导性陈述或者重大遗漏。

*基金的招募说明书。

3.1 主要财务指标

列数字。

3.2 基金净值表现

其全管理人, 嘉立其全管理有限公司

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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

基金托管人中国邮政储蓄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

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

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

§ 2 基金产品概况

冰其奈山镇指标不有抵抗有人认购或农民其会的各项费用 计入费用后实际收益水平更低于底

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 副,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。基金托管人中国农业银行股 分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

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

§ 2 基金产品概况

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

ervelander (rengranden im eine eine

ha<u>pronq</u>uali

图:嘉实丰和灵活配置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

(2017年3月20日至2018年9月30日)

注,1.按其全会同和权真说明其的约定 木其全自其全会同生效日起6个日内为建会期 建

本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基 场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。

单位:人民币元

① – ③

嘉实丰和灵活配置混合证券投资基金由丰和价值证券投资基金转型而成

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

亥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

71 基金管理人持有本基金份额变动情况

9.1 备查文件目录

9.3 查阅方式

工本费购买复印件。

单位:份

72 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

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。

8.1 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

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

(1) 中国证监会准予嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

(5) 其金管理人业多资格批估 营业执照,

(3)《嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

(6) 报告期内嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金公告的各项原稿

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

1,500,066 500J



嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

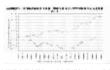


图:嘉实丰安6个月定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率

(2016年12月29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(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关

《4 管理人报告

单位,人民而元

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	基金经理期限	证券从业年	说明	
XE-YG	88195	任职日期	高任日期	限	156191	
王亚洲	本基金、嘉实中证 中期企业债指证的 (LOF)、嘉实中证数 (LOF)、惠实中证金边中期国债于下,惠可证金边中期至实债 产工下联接、惠实等 经绝债债券、惠实稳 经纯债债券。条变稳 等纯债债券金经理	2016年12月29 日	-	6年	曾任国泰基金管理 有限公司债券研究 员,2014年6月加入 嘉实基金管理月和限 公司固定收益业务 体系任研究员。具 有基金从业资格, 中国国籍。	

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、

《嘉实丰安6个月定期开放债券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 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5次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与 其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

姓名

国内宏观方面,经济基本面依然偏弱,地产是投资中表现最好的部分,但基建延续前期的走 势,拖累仍较为明显,政策层面考虑到贸易战潜在的风险以及前期去杠杆政策对基本面的压力, 在三季度出现了明显的转变。其中,7月中旬的国务院常务会议和政治局会议基调转向稳经济

年9月5日,本基金管理人发布《关于嘉实丰和灵活配置混合基金经理变更的公

注:(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业

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、 《嘉实丰和灵活配置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 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

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

单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计5次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与

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

3季度是一个非常特殊的时期,无论专业投资者还是一般投资者的情绪都非常低迷,对未来 非常悲观。资本市场波动也随之加大、尽管最终指数跌幅有限、但基金重仓的科技、医药、消费等

领域的蓝筹股、龙头股在3季度回调明显,机构投资者的净值表现在3季度是压力比较大的,进入

9月下旬,随着一些有利于内需的政策出台,以及投资者越来越认识到贸易战是一个长期的过

程,对外部贸易战的负而情绪有所缓和,虽然整体风险偏好仍然较低,但投资者情绪开始有所企

稳,市场也出现一定程度的反弹,我们觉得从结果上看还是比较符合我们的预期,也就是说从股

债收益率的角度,股市的吸引力在逐渐增强,经济放缓已经逐渐达成共识,股市有望在经济见底

不大,但认为市场波动会比较大,因此没有迅速的将仓位调整到位,操作思路上是希望能够首先

9月下旬开始对持仓股票进行调整,但仓位的调整还不到位,虽然我们认为市场的向下空间

17年

场方面,整体三季度市场呈现震荡局面,信用债表现明显优于利率债,7月受益于资金面宽松,收 益率曲线大幅陡峭化,3-5年利率债和三年内信用债表现最佳,长端利率债也有一定程度下行; 后期政策主导目标转为宽信用后,市场的风险偏好有所修复,中低等级信用债表现较佳,8月中 旬开始,资金而的宽松幅度较前期有所降低,9月份在刺激经济的预期和地方债供给的共同扰动 下,收益塞出现一定幅度的反弹,利塞债中尤以国债的反弹幅度最大。

组合操作层面:组合在三季度前期保持高久期高杠杆,后期随着刺激政策的逐步兑现,逐渐 降低组合久期,但保持组合杠杆维持在较高水平,运作期间,没有做明显的信用下沉。结合对基 本面和政策的判断,积极寻找曲线斜率交易的机会,在保持组合回撤基本可控的前提下,积极寻 找盈利机会,提升组合收益。

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1.0553元;本报告期基金份额净值增长率为1.90%,业绩

46 报告期内其全持有人数或其全资产净值预繁说明

§ 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	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,014,680,200.00	97.59
	其中:债券	2,014,680,200.00	97.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
Б	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买 人返售金融资产	-	_
7	银行存款和结算备付 金合计	9,652,927.54	0.47
8	其他资产	40,085,888.35	1.94
9	合计	2,064,419,015.89	100.00

52 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

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 报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

1	国家债券	19,996,000.00	1.
2	央行票据	-	
3	金融债券	310,683,000.00	199
	其中:政策性金融债	159,825,000.00	10.
-4	企业债券	496, 462, 200.00	31.
5	企业短期融资券	140,651,000.00	83
6	中期票据	815,974,000.00	51.5
7	可转债(可交换债)	-	

嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金

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	090208	09国开08	600,000	59,460,000.00	3.76
2	180202	18国开02	500,000	50,745,000.00	3.21
3	122203	12海螺02	400,000	41,064,000.00	2.59
4	101453025	14京国资 MTN002	400,000	40,916,000.00	258
Б	101456023	14鄂交投 MTN001(5	400,000	40,756,000.00	257

报告期末,本基金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

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

5.9 报告期末本其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。

报告期内,本基金未参与国债期货交易。 5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

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。

SECTION () U /	12777	12-12
82,571.82	存出保证金	1
_	应收证券清算款	2
_	应收股利	3
40,003,316.53	应收利息	4
_	应收申购款	5
_	其他应收款	6
_	待摊费用	7
_	其他	8
40,085,888.35	合计	9

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末,本基金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

§ 6 开放式基金份额变动

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cr

查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。 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

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。 报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

《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

注: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。 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 备查文件目录

(2)《喜欢主和灵活配置混合刑证券投资基金基金合同》 (3)《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4)法律意见书

(6)基金托管人业务资格批件、营业执照

嘉实基金管理有限公司

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

一定公社派人生: "海及非理的任 一定公社派人中们工编时不提的有限公司根据从基金合同规定,于2011年10月20日复复了本报告中的财务指标、净值 规程设理自合程序中对。保证复独对客不存在建设达载、设计等路底这者推定之一。 基金管用人承诺以该定信用,通规定增加资明管理报识用基金营产。但不保证基金一定签判。 基金管用人承诺以该定信用,通规定增加资明管理报识用基金营产。但不保证基金一定签判。 基金管记在使进程外不收其其未收取, 本报告偿任2位使进行中,任政主义或是一位。 本报告偿任2位使进行了目记整定2016年9月20日中,



主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30 日)	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30 日)
	嘉实基本面50指数(LOF)A	嘉实基本面50指数(LOF)C
1.本期已实现收益	26,759,608.68	41.71
2.本期利润	136,313,021.61	5,368.21
3.加权平均基金份额本 期利润	0.1110	0.1227
4.期末基金资产净值	1,989,374,321.80	103,006.91
5.期末基金份额净值	1,5008	1.0590

日紀开放泰宗基本面50指数(LOF)的申賦业务:(4)泰宗基本面50指数(LOF)A收取认(申)购费和赎回费,泰宗基本 32.1 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

净值增长率 净值增长率 业绩比较基 业绩比较基 (D-3) (2-4)

3.1 主要财务指标

BIEK	0	标准	差2	性收益率③	准差④	0-0	2-3
过去三个月	7.	60%	1.30%	5.91%	1.30%	1.69%	0.00
(实基本面60)	旨数(LOF)C						
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较准收益率		率标 ①-3	2-4	
>++= A D	FOON	4.400/		cor a	400 O.O.	10/ 0.000	

222 点其人人用业验以支其人用法必须各位额区家庭与五共上周期间建设经过建设计会家庭与设计 THE RESERVE OF MATERIAL AND REAL PROPERTY.



the British of Paris 1921 and advertised

Charles and the 图2·喜实基本而60指数(LOF)C基金价额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的 18年8月9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(十一(三)投资范围和(七)2、基金投资组合限制)的有关约定

任职日期

4.3.1 公平交易制度的执行情况

数证券投资基金(LOF)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

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。 有仅同时,他生日本人一切的打压应定义。但为这样能由自由不少的人不少参加。因此可求处于40人可以可以不少多加地。 在收值自分数投管管理制度和接受效应集,并在有限效信息,投资量权取实施投资资金为而享不分不可引仓。避过完善交易范围内各类交易的公平交易执行规则,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T系统和

0.35%的限制。本基金跟踪误差来源主要包括长期停牌个股的重新估值以及基金申购赎回的影响。 其本而60把数为首口内抽其本而指数 以4个其本而指标(营业收入 可会资 净资产 分红)束备量的经济规模员士

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6次,均为施下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为,

投资回报与业绩基准保持一致。 4.5 报告期内基金的业绩表现 截至本报告期末嘉实基本面50指数(LOF) A基金份额净值为15008元,本报告期基金份额净值增长率为7.60%,业绩

比较基础或益率为5.01%。截至本报告则未需实基本面的跨载LOF产基金份额产值为10800元,本报告则基金份额产值增长率为5.00%,设置比较基础或适率为5.08%。 长率为5.00%,设置比较基础或适率为5.08%。 4.0 投资则发递参约人或或基础分别5.08%。

75-1	P号 坝田		近額(元)		白癌症垃圾产的吃例(%)
1		权益投资		1,883,218,815.43	93.93
		其中:股票		1,883,218,815.43	93.93
2	- CALLEDON DA			-	-
3	3 固定收益投资			30,051,000.00	1.50
	其中:债券			30,051,000.00	1.50
	资产支持证券			_	_
4	贵金属投资			_	_
5	5 金融衍生品投资			-	-
6		买人返售金融资	jòs	-	-
		其中: 买断式回 的买人返售金融 产		-	-
7	7 银行存款和结算 付金合计		俗	74,289,097.28	3.71
8	8 其他资产		17,360,074.62		0.87
9		合计		2,004,918,987.33	100.00
2 报告期 2.1 报告	末接行 御末指	了业分类的股票投 ;数投资按行业分	授的	日合 1形型和密组合	,
代码	T	行业类别		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、木	木、牧、渔业		-	-
В	采矿	ЛK		114,265,510.68	5.74
C	制造	Alv	259, 198, 472.25		13.03
D		、热力、燃气及水 和供应业	77,944,605.87		3.92
E	建筑	Ale		200,852,044.76	10.10
F	批发	和零售业		-	-
G	交通政业	运输、仓储和邮		28,240,91853	1.42
Н	住宿	和餐饮业		-	-
I		传输、软件和信 术服务业		34,145,904.68	1.72
			-		

农、林、牧、渔业

股票名称 数量(股 公允价值(元)

ァ。 争值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 (本行行权证。 法金投资的股指期货交易情况说明 法未参与股指期货交易。 基金投资的国债期货交易情况说明 法参与国债期货交易。

减:报告期期问基金总赎回

83. 差額方式 (1) 书面资助: 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,也可按工本费购以复印件。 (2) 网络克姆·基金管里,风贴上http://www.xdund.m 投资者与水是为如果保护,可含物本基金管服人最级

嘉实基金管理有限公司 2018年10月26日

管理办法)的相关规定。

规模较小,我们认为管理难度相对较小,个股选择的空间也更大一些,虽然该组合大的结构调整 说明 已经告一段落,但还需要持续的个股调整来改善组合业绩,这也是下个季度我们的管理目标,希 望在年内能够尽力挽回一些损失,更重要的是为明年做好个股的布局。 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0.8721元;本报告期基金份额净值增长率为-9.81%,业 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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纸 2周出现一定力度的反弹,这也增加了我们仓价调整的难度,后续计划尽快将仓价提高到合理水 数量(股) 结构上,遵循旗下几个基金的管理思路, 行业配置相对均衡, 寻找个股的简尔法, 由于组合

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,075,000.00	7.87
	其中:政策性金融债	50,075,000.00	7.87
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	50,075,000.00	7.87

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	180209	18国开09	400,000	40,068,000.00	6.30
2	170211	17国开11	100,000	10,007,000.00	1.57
	期末,本基金		±2支债券。		- Adv Nove Market Market

报告期末,本基金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 报告期末,本基金未持有贵金属投资。 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

5.9 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。 5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1)2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决 字(2018)1号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以 个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款6570万元, 没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金投资于"招商银行(600036)"的决策程序说明:基于对招商银行基本面研究以及 二级市场的判断,本基金投资于"招商银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规 (2) 报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

(1)中国证监会关于准予丰和价值证券投资基金变更注册的批复文件

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照

(7) 报告期内嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿 8.2 存放地点

(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。

2018年10月26日