嘉实优质企业混合型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实优质企业混合
基金主代码	070099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 12 月 8 日
报告期末基金份额总额	617,391,425.72 份
投资目标	力争为基金份额持有人创造长期超额收益。
投资策略	本基金在大类资产配置上，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。 除主要的股票投资策略外，本基金还可通过新股申购策略、债券投资策略、及衍生工具投资策略，如：可转债投资策略、权证及其他金融工具投资策略等辅助投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。 具体包括：股票投资策略（个股选择、行业配置）、权证及其他金融工具投资策略、可转债投资策略、债券投资策略、新股申购策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数×95% + 上证国债指数×5%
风险收益特征	较高风险，较高收益。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	73,383,882.28
2.本期利润	-13,485,824.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0216
4.期末基金资产净值	908,794,983.73
5.期末基金份额净值	1.472

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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	-1.47%	1.44%	-11.83%	1.22%	10.36%	0.22%
过去六个月	1.17%	1.45%	-1.82%	1.22%	2.99%	0.23%
过去一年	0.89%	1.33%	-5.60%	1.08%	6.49%	0.25%
过去三年	13.14%	1.26%	18.12%	1.09%	-4.98%	0.17%
过去五年	-40.74%	1.29%	-8.73%	1.07%	-32.01%	0.22%
过去七年	4.29%	1.44%	15.71%	1.12%	-11.42%	0.32%
过去十年	25.35%	1.41%	35.53%	1.10%	-10.18%	0.31%
自基金合同生效起至今	116.36%	1.58%	-7.24%	1.46%	123.60%	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



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 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§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		
刘晗竹	本基金、嘉实均衡配置混合基金经理	2023 年 9 月 19 日	-	15 年	2011 年加入银华基金管理有限公司，历任研究部研究员、组长。2014 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理助理、年金投资部投资经理。北京大学光华管理学院金融学硕士，具有基金从业资格。中国国籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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、《嘉实优质企业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 2 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度 A 股整体震荡下行，并伴随结构剧烈切换，市场围绕海外流动性变化与科技产业景气展开交易，但核心驱动因素仍是本基金半年报中重点提及的交易极致拥挤。七月市场先震荡后急跌，伴随中东冲突升级、美联储加息预期升温，海外科技资产去杠杆压力向 A 股传导，科技成长板块集中调整，价值与消费逆势走强。虽然八月市场迎来超跌反弹，科技与资源品再度成为主要交易方向，但随着九月美联储加息落地、美债收益率持续上行，叠加科技板块缺乏技术快速迭代和商业化提速的增量逻辑支撑，市场对海外货币政策收紧的担忧进一步强化，科技成长再次领跌，市场整体震荡下行。

本基金三季度表现有所回暖，一方面得益于通过配置贵金属等资源品和银行等价值红利板块，获得了一定绝对回报；另一方面，组合通过在科技板块中的结构调整和个股发掘，及时兑现了部分绝对收益，同时持仓标的也在成长板块整体回撤中获取了一定相对回报。

回顾三季度组合投资，基金经理在坚持自身方法论的基础上，继续依据市场风格变化优化投资策略。诚如本基金半年报中所言，二季度末面对可能是 A 股历史上结构最为极致分化的单季度行情，基金经理虽然“努力做到不被上涨的股价带来的逼空情绪和市场配置压力裹挟进而选择简单从众”，但出于产品负债端压力的考虑，并未在三季度做出非常极致的结构切换，事后看依旧给组合造成了一定的回撤压力，这也是后续投资管理过程中亟需继续优化和提升之处。展望四季度，人工智能为代表的科技大潮依旧浩浩荡荡，但资本市场经历连续两个季度冰火两重天的大幅

波动后，更需要从长期视角审视产业发展趋势和上市公司真实价值。基金经理也将继续同所有坚守的投资人一起，以更加积极的心态，努力挖掘业绩增长驱动的优质投资机会。

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 1.472 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.47%，业绩比较基准收益率为-11.83%。

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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	810,548,425.15	88.72
	其中：股票	810,548,425.15	88.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,979,085.29	3.39
	其中：债券	30,979,085.29	3.39
	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	40,896,915.17	4.48
	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	30,919,959.94	3.38
8	其他资产	280,816.13	0.03
9	合计	913,625,201.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	151,906,034.80	16.72
C	制造业	544,959,719.09	59.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,026,089.60	2.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	8,066,210.00	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,889,655.66	1.09
J	金融业	45,191,138.00	4.97
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	28,509,578.00	3.14
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	810,548,425.15	89.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	002475	立讯精密	1,451,967	71,770,728.81	7.90
2	601899	紫金矿业	1,996,490	59,475,437.10	6.54
3	688785	恒运昌	125,139	43,358,160.72	4.77
4	600489	中金黄金	1,960,000	42,924,000.00	4.72
5	688084	晶品特装	857,204	35,188,224.20	3.87
6	000975	山金国际	1,420,140	32,322,386.40	3.56
7	601100	恒立液压	305,700	27,607,767.00	3.04
8	002938	鹏鼎控股	325,300	25,877,615.00	2.85
9	300274	阳光电源	313,700	25,877,113.00	2.85
10	000338	潍柴动力	922,700	23,159,770.00	2.55

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	30,979,085.29	3.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	30,979,085.29	3.41

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	019792	25 国债 19	165,000	16,720,616.30	1.84
2	019835	26 国债 09	142,000	14,258,468.99	1.57

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

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十名资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	255,788.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,027.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	280,816.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	632,537,615.70
报告期期间基金总申购份额	7,370,169.44
减：报告期期间基金总赎回份额	22,516,359.42
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	617,391,425.72

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会《关于核准嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]320 号)；

(2)《嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实优质企业混合型证券投资基金托管协议》；

(4)《嘉实优质企业混合型证券投资基金招募说明书》；

(5)《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；

(6)基金管理人业务资格批件、营业执照；

(7)报告期内嘉实优质企业混合型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

9.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日