嘉实中证800指数增强型证券投资基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 21 日（基金合同生效日）起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证 800 指数增强
基金主代码	027987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	336,929,347.46 份
投资目标	本基金为增强型指数基金，力求对标的指数（中证 800 指数）进行有效跟踪的基础上，通过精选个股策略增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 800 指数作为本基金的标的指数，力求投资收益能够跟踪并超越标的指数。 股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主，通过定量增强策略优化组合管理和风险。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。 具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券/可交换债券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%

风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，一般情况下，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数增强型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 800 指数增强 A	嘉实中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	027987	027988
报告期末下属分级基金的份额总额	267,580,702.54 份	69,348,644.92 份

§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 21 日-2026 年 9 月 30 日）	
	嘉实中证 800 指数增强 A	嘉实中证 800 指数增强 C
1.本期已实现收益	7,130,732.24	1,903,134.59
2.本期利润	-2,378,060.67	-507,637.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073	-0.0057
4.期末基金资产净值	263,562,652.60	68,279,068.54
5.期末基金份额净值	0.9850	0.9846

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）本基金合同生效日为 2026 年 07 月 21 日，本报告期自 2026 年 07 月 21 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

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

嘉实中证 800 指数增强 A

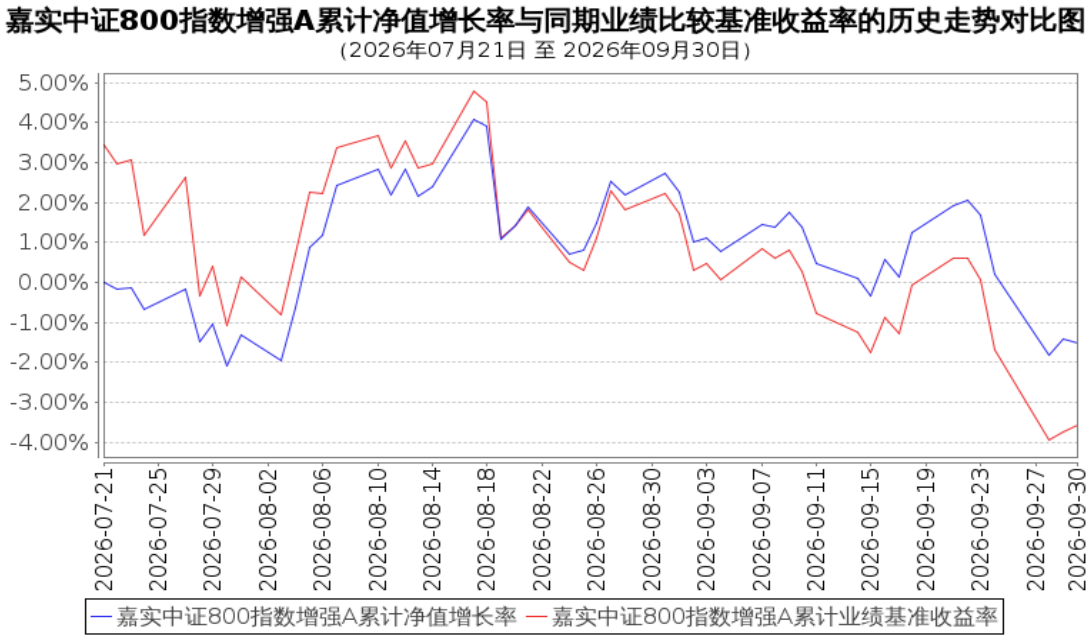
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同	-1.50%	0.88%	-3.57%	1.21%	2.07%	-0.33%

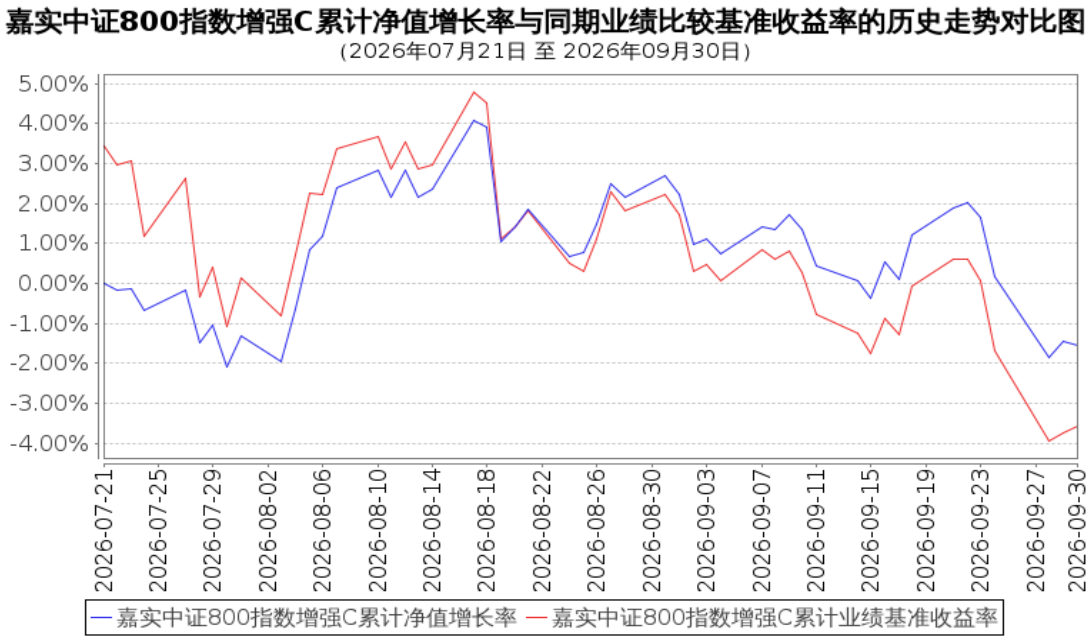
生效起至今						

嘉实中证 800 指数增强 C

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
自基金合同生效起至今	-1.54%	0.88%	-3.57%	1.21%	2.03%	-0.33%

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）本基金合同生效日 2026 年 07 月 21 日至报告期末未满 1 年。

（2）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，本报告期处于建仓期内。

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		
刘斌	本基金、嘉实优质精选混合、嘉实兴锐优选一年持有期混合、嘉实中证半导体指数增强发起式、嘉实上证科创板 50 指数增强发起式、	2026 年 7 月 21 日	-	20 年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，曾任增强风格投资总监，现任指数与量化投资首席投资官。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	嘉实中证A500指数增强基金经理				

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

截至报告期末，刘斌没有管理私募资产管理计划。刘斌管理的1个私募资产管理计划已于2026年8月4日离任。

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、《嘉实中证800指数增强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

2026年三季度A股高位调整，价值与红利风格全面占优。详细来看，上证指数在7月初短暂冲高至4143点的季度高点后快速回落，7月中旬一度下探至3741点一线，此后在3800—4000点

区间反复震荡，8 月下旬反弹至 3995 点附近受阻，9 月末再度回落。上证指数在三季度累计下跌 6.16%，深证成指下跌 20.47%，创业板指下跌 27.80%，科创 50 跌幅达到 30.70%，上证 50 相对抗跌，仅下跌 5.56%。

三季度权益市场整体由二季度的科技成长主导转向价值防御。驱动这一转变的核心因素来自两方面：海外利率上行与 AI 资本开支持续性担忧。一方面，北美云厂商投资预期降温引发 AI 硬件链集体回撤；另一方面，9 月美欧日同步加息、美联储加息 25 个基点，进一步压制成长股估值并打击市场风险偏好。

国内政策虽一度提供短期支撑——7 月底政治局会议提出加大逆周期调节力度、提升资本市场韧性和信心，但基本面尚不足以支撑持续反弹。7—8 月受极端天气影响，PMI 季节性偏弱、持续处于收缩区间；9 月制造业 PMI 回升至 50.1，重返扩张。同期出口保持高增，但内需消费和投资继续走弱，中长期信贷滚动增量同比明显下降，经济延续外强内弱、信用需求不足的格局。在这种情况下，权益市场成交与杠杆同步退潮——三季度日均成交额降至 2.28 万亿元，两融余额同步减少。与此同时，适度宽松的货币政策和充裕的银行体系流动性引导部分资金转向债市，10 年期国债收益率降至 1.675%附近，与海外利率大幅上行形成鲜明反差。而人民币则在出口高增与结汇需求的支撑下逆势走强，美元兑人民币由季初 6.79 附近回落至季末 6.71 附近。

行业层面，盈利支撑与估值压力的分化进一步加剧。能源涨价叠加高股息配置需求推动煤炭、石油石化、银行领涨；创新药出海逻辑支撑医药逆势上涨。反观上半年涨幅较大的电子、通信，则因预期降温与交易拥挤反转而显著回调，电力设备、建材亦明显下跌。

报告期内，本组合严格遵守基金合同约定，基于量化模型构建股票 Alpha 预测体系，并通过行业、风格、风险等多维度的控制进行组合优化。后续，组合将坚持高仓位运作模式，秉承整体稳健的投资风格，在量化投资框架内对模型进行持续调整与优化，进一步控制组合的风险与波动，力争为投资者创造长期、稳定的超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 0.9850 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.50%；截至本报告期末嘉实中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 0.9846 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.54%；业绩比较基准收益率为-3.57%。

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	309,720,553.86	93.01
	其中：股票	309,720,553.86	93.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,560.10	0.01
	其中：债券	39,560.10	0.01
	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	23,115,634.84	6.94
8	其他资产	125,681.19	0.04
9	合计	333,001,429.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	369,315.00	0.11
B	采矿业	25,762,653.04	7.76
C	制造业	159,337,874.66	48.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,745,214.00	2.33
E	建筑业	2,761,336.00	0.83
F	批发和零售业	413,147.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,544,728.00	1.37
H	住宿和餐饮业	142,595.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,879,007.00	3.28
J	金融业	47,555,665.00	14.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	393,340.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	3,748,592.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	269,742.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	85,386.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	588,426.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	264,597,020.70	79.74

5.2.2 报告期末积极投资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	136,900.00	0.04
B	采矿业	102,422.00	0.03
C	制造业	34,807,184.12	10.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	179,550.00	0.05
E	建筑业	366,619.00	0.11
F	批发和零售业	2,492,672.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	99,723.00	0.03
H	住宿和餐饮业	330,864.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,412,795.04	1.03
J	金融业	38,904.00	0.01
K	房地产业	643,838.00	0.19
L	租赁和商务服务业	356,001.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	549,349.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,071,813.00	0.32
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	534,899.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	45,123,533.16	13.60

5.2.3 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 报告期末指数投资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	600036	招商银行	189,900	7,835,274.00	2.36
2	600519	贵州茅台	5,900	7,425,858.00	2.24
3	000333	美的集团	88,200	7,064,820.00	2.13
4	002463	沪电股份	51,900	6,016,767.00	1.81
5	688008	澜起科技	28,100	5,684,911.00	1.71
6	300750	宁德时代	18,800	5,472,868.00	1.65
7	300502	新易盛	13,300	5,173,700.00	1.56
8	601857	中国石油	423,800	4,750,798.00	1.43
9	601899	紫金矿业	157,900	4,703,841.00	1.42

10	688041	海光信息	19,900	4,513,320.00	1.36

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002222	福晶科技	21,300	1,291,632.00	0.39
2	688110	东芯股份	8,796	1,001,072.76	0.30
3	688123	聚辰股份	4,600	734,528.00	0.22
4	300613	富瀚微	8,800	711,040.00	0.21
5	300184	力源信息	55,500	607,170.00	0.18

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	-	-
	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）	39,560.10	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,560.10	0.01

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	123286	国科转债	270	27,000.95	0.01
2	113710	四方转债	90	12,559.15	0.00

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	125,681.19
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	125,681.19

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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

项目	嘉实中证800指数增强A	嘉实中证800指数增强C
基金合同生效日(2026年7月21日)基金份额总额	357,710,304.11	105,052,000.55
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,997,628.06	1,250,795.23
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	92,127,229.63	36,954,150.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	267,580,702.54	69,348,644.92

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）中国证监会准予嘉实中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复文件。

（2）《嘉实中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实中证 800 指数增强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）报告期内嘉实中证 800 指数增强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