（上接B81版）

135、东海期货有限责任公司
办公地址：江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号、上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
法定代表人：陈太康
联系人：李天雨
电话：021-68757102
传真：021-68757102
客服电话：95531/4008888588
网址：http://www.qh168.com.cn/
136、长江证券股份有限公司
办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人：李新华
联系人：李良
电话：（027）65799999
传真：（027）85481900
客服电话：95579或4008-888-999
网址：http://www.cjsc.com
137、西南证券股份有限公司
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：廖庆轩
联系人：张煜
电话：(023)63786141
传真：(023)6378212
客服电话：4008096096
网址：http://www.swsc.com.cn
138、湘财证券股份有限公司
办公地址：湖南省长沙湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
联系人：李欣
电话：(021)38784580
传真：(021)68865680
客服电话：95351
网址：http://www.xcsc.com
139、万联证券股份有限公司
办公地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层
法定代表人：罗钦城
联系人：甘蕾
电话：020-38286026
客服电话：95322
网址：http://www.wlzq.com.cn
140、民生证券股份有限公司
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层-18层
法定代表人：冯鹤年
联系人：程博怡
电话：(010)59355807
传真：(010)56437013
客服电话：400-619-8888
网址：http://www.mszq.com/
141、国元证券股份有限公司
办公地址：安徽省合肥市梅山路18号
法定代表人：蔡咏
联系人：陈玲玲
电话：（0551）2246273
传真：（0551）2272100
客服电话：95578
网址：http://www.gyzq.com.cn
142、渤海证券股份有限公司
办公地址：天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座
法定代表人：王春峰
联系人：蔡霆
电话：(022)28451991
传真：(022)28451892
客服电话：4006515988
网址：http://www.bhzq.com
143、山西证券股份有限公司
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：（0351）8686659
传真：（0351）8686619
客服电话：400-666-1618
网址：http://www.sxzq.com
144、东兴证券股份有限公司
办公地址：北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
电话：（010）66555316
传真：（010）66555246
客服电话：400-8888-993
网址：http://www.dxzq.net
145、东吴证券股份有限公司
办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：(0512)65581136
传真：(0512)65588021
客服电话：95330
网址：http://www.dwzq.com.cn
146、信达证券股份有限公司
办公地址：北京市西城区闹市口大街9院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：尹旭航
电话：(010)63081493
传真：(010)63081344
客服电话：95321
网址：http://www.cindasc.com
147、南京证券股份有限公司
办公地址：江苏省南京市江东中路389号
法定代表人：沙国甫
联系人：王万君
电话：(025)58519523
传真：(025)83369725
客服电话：95386
网址：http://www.njzq.com.cn
148、上海证券有限责任公司
办公地址：上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼
法定代表人：李俊杰
联系人：邵珍珍
电话：(021)53686888
传真：(021)53686100-7008
客服电话：(021)962518，4008918918
网址：http://www.shzq.com
149、新时代证券股份有限公司
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：叶顺德
联系人：田芳芳
电话：(010)83561146
客服电话：95399
网址：http://www.xsdzq.cn
150、大同证券有限责任公司
办公地址：山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛律
电话：（0351）4130322
传真：（0351）4130322
客服电话：4007121212
网址：http://dsbc.com.cn/
151、国联证券股份有限公司
办公地址：无锡市金融一街8号
法定代表人：姚志勇
联系人：祁昊
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
客服电话：95570
网址：http://www.gjsc.com.cn
152、浙商证券股份有限公司
办公地址：浙江省杭州市五星路201号
法定代表人：吴承根
联系人：许嘉行
电话：（0571）87901912
传真：（0571）87901913
客服电话：（0571）967777
网址：http://www.stocke.com.cn
153、平安证券股份有限公司
办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
法定代表人：何之江
联系人：周一涵
电话：021-38637436
传真：021-58991896
客服电话：95511-8
网址：stock.pingan.com
154、国海证券股份有限公司
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦
法定代表人：何春梅
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
传真：0771-5530903
客服电话：95563（全国）
网址：http://www.ghzq.com.cn
155、东莞证券股份有限公司
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：陈照星
联系人：李荣
电话：(0769)22115712
传真：(0769)22115712
客服电话：95328
网址：http://www.dgzq.com.cn
156、中原证券股份有限公司
办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：晋明军
联系人：程月艳、李昭昭
电话：0371-69099882
传真：0371--65585899
客服电话：95377
网址：http://www.ccnew.com
157、国都证券股份有限公司
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：翁振杰(代)
联系人：黄静
电话：(010)84183389
传真：(010)84183311
客服电话：400-818-8118
网址：http://www.guodu.com
158、东海证券股份有限公司
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
法定代表人：陈耀庭(代)
联系人：汪一彦
电话：(021)20333333
传真：(021)50498825
客服电话：95531;400-888-8588
网址：http://www.longone.com.cn
159、中银国际证券股份有限公司
办公地址：中国上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：宁敏
联系人：汪炜君
传真：(021)50372474
客服电话：4006208888
网址：http://www.bocifunds.com
160、恒泰证券股份有限公司
办公地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼
法定代表人：庞介民
联系人：熊丽
电话：（0471）4972675
客服电话：4001966188
网址：http://www.cnht.com.cn
161、国盛证券有限责任公司
办公地址：江西省南昌市北京西路88号
法定代表人：徐丽峰
联系人：古文雄
电话：(0791)86283372
传真：(0791)86281305
客服电话：4008222111
网址：http://www.gsstock.com
162、金元证券股份有限公司
办公地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
法定代表人：王作义
联系人：马贤清
电话：(0755)83025022
传真：(0755)83025625
客服电话：400-8888-228
网址：http://www.jyzq.cn
163、德邦证券股份有限公司
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心29楼
法定代表人：武晓春
联系人：刘熠
电话：（021）68761616
传真：（021）68767981
客服电话：4008888128
网址：http://www.tebon.com.cn
164、西部证券股份有限公司
办公地址：陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室
法定代表人：徐朝晖
联系人：梁承华
电话：(029)87416168
传真：(029)87406710
客服电话：95582
网址：http://www.westsecu.com
165、华龙证券股份有限公司
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人：李晓安
联系人：范坤
电话：（0931）4890208
传真：（0931）4890628
客服电话：95368
网址：http://www.hlzq.com
166、财通证券股份有限公司
办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716室
法定代表人：陆建强
联系人：陶志华
电话：0571 - 87789160
传真：0571-87818329
客服电话：(0571)96336、962336(上海地区)
网址：http://www.ctsec.com
167、上海华信证券有限责任公司
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人：陈灿辉
联系人：倪丹
电话：021-38784818?
传真：021-68775878
客服电话：68777877
网址：http://www.shhxzq.com/
168、华鑫证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房。
法定代表人：俞洋
联系人：杨莉娟
电话：021-54967552
传真：021-54967032
客服电话：021-32109999;029-68918888;4001099918
网址：http://www.cfsc.com.cn
169、瑞银证券有限责任公司
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层
法定代表人：钱于军
联系人：牟冲
电话：(010）58328112
传真：(010)58328748
客服电话：400-887-8827
网址：http://www.ubsecurities.com
170、中山证券有限责任公司
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层
法定代表人：林炳城
联系人：罗艺琳
电话：0755-82943755
传真：0755-82960582
客服电话：95329
网址：http://www.zszq.com.cn
171、国融证券股份有限公司
办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18路
法定代表人：张智河
联系人：董晶姗
电话：(010)83991737
传真：(010)66412537
客服电话：4006609839
网址：http://www.grzq.com
172、江海证券有限公司
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人：赵洪波
联系人：周俊
电话：0451-85863726
传真：0451-82337279
客服电话：400-666-2288
网址：http://www.jhzq.com.cn/
173、国金证券股份有限公司
办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057，028-86690058
传真：028-86690126
客服电话：95310
网址：http://www.gjzq.com.cn
174、华宝证券有限责任公司
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层
法定代表人：陈林
联系人：夏元
电话：（021）68777222
传真：（021）68777822
客服电话：4008209898
网址：http://www.cnhbstock.com
175、长城国瑞证券有限公司
办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼
法定代表人：王勇
联系人：林丹
电话：(0592)2079259
传真：(0592)2079602
客服电话：400-0099-886
网址：https://www.gwgsc.com/
176、爱建证券有限责任公司
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼（陆家嘴商务广场）
法定代表人：祝健
联系人：姚盛盛
电话：（021）32229888
传真：021-68728703
客服电话：4001962502
网址：http://www.ajzq.com
177、华融证券股份有限公司
办公地址：北京朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦18层
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：010-85556100
传真：010-85556088
客服电话：400-898-4999
网址：http://www.hrsec.com.cn
178、天风证券股份有限公司
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：冷妹妹
电话：027-87617017
传真：027-87618863
客服电话：4008005000
网址：http://www.tfzq.com
179、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006
法定代表人：马勇
联系人：文雯
电话：010-83363101
传真：010-83363072
客服电话：400-118-1166
网址：http://www.xinlande.com.cn
180、腾安基金销售(深圳)有限公司
办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼
法定代表人：刘明军
联系人：谭广锋
电话：0755-86013388-80618
传真：--
客服电话：95017
网址：http://www.tenganxinxi.com或http://www.txfund.com
181、北京百度百盈基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
法定代表人：张旭阳
联系人：杨琳
电话：010-61952702
传真：010-61951007
客服电话：95055
182、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座12楼
法定代表人：祖国明
联系人：韩爱彬
电话：021-60897840
传真：0571-26697013
客服电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn
183、北京汇成基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客服电话：400-619-9059
网址：http://www.hcjijin.com/
184、北京新浪仓石基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
联系人：付文红
电话：010-62676405
传真：010-62676582
客服电话：010-62675369
网址：http://www.xincai.com
185、上海万得基金销售有限公司
办公地址：中国（上海）浦东新区福山路33号9楼
法定代表人：王廷富
联系人：姜吉灵
电话：021-68882280
传真：021-68882281
客服电话：400-821-0203
网址：https://www.520fund.com.cn/
186、凤凰金信(银川)基金销售有限公司
办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路142号14层办公房
法定代表人：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
传真：010-58160173
客服电话：400-810-55919
网址：http://www.fengfd.com/
187、和耕传承基金销售有限公司
办公地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北6号楼6楼602、603房间
法定代表人：李淑慧
联系人：裴小龙
电话：0371-85518395 4000-555-671
传真：0371-85518397
网址：HGCCPB.COM
188、北京肯特瑞基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
联系人：江卉
电话：4000988511
传真：010-89188000
客服电话：010-89188462
网址：http://fund.jd.com
189、北京蛋卷基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：侯芳芳
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客服电话：400-159-9288
网址：http://www.ncfjj.com
190、深圳前海微众银行股份有限公司
办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人：顾敏
联系人：苏豪
电话：13469952231
传真：0755-86700688
客服电话：400-999-8877
网址：http://www.webank.com/

（二）注册登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	经雷
联系人	彭鑫
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678

（三）律师事务所和经办律师

名称	国浩律师（北京）事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	（010）65171188	传真	（010）65176801
经办律师	黄伟民		

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	周祎
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

四、基金名称

本基金名称：嘉实主题精选混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

充分把握中国崛起过程中的投资机会，谋求基金资产长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产30%～95%，债券0～70%，权证0～3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用“主题投资策略”（Thematic Investment Approach），依托基金管理人的投研团队，借鉴外部合作方的研究成果，构建投资组合，动态把握市场投资机会。

1、资产配置

本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金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，减小基金的系统性风险。在资产配置上，将优先考虑股票类资产的配置，在确定证券市场主题之后构造股票组合，剩余资产将配置于固定收益类和现金类等大类资产上。

2、股票投资策略

股票投资部分，将从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合。

（1）主题发掘

投资主题是影响经济发展和企业盈利的关键性和趋势性因素，它具有以下特点：

- 前瞻性；
- 动态变化；
- 主题所涉及的企业不局限于某一具体的行业或地域；
- 主题之间相对独立；

中国的发展具有多层次、多样化、动态变化的特点，不同主题下的企业两极分化的特点更加明显；中国的崛起也是一个多层次、长周期的历史性进程，不同特点的企业发展顺序有先有后，发展速度和获益程度各不相同，新旧投资主题将出现更替。投资主题所影响的企业不仅仅局限于行业、地域这一传统的划分范围之内，具有跨行业、跨地域特点的投资主题将为市场带来新的投资机会。各主题之间具有相对独立的特点，证券市场存在“多主题联动”的投资机会。

基金管理人将依托基金管理人的投研团队，立足于“嘉实TOP-DOWN研究模型”，根据嘉实宏观经济、政策制度和其他领域的相关研究报告以及外部合作方的研究成果，采用定性和定量模型分析相结合的方法，从宏观经济、政策制度、技术进步和社会文化等多个角度出发，动态分析影响经济发展和企业盈利的关键性、趋势性因素，前瞻性发掘在中国崛起过程中所不断涌现出来的投资主题。

（2）主题配置

在主题发掘基础上，基金管理人将根据嘉实“企业投资价值评估体系”，对不同主题进行分析和评估，根据主题与企业的关联度，确定明确受惠于相关主题的企业，形成“主题企业群”，根据不同主题因素对企业EPS和企业价值的影响幅度，确定主题企业群的受益程度；根据企业群所涵盖的企业数目、市值等指标，确定主题企业群的市场容量；根据证券市场的情绪、主题企业群在证券市场近一个月的表现，确定主题企业群的市场反应速度。根据上述三个关键变量，确定“主题企业群”的配置权重。对于受益程度高、市场容量大、反应时间快的主题企业群，基金将加大配置力度。

（3）个股选择

本基金在个股选择层面，采用“研究驱动”的模式，基于基金管理人研究团队的独立研究，精选受益于相关主题的个股，并在此基础上构建股票投资组合。

个股选择的标准为：

- 属于主题企业群，并且根据嘉实“企业投资价值评估体系”，从EPS增长、企业经济价值等指标评估看，受惠程度居“主题企业群”中前1/2；
- 考虑到企业未来的成长性，未来一至三年企业的EPS、EVA等财务指标预计有较大幅度增长，从PEG、PCF等指标比较，目前的估值水平明显低估或者相对合理；
- 根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的上市公司；
- 兼具有中长期成长性及中短期市场表现的催化剂。

3、债券投资组合构建

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

（1）久期策略

在分析宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率）和财政货币政策等的基础上，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析，预测收益率曲线的变化趋势，并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容，一是收益率曲线本身的变化，根据收益率曲线可能向上移动或向下移动，降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于最有投资价值的债券。

4、权证投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

九、基金业绩比较基准

沪深300指数增长率×95%＋同业存款收益率×5%

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，或更科学的复合指数权重比例，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可调整或变更业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

较高风险，较高收益。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,129,427,565.02	74.19
	其中：股票	2,129,427,565.02	74.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	221,106,901.80	7.70
	其中：债券	221,106,901.80	7.70
	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	473,748,310.61	16.50
8	其他资产	46,119,723.59	1.61
9	合计	2,870,402,501.02	100.00

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	294,595.60	0.01
B	采矿业	363,431.25	0.01
C	制造业	1,364,161,886.88	47.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,276,105.00	2.11
F	批发和零售业	59,115,369.07	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	45,155,294.82	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	304,185,333.52	10.63
J	金融业	230,674,205.70	8.06
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	65,177,829.60	2.28
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	23,513.58	0.00
S	综合	-	-
合计		2,129,427,565.02	74.42

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	601799	星宇股份	2,692,825	212,625,462.00	7.43
2	600438	通威股份	6,690,084	94,062,581.04	3.29
3	300567	精测电子	1,704,984	89,545,759.68	3.13
4	002371	北方华创	1,280,153	88,650,595.25	3.10
5	300450	先导智能	2,539,253	85,318,900.80	2.98
6	300601	康泰生物	1,623,246	85,220,415.00	2.98
7	601766	中国中车	10,430,195	84,380,277.55	2.95
8	000550	江铃汽车	4,314,977	83,667,404.03	2.92
9	601012	隆基股份	3,177,121	73,423,266.31	2.57
10	300383	光环新网	4,271,339	71,630,355.03	2.50

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	220,587,000.00	7.71
	其中：政策性金融债	220,587,000.00	7.71
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）	519,901.80	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	221,106,901.80	7.73

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	190302	19进出02	900,000	89,919,000.00	3.14
2	190201	19国开01	800,000	79,968,000.00	2.79
3	170307	17进出07	500,000	50,700,000.00	1.77
4	113015	隆基转债	4,070	519,901.80	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述4支债券。

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。

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。

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。

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。

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。

11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,243,682.84
2	应收证券清算款	42,697,969.20
3	应收股利	-
4	应收利息	2,003,902.90
5	应收申购款	174,168.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,119,723.59

(4) 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	113015	隆基转债	519,901.80	0.02

(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。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）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
2006.7.21-2006.12.31	57.62%	1.22%	48.71%	1.28%	8.91%	-0.06%
2007年	120.07%	2.10%	150.20%	2.18%	-30.13%	-0.08%
2008年	-52.49%	2.61%	-63.85%	2.89%	11.36%	-0.28%
2009年	82.49%	1.75%	90.72%	1.95%	-8.23%	-0.20%
2010年	19.11%	0.96%	-11.77%	1.50%	30.88%	-0.54%
2011年	-20.24%	0.92%	-23.82%	1.23%	3.58%	-0.31%
2012年	2.32%	0.86%	7.30%	1.22%	-4.98%	-0.36%
2013年	-5.37%	1.09%	-7.14%	1.32%	1.77%	-0.23%
2014年	11.98%	1.26%	48.72%	1.15%	-36.74%	0.11%
2015年	56.15%	3.12%	5.72%	2.36%	50.43%	0.76%
2016年	-16.68%	1.99%	-10.61%	1.33%	-6.07%	0.66%
2017年	0.00%	0.65%	20.65%	0.60%	-20.65%	0.05%
2018年	-27.23%	1.34%	-24.10%	1.27%	-3.13%	0.07%
2019年1月1日至6月30日	13.43%	1.07%	25.66%	1.47%	-12.23%	-0.40%

（二）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：嘉实主题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

（2006年7月21日至2019年6月30日）

注：按基金合同约定，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十四条（二）投资范围、（八）2投资组合比例限制）约定：（1）资产配置范围为：股票资产30%～95%，债券0～70%，权证0～3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；（2）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；（3）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；（4）在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五；（5）持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的3%；（6）法律法规和基金合同规定的其他限制。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的会计师费和律师费等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M<50万元	1.5%
50万元≤M<200万元	1.2%
200万元≤M<500万元	0.8%
M≥500万元	单笔1000元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

注：2013年4月9日，本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自2013年4月12日起，在本公司基金网上直销系统开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务），并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T）	基金网上直销后端申购优惠费率
0〈T〈1年	0.20%
1年≤T〈3年	0.10%
T≥3年	0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

（2）赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，具体如下：

持有期限	赎回费率
<7天	1.50%
7天≤M<365天	0.50%
365天≤M<730天	0.25%
≥730天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，除此之外的赎回费中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施三个工作日前中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（3）转换费

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

（1）通过代销机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

（2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

（3）通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

① 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

② 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。