嘉实新兴市场债券型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31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
报告送出日期:2019年4月20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规定,于2019年4月17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。

嘉实新兴市场债券型证券投资基金是由嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金转型而成,根据《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金的两年运作期届满日为2015年11月26日,原嘉实新兴市场A、嘉实新兴市场B分级运作终止,嘉实新兴市场A转换为嘉实新兴市场C2,嘉实新兴市场B转换为嘉实新兴市场A1,并更名为"嘉实新兴市场债券型证券投资基金",本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后,基金合同、托管协议以及招募说明书等法律文件名称将一并变更,投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新兴市场债券
基金主代码	000342
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月26日
报告期末基金份额总额	144,948,159.00份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争总回报最大化,以谋求长期保值增。
投资策略	本基金通过研究全球新兴市场经济运行趋势,深入分析不同国家和地区财政及货币政策对经济运行的影响,结合对中长期利率走势、通货膨胀及各类债券的收益率、波动性的预期,自上而下地决定债券组合久期,对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。
业绩比较基准	同期人民币一年期定期存款利率+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,主要投资于新兴市场的各类债券,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	嘉实新兴市场A 嘉实新兴市场C2
下属分级基金的交易代码	000342 000341
报告期末下属分级基金的份额总额	119,999,583.67份 24,948,575.33份
境外资产托管人	英文名称:The HongkongandShanghai Banking Corporation Limited
	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司

§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1月1日－2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日－2019年3月31日)
	嘉实新兴市场A1	嘉实新兴市场C2
1.本期已实现收益	1,693,159.62	3,098,343.49
2.本期利润	3,747,810.59	7,933,247.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0527	0.3121
4.期末基金资产净值	150,311,191.07	196,151,024.58
5.期末基金份额净值	1.253	1.168

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)本基金已于2015年11月26日对原嘉实新兴市场A和嘉实新兴市场B份额实施了转换,嘉实新兴市场A转换为嘉实新兴市场C2;嘉实新兴市场B转换为嘉实新兴市场A1;(4)本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后,嘉实新兴市场A1份额以人民币计价并申购、收取申购、赎回费,嘉实新兴市场C2份额以美元计价并申购,计提销售服务费,不收取申购费;(5)嘉实新兴市场C2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

嘉实新兴市场A1						
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	4.33%	0.25%	0.62%	0.01%	3.71%	0.24%
嘉实新兴市场C2						
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	6.18%	0.13%	0.62%	0.01%	5.56%	0.12%

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

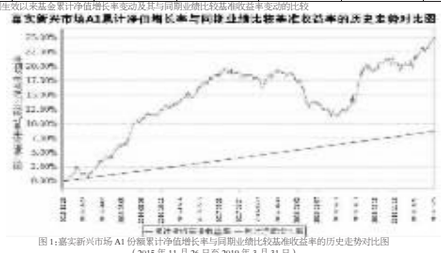


图1:嘉实新兴市场A1份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年11月26日至2019年3月31日)

图2:嘉实新兴市场C2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11月26日至2019年3月31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"第十五部分(二)投资范围和(四)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		
关子宏	本基金基金经理	2013年11月26日	-	18年	经济学硕士,特许金融分析师,在2012年1月加入嘉实基金管理有限公司,现就任于嘉实基金固定收益部并兼任嘉实国际固定收益投资总监。关先生在亚洲固定收益、美元信用债、全球债券组合和外汇投资方面具有超过12年的经验,曾就职于摩根资产管理(亚洲)有限公司担任亚洲债券投资总监,瑞士信贷资产管理有限公司(新加坡及北京)的亚洲固定收益及外汇部董事,保诚资产管理(新加坡)有限公司的亚洲固定收益投资董事和首城投资(香港)有限公司的基金经理等职务。

注:(1)任职日期和基金基金合同生效之日;(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遵规守信情况说明

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、《嘉实新兴市场债券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,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1次,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2019年一季度全球经济增速有所放缓,市场主要关注中美经贸磋商,华为向美国联邦法院提起诉讼、美国政府关门、美国总统特朗普与朝鲜最高领导人金正恩会谈、美国总统弹劾和美国议会三次否决首相梅的脱欧协议、西班牙政府预算法案被否决使得西班牙面临四年里的第三次大选、MSCI决定将A股大盘股纳入因子提高、六国区域贸易联盟、美俄欧盟革命战略出现倒挂等事件。

货币和财政政策方面,经济前景面临的不确定性增加,收紧信号下降,美联储2019年首个FOMC会议暂不加息,联邦基金利率目标区间为2.25%－2.5%不变,发出了暂停加息的最强信号,声明承诺对进一步加息有耐心,不排除重启QE,美联储预计今年内不加息,9月未停止缩表,多数联储官员的预期今年加息次数从两次降至零,令市场意外,联储再度下调今明两年GDP和通胀预期,拟今年5月起将美债密表规模减半,抑或尔称,美联储将保持耐心和观望状态,希望维护美国经济强劲增长的前景,目前就业市场强劲,通胀接近2%目标,预期2019年美国经济增速较佳,但小于2018年过于强劲的涨势,美国财政部表示,由于支出增加且收入几乎没有变化,美国政府2019财年一季度预算赤字扩大至3190亿美元,欧洲央行放鸽,宣布9月推出新的TLTRO预期年内无加息可能,下调了欧元区的经济增速预期和通胀预期,欧央行行长德拉吉称,短期前景较预期更差且偏向下行,受地缘政治、保护主义和新兴市场脆弱的不确定性打压,准备好在必要时行动,退欧日期再次定论之后,英国央行维持政策利率0.75%不变,与市场预期一致;并下调了2019年和2020年经济增长预期,2019年GDP增速预期削减幅度为0.2%至1.8%并未最大,表明2019年经济增速或将为2009年以来最低,但去年9月加息开启了货币政策紧缩以来,挪威央行一致同意加息25个基点,将基准利率提升至1%,行长Olsen认为,6月再加息一次的可能性高,不欲前可能再度加息,澳洲联储维持利率在1.5%,连续27个月不变,但称下行风险已经上升,新西兰预计将维持OCR在当前水平至2020年,但新西兰联储推迟加息预期,现预计将在2021年一季度加息,此前预期为2020年三季度,在新任行长的首个货币政策会议上,印度央行意外宣布降息,市场分析称通胀放缓让政策制定者有空间支持政府刺激经济增长,此前印度政府通过广义性预算,其中包括大选前130亿美元的消费者刺激计划,日本央行维持政策利率在－0.1%,符合预期,但将2019财年核心CPI预期从0.9%黑田东庆称,央行有多种更经济的选择,如降息,加快购买国债,如需要可能综合使用,中国政府工作报告:事实强表示,今年GDP增速预期目标为6%-6.5%;加大对中小银行定向降准力度,今年国有大型商业银行小微企业贷款要增长30%以上;深化增值税改革,将制造业等行业现行16%的税率降至13%;健全地方税体系,稳步推进房地产税立法;全年减轻企业税收和社保缴费负担近2万亿元。

发达经济体经济复苏势头放缓,下行压力日益凸显,OECD在最新公布的全球经济展望报告中称,2019年全球经济增速预测值下调至3.3%,较去年11月下调0.2个百分点,2020年调降下调0.1个百分点,美国四季度GDP增速下修至2.2%,略不及预期,就业年数据来看,美国2018年经济增速为2.9%,为2015年以来最高,但略低于特朗普政府设定的3%的年度目标,美国2月CPI环比增长0.2%,为四个月来首次上涨,美国2月PPI环比上涨0.1%,扭转了连续两月的下滑趋势,美2月非农大跌,新增就业仅2万,创17个月新低,时薪同比增速十年最高,欧元区2月制造业PMI初值跌破荣枯线,为2013年6月以来首次,制造业新订单降幅创近六年来最大,德国3月制造业PMI初值为44.7,创下79个月低点,中国2月官方制造业PMI环比下滑0.3个百分点至49.2,不及预期的49.4,连续第三个月位于枯荣线下方,中国2月财新服务业PMI录得51.1为2018年11月以来新低,且低于历史均值。

2019年一季度全球主要发达国家股市上涨,美国10年期国债收益率下降,一季度末收益率为2.406%,相比2019年年末下跌27.9个基点,人民币升值,在岸人民币兑美元6.7121,离岸人民币6.7232。

嘉实新添泽定期开放混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31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
报告送出日期:2019年4月20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规定,于2019年4月17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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新添泽定期混合
基金主代码	004775
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月14日
报告期末基金份额总额	135,512,203.16份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期内,本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,力便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将通过合理配置组合期限结构等方式,积极的范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中债综合财富指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。
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

§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1月1日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	1,150,097.13
2.本期利润	3,876,496.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0249
4.期末基金资产净值	164,940,407.54
5.期末基金份额净值	1.0606

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。

3.2 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

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	2.40%	0.12%	8.89%	0.46%	-6.49%	-0.34%

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:嘉实新添泽定期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

(2017年7月14日至2019年3月31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(四)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		
刘宁	本基金,嘉实增强信用定期债券,嘉实如意宝定期债券,嘉实丰益信用定期债券,嘉实新优选混合,嘉实新趋势混合,嘉实稳健债券,嘉实新添瑞混合,嘉实新添泽定期混合,嘉实合润双债纯债一年期定期债券,嘉实新添丰定期混合,嘉实润泽量化定期混合,嘉实新添荣定期混合,嘉实新添宏定期混合,嘉实新添康定期混合,嘉实策略配置混合,嘉实新添康定期混合,嘉实致盈债券基金经理	2017年3月17日	-	14年	经济学硕士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司,在公司多个业务部门工作,2008年开始从事投资相关工作,曾任债券专职投资经理、机构投资部投资经理。

注:(1)基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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 管理人对报告期内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、《嘉实新添华定期开放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 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,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1次,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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内国内外宏观经济平稳运行,流动性保持宽松,中美关系在一季度出现了阶段性缓和,市场对实体经济预期边际改善,资本市场风险偏好回升。

基本面角度,尽管经济生产端与需求端还未在数据上表现出明显触底现象,地产整体仍在下行,但政策逆周期调节更加具体,体现在一二线城市地产销量回升,活跃度明显改善,地产投资增速好于市场预期;消费虽仍在下滑,但减税降费可能使消费早于GDP见底;地方债提前发行,基建投资加码程度有所抬升。通胀方面,猪瘟疫情不断发酵,2月下旬开始生猪价格大幅反弹,春节提前使得工业品价格整体较去年水平抬升,国际油价有所反弹,通胀中枢较去年年末预期有所抬升。流动性方面,一季度实体经济和金融体系流动性都较为宽松,1月信贷社融大幅改善,尽管2-3月略有收缩,但总体带动融资水平边际企稳,M1、M2也都呈现阶段性稳定。1-2月外资大幅流入国内金融市场,银行间利率整体宽松,金融市场流动性改善。

债券市场在流动性宽松、实体融资环境改善的情况下,中短期品种收益率明显下行,1-3年利率债下行15-20bp,1-3年信用债下行20-40bp,特别是中短久期低等级品种。长端品种收益率在基本面预期改善的情况下小幅下行,利率曲线陡峭化。

权益市场一季度股票市场风险偏好出现显著回升,市场显著上涨,万得全A涨幅超过30%。A股各指数和版块呈现普涨态势。投资者对资产弹性的重视程度显著大于盈利和估值,使得科技主题和成长风格成为市场热点,成长风格大幅度跑赢了价值风格,中小板、创业板的涨幅显著高于大盘蓝筹板块。

报告期内本基金年度开放,正常运作期纯债部分主要通过存单和交易所信用债为主,加大对利率债交易机会的参与度,为应对开放赎回需求,季度末全面降低债券仓位,积极参与一级市场可转债申购。股票中等仓位,精选个股提升组合弹性,积极参与股票IPO。

4.5 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1.0606元;本报告期基金份额净值增长率为2.40%,业绩比较基准收益率为8.89%。

4.6 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(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	13,616,620.92	7.86
	其中:股票	13,616,620.92	7.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	163,449,094.80	82.22
	其中:债券	163,449,094.80	82.22
	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	4,788,856.87	2.41
8	其他资产	14,950,272.60	7.52
9	合计	198,804,845.19	100.00

5.2 报告期末按行业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	采矿业	-	-
C	制造业	9,902,965.20	6.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	567,796.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,767,733.00	1.07
J	金融业	3,378,126.72	2.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,616,620.92	9.47

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	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	600535	天士力	173,180	3,900,013.60	2.36
2	600036	招商银行	99,591	3,378,126.72	2.05
3	600276	恒瑞医药	35,880	2,347,269.60	1.42
4	002025	航天电器	67,000	1,858,580.00	1.13
5	002410	广联达	59,300	1,767,733.00	1.07
6	000895	双汇发展	63,700	1,646,645.00	1.00
7	600483	福能股份	58,900	567,796.00	0.34
8	000513	丽珠集团	4,300	150,457.00	0.09

注:报告期末,本基金仅持有上述8只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,806,000.00	36.87
	其中:政策性金融债	30,642,000.00	18.58
4	企业债券	20,030,000.00	12.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	82,077,000.00	49.76
7	可转债(可交换债)	536,094.80	0.33
8	回业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	163,449,094.80	99.10

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五名债券投资明细

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	180208	18国开08	300,000	30,642,000.00	18.58
2	101800662	18京能源MTN001	100,000	10,422,000.00	6.32
3	101800370	18河钢集MTN003	100,000	10,383,000.00	6.30
4	101800563	18豫高管MTN003	100,000	10,336,000.00	6.27
5	101800163	18恒基MTN001	100,000	10,330,000.00	6.26

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。

5.7 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贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1)2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金投资于"招商银行(600036)"的决策程序说明:基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"招商银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,222.29
2	应收证券清算款	10,593,704.70
3	应收股利	-
4	应收利息	4,348,345.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,950,272.60

5.11.4 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。

5.11.5 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,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	155,512,203.16
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	155,512,203.16

§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新添泽定期开放混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实新添泽定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实新添泽定期开放混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实新添泽定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实新添泽定期开放混合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4月20日

嘉实新添华定期开放混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31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
报告送出日期:2019年4月20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规定,于2019年4月17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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新添华定期混合
基金主代码	004353
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月17日
报告期末基金份额总额	152,180,730.71份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期内,本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,力便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将通过合理配置组合期限结构等方式,积极的范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中债综合财富指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§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1月1日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	11,892,852.21
2.本期利润	11,647,334.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0258
4.期末基金资产净值	173,229,209.30
5.期末基金份额净值	1.1383

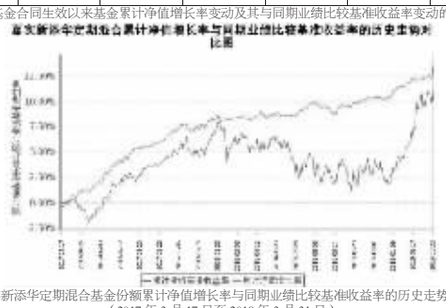
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

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	3.13%	0.18%	8.89%	0.46%	-5.76%	-0.31%

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


嘉实新添华定期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
11.00%
10.00%
9.00%
8.00%
7.00%
6.00%
5.00%
4.00%
3.00%
2.00%
1.00%
0.00%