景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

2018年第三季度报告

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26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规定，于2018年10月25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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城鼎益混合（LOF）
场内简称	景顺鼎益
基金主代码	162605
交易代码	162605
前端交易代码	162605
后端交易代码	162606
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005年3月16日
报告期末基金份额总额	2,561,625,204.59份
投资目标	本基金通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。
投资策略	本基金依据以宏观经济分析模型MEM为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，并运用景顺长城股票研究数据库（SRD）及GVI等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时，本基金运用多资素模型等分析工具，结合基金管理人的主观判断，根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。
业绩比较基准	沪深300指数×80%＋银行同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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（2018年7月1日 - 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-23,987,733.40
2.本期利润	-409,682,800.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1507
4.期末基金资产净值	3,163,256,076.20
5.期末基金份额净值	1.235

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。

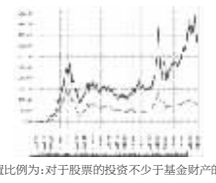
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-10.12%	1.71%	-1.52%	1.09%	-8.60%	0.62%

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：本基金的资产配置比例为：对于股票的投资不少于基金财产的60%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。按照本基金基金合同的规定，本基金自2005年3月16日合同生效日起至2005年6月15日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。自2017年9月6日起，本基金业绩比较基准由“富时中国A200指数×80%+同业存款利率×20%”调整为“沪深300指数×80%＋银行同业存款利率×20%”。

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		
刘彦春	本基金的基金经理，公司总经理助理兼研究部总监	2015年7月10日	-	15年	管理学硕士。曾担任汉唐证券研究员，香港中信投资研究有限公司研究员，博时基金研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2015年1月加入本公司，自2015年4月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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%的交易共有55次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度，中美贸易冲突叠加信用紧缩引发市场风险偏好显著下降，汇率波动导致人民币资产系统承压。绩优股快速补跌，市场情绪极度悲观，引发一系列对全球政治、经济的大讨论。个股基本面、估值关注度极低，对市场各种信息向悲观方向解读。根据以往经验，这是较为显著的市场底部特征。

我们坚持一贯的投资思路，不猜市场，不猜风格，押注企业家能力，基于3-5年中长期逻辑，买入并持有具备较强升值潜力的优质公司。

年初以来市场无风险收益率稳中有降。现阶段大类资产方面，权益资产回报率具备显著优势。其中竞争格局稳定，资产负债表强劲的公司更具吸引力。很多公司估值水平反映的是盈利大幅下降预期。实际情况很可能没有这么差。

汇率问题仍具不确定性，需要看中美冲突博弈进展。中美贸易摩擦问题进程难以把握，什么“扼制”、“陷阱”等等说法难以证实证伪，但我们认为两个大国基于各自利益最大化会找出解决问题的办法。一旦汇率稳定，市场情绪有望修正。

市场经常把长期问题短期化，周期问题趋势化。有些很大、很深奥的问题需要在发展中慢慢解决，过去的牛熊转换中这些问题一直存在，完全不必现在故作高深。

信用紧缩没什么不好，既想优化资源配置、又不想承受改革阵痛是不可能的。此外，信用紧缩已经边际改善，也反映出我们政策的灵活性。

一切都是顺理成章，我们只需要管理好自己的情绪。

任何利好都没有价格打折来得实惠，几年以后我们会怀念目前市场赐予我们的买入价格，就像我们现在经常怀念以往每次“危机”带给我们的投资机会。

我们反复审视手中的筹码，如果继续调整，唯有买入更多。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年3季度，基金份额净值增长率为-10.12%，业绩比较基准收益率为-1.52%。

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	2,992,904,475.43	94.23
	其中：股票	2,992,904,475.43	94.23
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	168,754,589.26	5.31
8	其他资产	14,583,286.67	0.46
9	合计	3,176,242,351.36	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	346,740,000.00	10.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,646,164,475.43	83.65
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	-	-
J	金融业	-	-
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	2,992,904,475.43	94.61

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 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	600519	贵州茅台	410,414	299,602,220.00	9.47
2	002311	海大集团	13,000,025	282,620,543.50	8.93
3	603899	晨光文具	8,884,604	275,866,954.20	8.72
4	002304	洋河股份	1,900,000	243,200,000.00	7.69
5	600566	济川药业	6,141,983	241,932,710.37	7.65
6	000596	古井贡酒	2,900,000	241,367,000.00	7.63
7	000568	泸州老窖	5,000,000	237,550,000.00	7.51
8	000651	格力电器	5,896,400	237,035,280.00	7.49
9	300498	温氏股份	10,000,000	232,200,000.00	7.34
10	000418	小天鹅A	3,789,800	183,956,892.00	5.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	493,478.63
2	应收证券清算款	8,282,912.26
3	应收股利	-
4	应收利息	30,204.21
5	应收申购款	5,776,691.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,583,286.67

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000418	小天鹅A	183,956,892.00	5.82	重大事项停牌

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	2,803,100,779.39
报告期期间基金总申购份额	278,526,406.50
减：报告期期间基金总赎回份额	520,001,981.30
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	2,561,625,204.59

§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

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；

2、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2018年10月26日

嘉实安心货币市场基金

2018年第三季度报告

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：2018年10月26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规定，于2018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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实安心货币
基金主代码	070028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月28日
报告期末基金份额总额	3,275,989,912.53份
投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金以确保组合安全性为首要任务，兼顾流动性和收益性。根据宏观经济指标决定债券组合的剩余期限和比例分布；根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例；根据债券的信用等级及担保状况决定组合的风险级别。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	嘉实安心货币A 嘉实安心货币B
下属分级基金的交易代码	070028 070029
报告期末下属分级基金的份额总额	219,663,336.35份 3,056,326,576.18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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)		
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B	
1.本期已实现收益	993,616.83	25,875,836.48	
2.本期利润	993,616.83	25,875,836.48	
3.期末基金资产净值	219,663,336.35	3,056,326,576.18	

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；（2）嘉实安心货币A与嘉实安心货币B适用不同的销售服务费率；（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（4）本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实安心货币A						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6884%	0.0072%	0.3403%	0.0000%	0.3481%	0.0072%

嘉实安心货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.75%	0.01%	0.34%	0.00%	0.41%	0.01%	

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

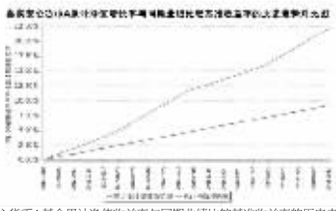


图1：嘉实安心货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2011年12月28日至2018年9月30日）

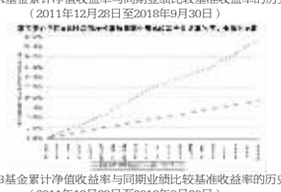


图2：嘉实安心货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2011年12月28日至2018年9月30日）

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（十四（二）投资范围和（八）投资组合比例限制）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		
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实新金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实赚益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2016年7月23日	-	9年	曾任Futex Trading Ltd期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。
李曦	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实赚益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理	2015年5月14日	-	9年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生，具有基金从业资格。
张文玥	本基金、嘉实货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实1个月理财债券、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券基金经理	2014年8月13日	-	10年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士、具有基金从业资格。

注：（1）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、《嘉实安心货币市场基金基金合同》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，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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%的交易共有4次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度，中美贸易冲突叠加信用紧缩引发市场风险偏好显著下降，汇率波动导致人民币资产系统承压。绩优股快速补跌，市场情绪极度悲观，引发一系列对全球政治、经济的大讨论。个股基本面、估值关注度极低，对市场各种信息向悲观方向解读。根据以往经验，这是较为显著的市场底部特征。

我们坚持一贯的投资思路，不猜市场，不猜风格，押注企业家能力，基于3-5年中长期逻辑，买入并持有具备较强升值潜力的优质公司。

年初以来市场无风险收益率稳中有降。现阶段大类资产方面，权益资产回报率具备显著优势。其中竞争格局稳定，资产负债表强劲的公司更具吸引力。很多公司估值水平反映的是盈利大幅下降预期。实际情况很可能没有这么差。

汇率问题仍具不确定性，需要看中美冲突博弈进展。中美贸易摩擦问题进程难以把握，什么“扼制”、“陷阱”等等说法难以证实证伪，但我们认为两个大国基于各自利益最大化会找出解决问题的办法。一旦汇率稳定，市场情绪有望修正。

市场经常把长期问题短期化，周期问题趋势化。有些很大、很深奥的问题需要在发展中慢慢解决，过去的牛熊转换中这些问题一直存在，完全不必现在故作高深。

信用紧缩没什么不好，既想优化资源配置、又不想承受改革阵痛是不可能的。此外，信用紧缩已经边际改善，也反映出我们政策的灵活性。

一切都是顺理成章，我们只需要管理好自己的情绪。

任何利好都没有价格打折来得实惠，几年以后我们会怀念目前市场赐予我们的买入价格，就像我们现在经常怀念以往每次“危机”带给我们的投资机会。

我们反复审视手中的筹码，如果继续调整，唯有买入更多。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实安心货币A的基金份额净值收益率为0.6884%，嘉实安心货币B的基金份额净值收益率为0.7489%，业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	1,217,961,390.81	37.15
	其中：债券	1,217,961,390.81	37.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,150,000,000.00	35.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	903,244,396.02	27.55
4	其他资产	7,720,592.52	0.24
5	合计	3,278,926,379.35	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过75天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	57.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	17.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	12.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	3.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	9.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.87	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	199,715,703.69	6.10
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	250,360,196.43	7.64
6	中期票据	70,168,810.64	2.14
7	同业存单	697,716,680.05	21.30
8	其他	-	-
9	合计	1,217,961,390.81	37.18
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111805120	18建设银行CD120	2,500,000	248,804,961.79	7.59
2	111803147	18农业银行CD147	1,600,000	159,312,098.87	4.86
3	111806182	18交通银行CD182	1,500,000	149,756,840.37	4.57
4	011801132	18长电SCP002	1,200,000	120,282,472.15	3.67
5	111705109	17建设银行CD109	1,200,000	119,899,080.97	3.66
6	011801772	18中电投SCP028	800,000	80,000,085.29	2.44
7	189935	18贴现国债35	800,000	79,882,152.51	2.44
8	189917	18贴现国债17	600,000	59,965,581.67	1.83
9	101551075	15光明MTN002	500,000	50,113,297.85	1.53
10	189922	18贴现国债22	400,000	39,899,600.01	1.22

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1407%
报告期内偏离度的最低值	0.0048%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0607%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到0.5%。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

5.9.2 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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

5.9.3 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	635,866.64
3	应收利息	5,700,377.76
4	应收申购款	1,344,348.12
5	其他应收款	40,000.00
6	其他	-
7	合计	7,720,592.52

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
报告期期初基金份额总额	105,920,053.14	2,697,220,229.45
报告期期间基金总申购份额	443,684,825.52	3,864,144,043.85
报告期期间基金总赎回份额	329,941,542.31	3,405,037,697.12
报告期期末基金份额总额	219,663,336.35	3,056,326,576.18

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升级调增份额，总赎回份额含转换出及基金份额自动降级调减份额。

§7 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 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

投资者类别		报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）	
机构	1	2018/07/01至2018/09/30	1,010,158,179.56	7,843,456.55	-	1,018,001,636.11	31.07	
	2	2018/07/05至2018/09/04	1,004,202,305.79	1,004,202,305.79	-	-	-	
个人	-	-	-	-	-	-	-	
产品特有风险								
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。								

§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安心货币市场基金募集的文件；

（2）《嘉实安心货币市场基金基金合同》；

（3）《嘉实安心货币市场基金招募说明书》；

（4）《嘉实安心货币市场基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实安心货币市场基金公告的各项原稿。

9.2 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

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2018年10月26日

嘉实安益灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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：2018年10月26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规定，于2018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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况