

嘉实全球互联网股票型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 日复核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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 嘉实全球互联网股票 |
| 基金主代码 | 000988 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 4 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 825,913,089.02 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资互联网行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资全球互联网相关行业股票。对于境内投资，本基金采用中观驱动，精选个股的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，充分考虑国内互联网企业处于成长初期，跨界和盈利模式创新丰富的特点，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司；对于境外投资，本基金采用中观驱动，合理对标的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，结合各国互联网企业的发展实际情况，充分利用市场的广度和深度，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司。 |
| 业绩比较基准 | 40%×道琼斯互联网指数+45%×中证海外中国互联网指数+15%×中证全指互联网软件与服务指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时，本基金为行业基金，在享受全球互联网行业收益的同时，也必须承担单一行 |

| | | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------------|
| | 业带来的风险。 | |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元 |
| 下属分级基金的交易代码 | 000988 | 000989/000990 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 758,768,956.10 份 | 67,144,132.92 份 |
| 境外资产托管人 | 英文名称: Brown Brothers Harriman & Co. | |
| | 中文名称: 布朗兄弟哈里曼银行 | |

注: 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元现汇基金代码为 000989, 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元现钞基金代码为 000990。如无特指, 美元现汇和美元现钞统称美元份额。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日) | 报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元 |
| 1. 本期已实现收益 | 54,663,349.92 | 28,333,785.53 |
| 2. 本期利润 | 770,135.67 | -1,059,643.09 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0009 | -0.0153 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,121,291,892.70 | 605,220,768.82 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.478 | 1.274 |

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) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额以人民币申购获得人民币计价的份额, 赎回获得人民币赎回款; 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额以美元申购获得美元计价的份额, 赎回获得美元赎回款; (4) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元的期末基金份额净

值单位为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.27% | 1.05% | -2.44% | 1.15% | 2.17% | -0.10% |

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -3.12% | 1.05% | -2.44% | 1.15% | -0.68% | -0.10% |

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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币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

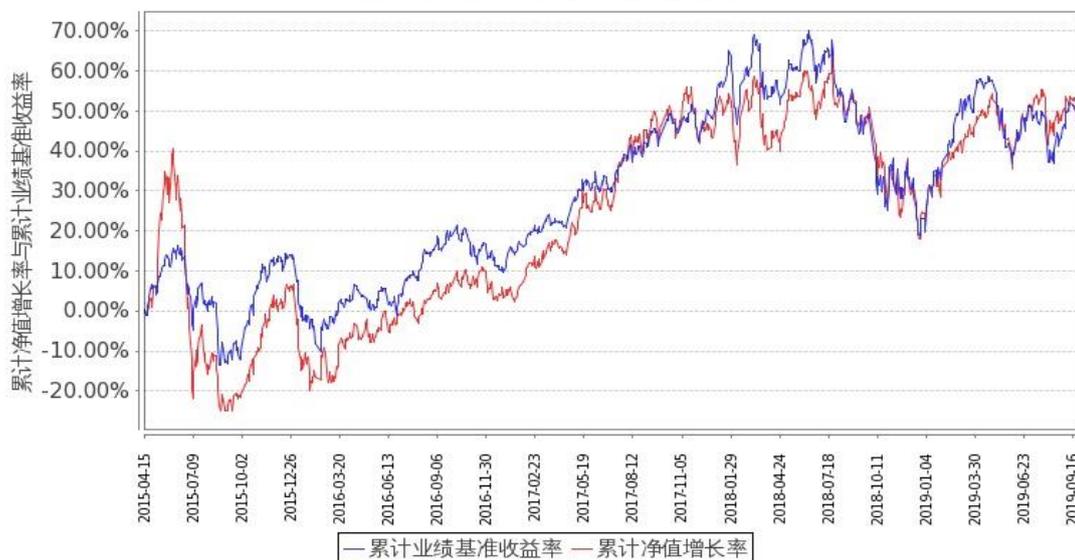


图 1: 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 4 月 15 日至 2019 年 9 月 30 日)

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元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

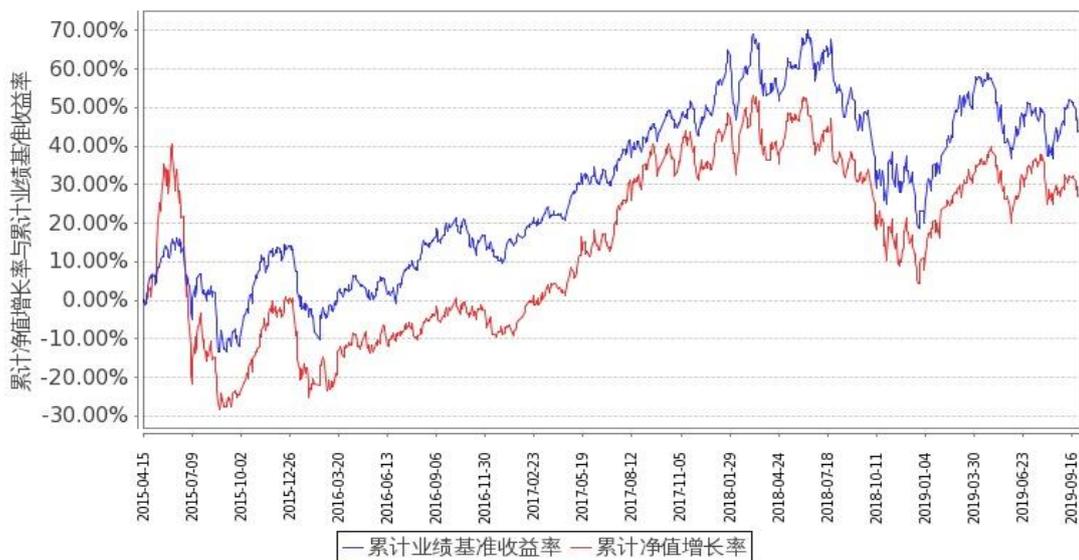


图 2：嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 4 月 15 日至 2019 年 9 月 30 日)

注：按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（十二（二）投资范围和（六）投资限制）的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张丹华 | 本基金、嘉实研究精选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实文体娱乐股票、嘉实研究增强混合、嘉实前沿科技沪港深股票基金经理 | 2015 年 5 月 15 日 | - | 8 年 | 2011 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员，现任研究部执行总监。博士，具有基金从业资格。 |

注：（1）基金经理的任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。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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、《嘉实全球互联网股票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 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，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，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

三季度国内市场区间震荡，贸易战依然有长期性，但同时国内在经济和流动性方面出台对冲政策，一定程度稳定了市场预期；结构上来说，外资的持续流入对于优质白马龙头公司形成支撑，部分板块的估值也回到历史低位；香港市场也有调整，主要受到美国市场和贸易战缓和等因素带动，同时南下资金流入提升市场估值中枢依然持续；

我们保持了相对稳定的仓位，结构上偏向代表长期方向和竞争优势突出，且估值合理的优质品种，前瞻性把握了人工智能、云计算、5G、半导体、创新药等中观机会；海外市场方面，比较好的把握了云计算、教育、电商等领域的机会，同时综合景气和估值，我们增加了移动互联网平台依然有变现潜力的公司配置，减少老平台硬件公司的配置，同时增加新硬件创新公司配置。

截至本报告期末嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 1.478 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.27%；截至本报告期末嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元基金份额净值为 1.274 美元，本报告期基金份额净值增长率为-3.12%；同期业绩比较基准收益率为-2.44%。

4.5 报告期内基金持有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（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,478,217,984.31 | 84.24 |
| | 其中：普通股 | 1,282,494,219.99 | 73.09 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | 195,723,764.32 | 11.15 |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 274,314,827.37 | 15.63 |
| 8 | 其他资产 | 2,203,416.94 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 1,754,736,228.62 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 美国 | 1,207,785,661.89 | 69.96 |
| 中国香港 | 199,488,531.60 | 11.55 |
| 中国 | 70,943,790.82 | 4.11 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------------|------------------|--------------|
| 存托凭证非必需消费品 | 195,723,764.32 | 11.34 |
| 股票通信服务 | 531,380,960.78 | 30.78 |
| 股票非必需消费品 | 171,890,849.75 | 9.96 |
| 股票医疗保健 | 34,409.18 | 0.00 |
| 股票工业 | 19,023.42 | 0.00 |
| 股票信息技术 | 579,168,976.86 | 33.55 |
| 合计 | 1,478,217,984.31 | 85.62 |

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类。

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股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代 码 | 所在证 券市 场 | 所属国 家 (地区) | 数量 (股) | 公允价值 (人民 币元) | 占基 金 资 产 净 值 比 例 (%) |
|----|-------------------------------------|----------------------------------|-------------|-------------------|------------------|-----------|-----------------|--|
| 1 | Alphabet Inc | Alphabet 公司 | GOOGL UW | 纳斯达克 证券交易 所 | 美国 | 21,000 | 181,377,023.23 | 10.51 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股 | 700 HK | 香港证券 交易所 | 中国香港 | 600,000 | 178,706,221.20 | 10.35 |
| 3 | Amazon.com Inc | 亚马逊公 司 | AMZN UW | 纳斯达克 证券交易 所 | 美国 | 14,000 | 171,890,849.75 | 9.96 |
| 4 | Alibaba Group Holdings Ltd | 阿里巴巴 集团控股 有限公司 | BABA UN | 纽约证券 交易所 | 美国 | 145,000 | 171,506,154.72 | 9.93 |
| 5 | Facebook Inc | Facebook 公司 | FB UW | 纳斯达克 证券交易 所 | 美国 | 136,000 | 171,297,716.35 | 9.92 |
| 6 | salesforce .com Inc | Salesfor ce.com 股份有 限公司 | CRM UN | 纽约证券 交易所 | 美国 | 162,000 | 170,084,006.71 | 9.85 |
| 7 | Adobe Inc | 奥多比 | ADBE UW | 纳斯达克 证券交易 所 | 美国 | 85,000 | 166,080,533.13 | 9.62 |
| 8 | ServiceNow Inc | ServiceN ow 公司 | NOW UN | 纽约证券 交易所 | 美国 | 50,000 | 89,772,783.25 | 5.20 |
| 9 | NVIDIA Corp | 英伟达 | NVDA UW | 纳斯达克 证券交易 所 | 美国 | 50,000 | 61,558,985.15 | 3.57 |
| 10 | Unilumin Group Co Ltd | 洲明科技 | 300232 | 深圳证券 交易所 | 中国 | 6,038,393 | 54,707,840.58 | 3.17 |

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码。

2. 报告期末本基金持有的“Alphabet Inc”、“Tencent Holdings Ltd”市值占净值比例被动超过10%，已于2019年10月15日调整至10%以下。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明 细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

报告期末，本基金未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 191.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | 111,207.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 37,698.29 |
| 5 | 应收申购款 | 2,054,319.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,203,416.94 |

5.10.4 报告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。

5.10.5 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，本基金前十名权益性投资中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 嘉实全球互联网股票型证券投资 基金-人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资 基金-美元 |
|-------------------------------|--------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 875,893,590.05 | 71,096,964.88 |
| 报告期期间基金总申购份 额 | 43,459,888.21 | 1,056,536.89 |
| 减：报告期期间基金总赎回 份额 | 160,584,522.16 | 5,009,368.85 |
| 报告期期间基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 758,768,956.10 | 67,144,132.92 |

§ 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。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实全球互联网股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实全球互联网股票型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

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

8.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(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 10 月 22 日