嘉实主题精选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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	863,548,084.19 份
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。
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。 具体包括：资产配置策略、股票投资策略（主题发掘、主题配置、个股选择）、债券投资组合构建（久期策略、收益率曲线策略）、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*85%+中债-总全价（总值）指数收益率*15%
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	中国银行股份有限公司

注：自 2026 年 7 月 27 日起,本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数增长率×95%＋同业存款收益率×5%”调整为“沪深 300 指数收益率*85%＋中债-总全价（总值）指数收益率*15%”。

§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	6,266,372.79
2.本期利润	4,558,032.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0052
4.期末基金资产净值	1,600,910,299.50
5.期末基金份额净值	1.854

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。

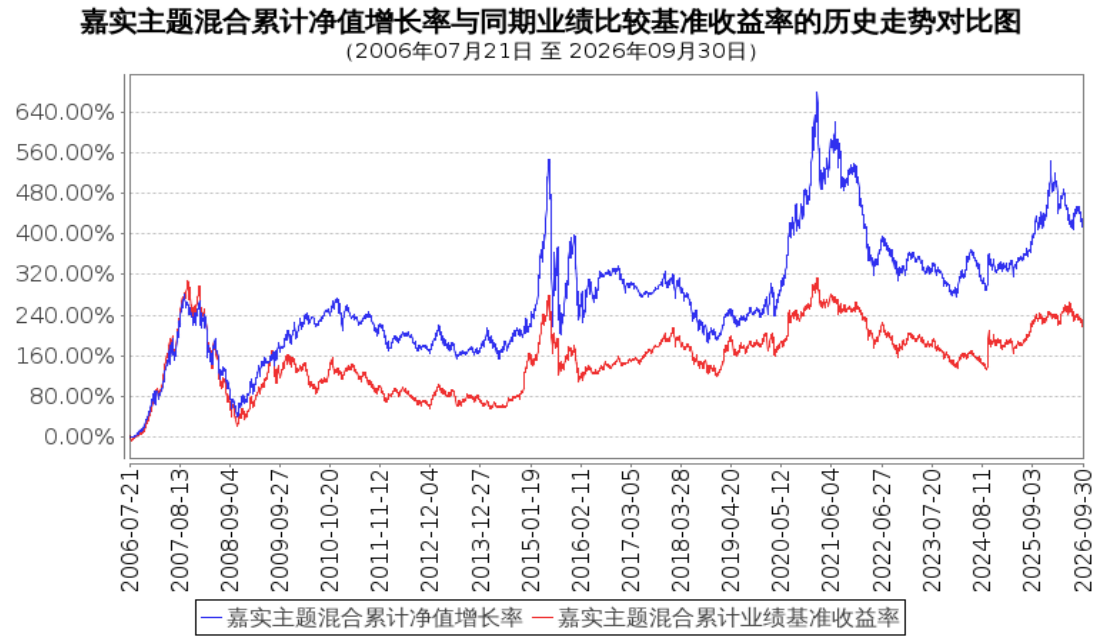
3.2 基金净值表现

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	0.27%	0.93%	-11.24%	1.17%	11.51%	-0.24%
过去六个月	-5.46%	0.96%	-1.22%	1.19%	-4.24%	-0.23%
过去一年	-0.43%	1.24%	-5.04%	1.06%	4.61%	0.18%
过去三年	23.04%	1.05%	18.30%	1.08%	4.74%	-0.03%
过去五年	-14.40%	1.04%	-8.90%	1.06%	-5.50%	-0.02%
过去七年	52.89%	1.24%	15.09%	1.12%	37.80%	0.12%
过去十年	23.93%	1.18%	34.31%	1.10%	-10.38%	0.08%
自基金合同生效起至今	422.07%	1.54%	218.95%	1.51%	203.12%	0.03%

注：根据基金管理人发布的公告，自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数增长率×95%＋同业存款收益率×5%”调整为“沪深 300 指数收益率*85%＋中债-总全价（总值）指数收益率*15%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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：（1）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。

（2）根据基金管理人发布的公告，自 2026 年 7 月 27 日起,本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数增长率×95%＋同业存款收益率×5%”调整为“沪深 300 指数收益率*85%＋中债-总全价（总值）指数收益率*15%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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		
王丹	本基金、嘉实沪港深回报混合、嘉实产业优势混合基金经理	2019 年 11 月 19 日	-	17 年	曾任摩根士丹利（亚洲）有限公司经理，中国国际金融有限公司高级经理，嘉实基金管理有限公司高级研究员，禾其投资研究员，上投摩根基金管理有限公司投资经理。2018 年 7 月加盟嘉实基金管理有限公司，曾任职于港股通投资策略组，现任基金经理。MBA，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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
王丹	公募基金	3	2,129,000,538.09	2019 年 1 月 10 日
	私募资产管理计划	1	98,320,917.80	2026 年 2 月 13 日
	其他组合	1	83,516,772.88	2021 年 2 月 23 日
	合计	5	2,310,838,228.77	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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、《嘉实主题精选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,国内经济延续"外需强、内需弱"的分化态势。出口高增而社零增长基本停滞，投资持续负增长，特别是地产投资承压。季末，政府加紧推动存量政策落地，并推出货币政策工具，房贷贴息落地，延续适度宽松、结构精准的政策取向。海外宏观方面，中东冲突升级，布伦特油价回升至100美金附近,美国10年/30年期国债收益率都位于多年来高位,美联储9月重启加息25bp，

欧日央行同月同步加息。高债券收益率环境往往伴随更高的宏观不确定性与风险溢价，投资者整体风险偏好下降。

三季度，A 股经历了较为剧烈的风格再平衡。上证指数、沪深 300 跌 6.2%、12.5%，创业板指、科创 50 重挫 27.8%、30.7%，创历史单季最大跌幅。行业涨跌结构相对上半年反转，煤炭、石油石化、银行领涨，电子、通信跌幅较大。

本季度，组合中以低估值类股票为主，成长类股票与其适度均衡。3 季度，我们加仓了此前下跌的能源、有色等个股，这些股票有一定的超额表现。另一方面，组合中持有的成长股以出海类制造业个股为主，受到海外地缘局势和潜在国内外税率变化等影响，这类股票在本季度表现较为平淡。当前虽然市场宏观情况波动很大，但还是有很多生意在产生大量现金流，我们会继续采用基本面结合估值安全边际的精选个股策略，力争为组合找到能持续创造自由现金流和股东回报的生意。

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 1.854 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.27%，业绩比较基准收益率为-11.24%。

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	1,385,005,165.52	85.72
	其中：股票	1,385,005,165.52	85.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	230,032,017.45	14.24
8	其他资产	663,500.24	0.04
9	合计	1,615,700,683.21	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	258,828,362.39	16.17
C	制造业	718,721,570.61	44.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	8,198,206.25	0.51
J	金融业	273,276,819.79	17.07
K	房地产业	52,706,706.00	3.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	73,273,500.48	4.58
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	1,385,005,165.52	86.51

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	600938	中国海油	2,799,902	93,572,724.84	5.84
2	000333	美的集团	970,031	77,699,483.10	4.85
3	601899	紫金矿业	2,597,125	77,368,353.75	4.83
4	600060	海信视像	2,781,543	76,353,355.35	4.77
5	002142	宁波银行	2,125,841	75,318,546.63	4.70
6	603259	药明康德	437,872	73,273,500.48	4.58
7	601233	桐昆股份	2,998,112	68,147,085.76	4.26
8	300750	宁德时代	226,800	66,023,748.00	4.12

9	603699	纽威股份	1,448,982	62,610,512.22	3.91
10	002244	滨江集团	5,197,900	52,706,706.00	3.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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	621,575.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,924.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	663,500.24

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	876,588,619.67
报告期期间基金总申购份额	6,523,652.04
减：报告期期间基金总赎回份额	19,564,187.52
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	863,548,084.19

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)中国证监会批准嘉实主题精选混合型证券投资基金募集的文件；

(2)《嘉实主题精选混合型证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实主题精选混合型证券投资基金招募说明书》；

(4)《嘉实主题精选混合型证券投资基金基金托管协议》；

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6)报告期内嘉实主题精选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