

嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	220,260,227.98	49.00
2	固定收益	220,949,127.98	49.00
3	基金投资	87,176,260.00	18.84
4	金融衍生品	87,176,260.00	18.84
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	475,212,225.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 采矿业	-	-
C 制造业	262,711,662.04	51.22
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	13,260,070.00	2.81
F 批发和零售业	5,305,162.00	1.12
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	3,813,420.00	0.80
J 房地产业	-	-
K 其他行业	-	-
L 国防军工	7,616,791.00	1.61
M 医药生物	-	-
N 有色金属、非金属矿物制品业	-	-
O 化学原料和化学制品制造业	-	-
P 计算机、软件和信息技术服务业	-	-
Q 公用事业	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 其他	220,949,127.98	47.00

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	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00	7.96
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00	5.59
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00	8.08
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00	3.07
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00	2.21
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00	2.64
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00	2.48
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00	2.44
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00	2.39
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00	2.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00

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十名债券投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 采矿业	-	-
C 制造业	262,711,662.04	51.22
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	13,260,070.00	2.81
F 批发和零售业	5,305,162.00	1.12
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	3,813,420.00	0.80
J 房地产业	-	-
K 其他行业	-	-
L 国防军工	7,616,791.00	1.61
M 医药生物	-	-
N 有色金属、非金属矿物制品业	-	-
O 化学原料和化学制品制造业	-	-
P 计算机、软件和信息技术服务业	-	-
Q 公用事业	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 其他	220,949,127.98	47.00

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	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00	7.96
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00	5.59
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00	8.08
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00	3.07
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00	2.21
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00	2.64
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00	2.48
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00	2.44
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00	2.39
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00	2.06

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债券投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00

5.9 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债券投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00

5.10 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债券投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00
6	000009	深大通	200,000	12,427,200.00
7	000011	航发动力	200,000	11,702,000.00
8	000003	浦发银行	276,300	11,569,074.00
9	000005	格力电器	466,500	11,361,267.00
10	000001	中国平安	227,424	9,712,540.00

5.11 投资组合报告附注

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。

5.12 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收利息	10,498.00	-
2	应收股利	-	-
3	应收申购款	-	-
4	其他	-	-
5	合计	2,220,528.24	-

5.12 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收利息	10,498.00	-
2	应收股利	-	-
3	应收申购款	-	-
4	其他	-	-
5	合计	2,220,528.24	-

5.13 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113010	浦发转债	2,066,494.24	0.43
2	110002	三债债	594,481.00	0.12
3	110000	招商转债	300,000.00	0.06

5.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

项目	基金份额(万份)	占基金资产净值比例(%)
1 期初余额	10,498.00	-
2 期间申购资金	-	-
3 期间赎回资金	-	-
4 期末余额	-	-
5 期间申购资金	-	-
6 期间赎回资金	-	-
7 申购费(不含销售)	-	-
8 赎回费	-	-
9 其他	-	-
10 合计	2,220,528.24	-

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113010	浦发转债	2,066,494.24	0.43
2	110002	三债债	594,481.00	0.12
3	110000	招商转债	300,000.00	0.06

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五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	39,487,080.00	7.96
2	000002	万科A	26,552,452.00	5.59
3	000003	招商银行	38,320,462.00	8.08
4	000005	格力电器	14,514,000.00	3.07
5	000021	招商局A	10,410,400.00	2.21

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债券投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00

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股票投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00

5.9 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	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	53,960	39,487,080.00
2	000002	万科A	260,074	26,552,452.00
3	000003	招商银行	264,022	38,320,462.00
4	000005	格力电器	740,300	14,514,000.00
5	000021	招商局A	104,104	10,410,400.00

5.10 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	代码	名称</
----	----	------