)=95\% \times (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{上证国债指数}(t) / \text{上证国债指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实量化阿尔法混合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

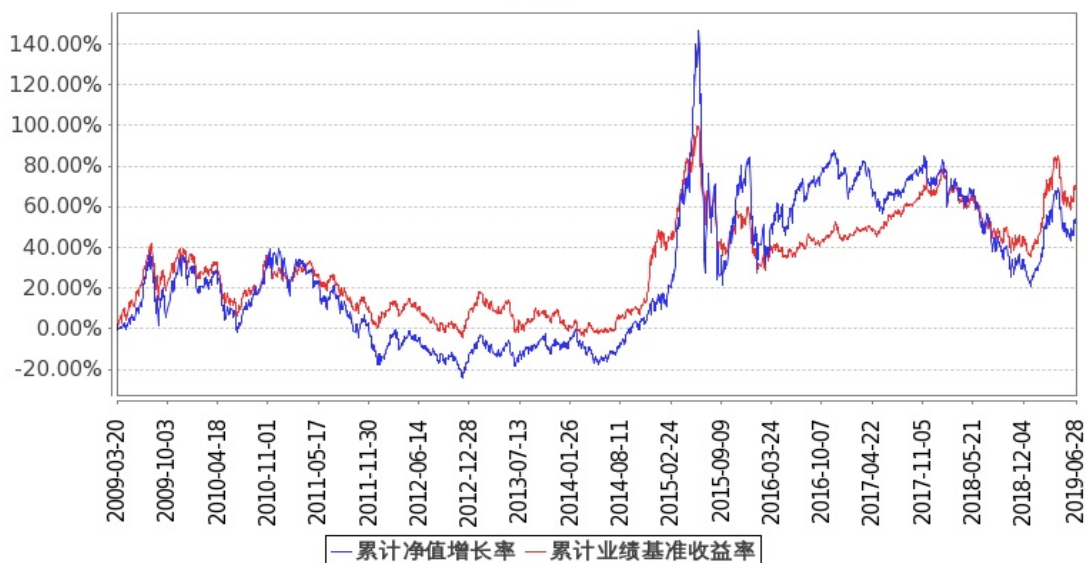


图: 嘉实量化阿尔法混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 3 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日)

注：根据本基金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第十一部分（二、投资范围和五、（二）投资组合限制）的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉

实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张楠	本基金、嘉实事件驱动股票、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理	2018 年 1 月 5 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。
金猛	本基金、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理	2018 年 9 月 20 日	-	7 年	曾任职于安信基金管理有限责任公司，从事风险控制工作。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职

					于量化投资部。
--	--	--	--	--	---------

注：（1）任职日期、离职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；（3）2019 年 8 月 1 日，本基金管理人发布《关于嘉实量化阿尔法混合基金经理变更的公告》，张楠先生不再担任本基金基金经理，由原基金经理金猛先生单独管理本基金。

## 4.2 管理人对报告期内本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、《嘉实量化阿尔法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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 4 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年各品类大类资产均有不俗表现，上证综指涨幅接近 20%，工业品、不动产及黄金也获得了 10% 以上的涨幅，信用债和利率债资产的表现则相对落后。从风险资产的表现节奏上看，在一季度出现显著的估值修复后从 4 月中旬开始了不同程度的回撤，且价格波动剧烈；于此同时黄金等避险资产收到了资金的追捧。回顾报告期内资产表现的驱动因素，我们认为币政策的边际放松与资本市场流动性的超预期充裕导致了今年 2 月至 4 月中旬见的放量上涨行情。此后受

边际宽松的预期降低、中美贸易谈判不确定性陡升以及银行信用风险事件等因素的影响，A 股在 5、6 月份连续震荡。随着 G20 会议上中美两国元首达成初步成果和双方重启谈判，我们认为贸易战风险的阶段性缓和将有利于风险资产预期的再度稳定，但仍需对贸易谈判的进展进行紧密跟踪。

在 A 股内部的结构上，上半年表现领先的行业板块与过去多次上涨环境中的高弹性板块存在较大的差异：食品饮料、农林牧渔和以家电为代表的消费板块涨幅领先；传统的高贝塔品种中只有非银金融行业指数涨幅居居前，计算机、电子、军工和通信等科技行业的表现中等偏上。在风格特性上，各板块中的白马股继续领衔涨幅榜，延续了过去 3 年市场大小盘分化的格局，此外质量、动量、低波动等长期有效因子依旧体现出出色的风险收益特征。

报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于量化模型，构建对股票 Alpha 的测度，并通过行业、风格、风险等维度的控制，进行组合优化。同时，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，逐步优选具有未来发展潜力的高成长企业，以及当前财报持续稳健向好的确定性优质成长企业，我们将在量化投资的框架内对模型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。

#### 4.4.2 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 1.228 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.80%，业绩比较基准收益率为 23.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，我们认为 2019 年下半年的宏观环境和企业盈利将好于市场的悲观预期，但内外潜在的压力要素依然不可忽视，证券市场大概率维持宽幅震荡的状态之下，同时结构性的机会将进一步得到凸显。

宏观环境上，我们认为下半年有望延续上半年数据层面有好有坏，政策上相对克制的状态。国际形势的不确定性主导了过去近两年的宏观结构，但 G20 会议上中美两国元首达成初步成果和双方重启谈判，我们判断中美贸易摩擦对经济的负面影响在 2019 年下半年将不会成为影响资本市场的最主要因素。由于经济增速长期缓慢下滑的趋势，宏观政策上略偏宽松应是大概率的走向，稳健货币政策和积极财政政策的组合依旧是去杠杆转向稳杠杆转变过程中的较优选择，全社会信用利差将有所收窄。

微观层面，政策环境对民营企业边际上利好将较大程度地对冲 2000 亿出口征税的影响，最终使得企业盈利好于市场的悲观预期。资本市场上，由于 2019 年上半年经历了相对激烈的估值修



复的过程，之前过于悲观的情绪已经出现了较大程度的修复，我们认为下半年将很难出现如上半年一样的普遍性行情，大概率维持宽幅震荡的状态。在 A 股内部结构性的机会将进一步得到凸显，不同板块之间的相对收益将取决于这些板块上市公司的业绩。消费、保险等行业与大盘蓝筹风格由于其目前的业绩上行趋势尚在持续，短期内将继续保持可观的超额收益，但另一方面筹码的过度集中也加剧了投资这些板块的风险。

从量化因子的角度，我们预期在 2019 年下半年，市场会逐放缓聚焦消费、蓝筹等代表高质量风格的步伐，价值与成长等前期受到压制的风格将受益。本基金将继续遵循谨慎运作的原则，综合使用各类量化指标模型，综合估值水平和成长潜力，在关注企业的主营业务质量同时，精选具备长远投资空间且价格合理的优质个股，积极管理，有效控制回撤风险，追求资产的长期稳定增长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十五（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵

守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,394,571.07	5,040,505.58
结算备付金		775,436.27	734,546.06
存出保证金		38,212.66	67,023.66
交易性金融资产	6.4.7.2	206,372,224.82	170,371,138.90
其中：股票投资		196,166,104.82	159,307,493.20
基金投资		-	-
债券投资		10,206,120.00	11,063,645.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	40,256.94
应收利息	6.4.7.5	257,486.57	308,811.33
应收股利		-	-
应收申购款		25,856.69	37,874.51
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		210,863,788.08	176,600,156.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2019年6月30日</b>	<b>2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		89,566.92	288,788.20
应付管理人报酬		251,123.02	233,093.66
应付托管费		41,853.85	38,848.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	263,259.31	310,120.11
应交税费		-	0.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	92,077.98	220,026.95
负债合计		737,881.08	1,090,878.18
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	171,104,633.66	178,370,318.56
未分配利润	6.4.7.10	39,021,273.34	-2,861,039.76
所有者权益合计		210,125,907.00	175,509,278.80
负债和所有者权益总计		210,863,788.08	176,600,156.98

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.228 元，基金份额总额 171,104,633.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019年1月1日至 2019年6月30日	2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		46,908,266.81	-24,897,955.13
1. 利息收入		196,667.05	305,069.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,962.47	65,694.72
债券利息收入		172,704.58	223,372.27
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	16,002.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,874,310.51	-12,380,021.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,515,172.44	-13,569,292.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-41,686.64	53,777.10
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,400,824.71	1,135,493.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	22,825,481.60	-12,837,449.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,807.65	14,446.20
减：二、费用		2,921,543.94	3,278,155.63
1. 管理人报酬		1,532,020.77	1,833,199.80
2. 托管费		255,336.77	305,533.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,026,725.92	939,831.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.13	-
7. 其他费用	6.4.7.19	107,460.35	199,590.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,986,722.87	-28,176,110.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,986,722.87	-28,176,110.76

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实量化阿尔法混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	178,370,318.56	-2,861,039.76	175,509,278.80

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,986,722.87	43,986,722.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,265,684.90	-2,104,409.77	-9,370,094.67
其中：1. 基金申购款	12,195,848.64	2,628,219.66	14,824,068.30
2. 基金赎回款	-19,461,533.54	-4,732,629.43	-24,194,162.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	171,104,633.66	39,021,273.34	210,125,907.00
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	197,255,339.01	74,906,408.10	272,161,747.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,176,110.76	-28,176,110.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,903,990.53	-7,120,767.64	-25,024,758.17
其中：1. 基金申购款	6,656,782.52	2,220,405.23	8,877,187.75
2. 基金赎回款	-24,560,773.05	-9,341,172.87	-33,901,945.92
四、本期向基金	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	179,351,348.48	39,609,529.70	218,960,878.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>王红</u>	<u>张公允</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,532,020.77	1,833,199.80
其中：支付销售机构的客户维护费	289,060.16	348,414.45

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	255,336.77	305,533.33

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），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。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国工商银行股份有限公司_活期	3,394,571.07	17,431.83	19,290,389.84	59,850.36
-----------------	--------------	-----------	---------------	-----------

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按适用利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2019年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2019年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

###### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	196,166,104.82	93.03
	其中:股票	196,166,104.82	93.03
2	基金投资	-	-



3	固定收益投资	10,206,120.00	4.84
	其中：债券	10,206,120.00	4.84
	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	4,170,007.34	1.98
8	其他各项资产	321,555.92	0.15
9	合计	210,863,788.08	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,981,530.00	1.89
B	采矿业	3,682,196.00	1.75
C	制造业	83,452,782.46	39.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,805,149.00	3.24
E	建筑业	7,767,450.26	3.70
F	批发和零售业	5,698,280.68	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	5,763,135.00	2.74
H	住宿和餐饮业	445,284.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,742,470.76	2.26
J	金融业	49,101,329.70	23.37
K	房地产业	12,795,111.00	6.09
L	租赁和商务服务业	3,519,984.00	1.68
M	科学研究和技术服务业	2,000,648.00	0.95
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	8,510.36	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,327,218.60	0.63
S	综合	5,075,025.00	2.42
	合计	196,166,104.82	93.36

## 7.3 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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	111,300	9,862,293.00	4.69
2	000651	格力电器	114,800	6,314,000.00	3.00
3	600519	贵州茅台	6,400	6,297,600.00	3.00
4	601169	北京银行	1,026,400	6,066,024.00	2.89
5	600926	杭州银行	711,412	5,926,061.96	2.82
6	600606	绿地控股	857,500	5,856,725.00	2.79
7	600673	东阳光	646,500	5,075,025.00	2.42
8	600999	招商证券	282,000	4,819,380.00	2.29
9	002399	海普瑞	219,041	4,597,670.59	2.19
10	600170	上海建工	1,202,100	4,519,896.00	2.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.jsfund.cn>) 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	8,069,561.65	4.60
2	600519	贵州茅台	7,690,546.91	4.38
3	600926	杭州银行	7,140,429.67	4.07
4	600673	东阳光	6,994,038.92	3.98
5	601211	国泰君安	6,772,544.00	3.86
6	002478	常宝股份	6,757,462.33	3.85
7	002399	海普瑞	6,631,272.30	3.78
8	002048	宁波华翔	6,400,460.42	3.65
9	002304	洋河股份	6,268,481.95	3.57
10	600606	绿地控股	6,242,647.00	3.56
11	002010	传化智联	6,240,187.88	3.56
12	601229	上海银行	5,762,673.24	3.28
13	600027	华电国际	5,545,496.98	3.16
14	002415	海康威视	5,494,990.87	3.13
15	601928	凤凰传媒	5,337,226.49	3.04
16	000656	金科股份	5,326,816.00	3.04
17	600566	济川药业	5,216,140.00	2.97
18	600999	招商证券	4,928,014.00	2.81
19	600170	上海建工	4,553,451.44	2.59
20	601169	北京银行	4,502,297.74	2.57
21	600011	华能国际	4,335,058.00	2.47

22	002697	红旗连锁	4,323,150.36	2.46
23	300122	智飞生物	4,286,703.48	2.44
24	002696	百洋股份	4,274,941.66	2.44
25	601898	中煤能源	4,114,801.00	2.34
26	002038	双鹭药业	4,103,326.96	2.34
27	601872	招商轮船	4,017,011.10	2.29
28	000963	华东医药	3,910,690.92	2.23
29	002299	圣农发展	3,768,151.76	2.15

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002304	洋河股份	8,107,757.85	4.62
2	000651	格力电器	6,615,548.26	3.77
3	000661	长春高新	6,597,360.00	3.76
4	000656	金科股份	6,543,982.73	3.73
5	601198	东兴证券	5,873,717.20	3.35
6	600566	济川药业	5,808,776.75	3.31
7	600660	福耀玻璃	5,801,797.00	3.31
8	601211	国泰君安	5,728,336.84	3.26
9	002038	双鹭药业	5,577,861.00	3.18
10	601336	新华保险	5,564,566.00	3.17
11	300059	东方财富	5,485,382.00	3.13
12	000860	顺鑫农业	5,400,927.77	3.08
13	600426	华鲁恒升	5,241,045.28	2.99
14	600782	新钢股份	5,205,978.00	2.97
15	002048	宁波华翔	5,178,795.24	2.95
16	601186	中国铁建	5,166,417.00	2.94
17	002456	欧菲光	5,145,990.00	2.93
18	000620	新华联	5,134,071.70	2.93
19	002010	传化智联	4,765,745.00	2.72
20	601229	上海银行	4,759,228.41	2.71
21	601233	桐昆股份	4,663,052.13	2.66
22	002697	红旗连锁	4,519,649.60	2.58
23	601601	中国太保	4,236,059.00	2.41
24	002478	常宝股份	4,203,040.00	2.39
25	600050	中国联通	4,009,838.87	2.28
26	601898	中煤能源	3,983,170.40	2.27
27	600704	物产中大	3,966,967.80	2.26
28	600017	日照港	3,898,967.00	2.22
29	002353	杰瑞股份	3,853,106.95	2.20
30	000042	中洲控股	3,794,373.23	2.16

31	601009	南京银行	3,726,194.74	2.12
32	600585	海螺水泥	3,718,070.00	2.12
33	601928	凤凰传媒	3,619,754.00	2.06
34	603606	东方电缆	3,585,850.90	2.04

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	395,309,597.37
卖出股票收入（成交）总额	403,819,350.76

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,206,120.00	4.86
	其中：政策性金融债	10,206,120.00	4.86
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	10,206,120.00	4.86

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108603	国开 1804	102,000	10,206,120.00	4.86

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

#### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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。

#### 7.12.2

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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,212.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	257,486.57
5	应收申购款	25,856.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,555.92

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
9,453	18,100.56	251,555.90	0.15	170,853,077.76	99.85

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,754,656.49	1.03

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2009年3月20日） 基金份额总额	2,961,222,796.80
本报告期期初基金份额总额	178,370,318.56
本报告期基金总申购份额	12,195,848.64
减：本报告期基金总赎回份额	19,461,533.54
本报告期基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	171,104,633.66

注：报告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。

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****(1) 基金管理人的重大人事变动情况**

2019年2月2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》，自2019年2月2日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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经雷先生。

**(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况**

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	3	175,394,060.04	22.00%	122,778.75	22.25%	-
光大证券股份有限公司	1	163,887,784.60	20.56%	114,721.45	20.79%	-
东兴证券股份有限公司	1	110,984,946.08	13.92%	77,692.71	14.08%	-
西藏东方财富证券股份有限公司	2	74,830,399.75	9.39%	47,237.08	8.56%	-
中国国际金融股份有限公司	2	64,660,174.99	8.11%	45,262.11	8.20%	-

安信证券股 份有限公司	1	61,511,437.80	7.72%	43,089.05	7.81%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	58,333,404.14	7.32%	40,833.73	7.40%	-
招商证券股 份有限公司	2	50,872,285.11	6.38%	35,610.61	6.45%	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	21,651,768.93	2.72%	15,156.25	2.75%	-
国盛证券有 限责任公司	2	15,074,416.66	1.89%	9,517.38	1.72%	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-



国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	694,069.40	3.04%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	10,309,020.00	45.08%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	11,564,234.40	50.57%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	300,150.00	1.31%	-	-	-	-

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 08 月 29 日

