嘉实增长开放式证券投资基金

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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一,嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成,包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式,适用一个基金合同和招募说明书。

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	嘉实增长混合
基金主代码	070002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	209,199,732.47份
投资目标	投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。
投资策略	从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票,重点投资于预期利润或收入具有显著增长潜力的成长股上市公司的股票。投资组合比例范围为股票40%-75%,债券20%-55%,现金5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮500小盘指数收益率+40%*中债总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。
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

§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	-28,394,467.12
2.本期利润	-39,734,122.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1899
4.期末基金资产净值	2,003,760,503.10
5.期末基金份额净值	9.576

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)所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	-1.96%	1.33%	-5.33%	0.76%	3.37%	0.57%

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

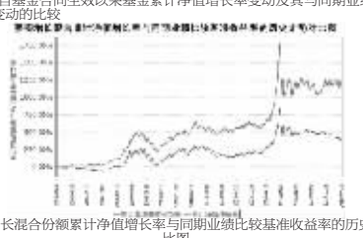

图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年7月9日至2018年9月30日)

注:按基金合同规定,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各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

§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		
李文华	本基金、嘉实优化红利混合、嘉实新兴产业股票基金经理	2017年11月18日	-	7年	曾任兴业证券证券研究分析师,2012年加入嘉实基金管理有限公司,任研究部研究员一职。

注:(1)任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日;(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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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

今年以来全球范围内风险事件多次出现,贸易战冲突、信用紧缩、强美元对新兴市场冲击等因素仍会给市场带来扰动,未来一段时间经济下行加速和微滞涨格局将持续显现。风险因素的持续压制使得中期还是要做好市场继续有一定波动的准备,同时市场亦形成高度分化的局面,中期还是要做好市场继续有一定波动的准备,估值不排除往更极端方向继续压缩。

在今年波动与分化加大的环境下,我们维持相对中性仓位,并视有把握的标的数量进行调节;在投资中我们提高了对个股选择标准的要求,更前瞻地加深对重仓股研究和跟踪。随着A股渐进性融入国际市场,我们在实际工作中更需要国际化的投资理念,完成从思想层面到落地层面的关键转化。我们建立了相对完备的投资分析流程与体系,加强工作过程要求,涵盖包括行业、企业、财务和估值等各维度的分析。与此同时,我们坚定把重心放在有长期增长前景的战略性资产上,立足于中长期的投资理念。

回顾本组合的运作,我们的策略依然是积极寻找结构性机会。我们对经济相对谨慎,因此进一步规避了顺周期资产的配置比例,至上而下看好两条主线:消费和成长。中国拥有最大的中产阶级阶层,同时拥有巨大的消费市场。当人均GDP超过8000美元后,消费对GDP的贡献不断提升。消费升级是一个大的趋势,消费领域会有很好的投资机会,我们在消费领域重点配置了医药、食品饮料、家电等细分行业;今年以来,紧信用、宽货币大的基调下,多次降准改善了流动性。成长股经历了两年的调整,流动性边际放松有利于成长股的行情。在成长股领域,我们重点配置了医疗服务、电子、军工和计算机等细分领域。

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9.578元;本报告期基金份额净值增长率为-1.96%,业绩比较基准收益率为-5.33%。

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	1,489,153,339.71	74.11
	其中:股票	1,489,153,339.71	74.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	484,850,328.80	24.13
	其中:债券	484,850,328.80	24.13
	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:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,563,044.97	1.02
8	其他资产	14,743,709.03	0.73
9	合计	2,009,310,422.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	50,711,698.20	2.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,038,062,004.57	51.81
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	70,599,236.30	3.52
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	85,801,861.00	4.28
J	金融业	80,141,325.12	4.00
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	143,443,941.52	7.16
R	文化、体育和娱乐业	20,373,274.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	1,489,153,339.71	74.32

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	000661	长春高新	727,035	174,677,295.00	8.72
2	002179	中航光电	3,393,347	149,307,268.00	7.45
3	600271	航天信息	5,222,200	145,333,626.00	7.25
4	600763	通策医疗	2,670,712	143,443,941.52	7.16
5	600872	中炬高新	3,558,766	116,015,771.60	5.79
6	002032	苏泊尔	1,998,569	107,882,754.62	5.38
7	002415	海康威视	3,669,973	105,475,024.02	5.26
8	300567	精测电子	1,479,156	100,804,413.25	5.03
9	600570	恒生电子	1,554,100	85,801,861.00	4.28
10	002142	宁波银行	4,512,462	80,141,325.12	4.00

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	4,897,380.40	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	479,952,948.40	23.96
	其中:政策性金融债	479,952,948.40	23.96
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	484,850,328.80	24.20

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	180404	18农发04	1,200,000	120,588,000.00	6.02
2	170311	17进出11	1,200,000	120,108,000.00	5.99
3	140323	14进出23	800,000	80,920,000.00	4.04
4	180201	18国开01	500,000	50,220,000.00	2.51
5	170211	17国开11	500,000	50,035,000.00	2.50

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

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

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

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。

5.11.2

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	445,699.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,862,812.32
5	应收申购款	445,197.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,743,709.03

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

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	210,226,870.54
报告期期间基金总申购份额	5,520,656.84
减:报告期期间基金总赎回份额	6,547,794.91
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	209,199,732.47

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金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

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。

7.2 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件;(2)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实增长开放式证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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

嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	嘉实增强收益定期债券
基金主代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月24日
报告期末基金份额总额	51,923,600.58份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期总回报最大化,以谋求长期保值增值。
投资策略	在具备足够多预期风险可控、收益率良好的投资标的时,优先考虑短期融资券及非AAA级别的其他信用债券的配置。同时,还可通过其他债券、衍生工具等辅助投资策略,规避风险、增强收益;基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究,运用定性定量模型,采取适度分散的行业配置策略以及自下而上的个债精选策略。
业绩比较基准	中债企业债总财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	嘉实增强收益定期债券A 嘉实增强收益定期债券C
下属分级基金的交易代码	070033 001873
报告期末下属分级基金的份额总额	51,891,906.86份 31,793.72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)	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
	嘉实增强收益定期债券A	嘉实增强收益定期债券C
1.本期已实现收益	-617,275.33	-374.23
2.本期利润	942,730.01	485.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0118
4.期末基金资产净值	52,706,917.63	32,009.25
5.期末基金份额净值	1.016	1.007

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)所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)自2015年9月22日起本基金增加C类基金份额类别;自2015年9月24日起开放嘉实增强收益定期债券A和嘉实增强收益定期债券C的申赎业务;(4)嘉实增强收益定期债券A收取认(申)购费,嘉实增强收益定期债券C计提销售服务费,不收取认(申)购费。

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

嘉实增强收益定期债券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
过去三个月	1.30%	0.09%	2.38%	0.06%	-1.08%	0.03%

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	1.21%	0.09%	2.38%	0.06%	-1.17%	0.03%

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

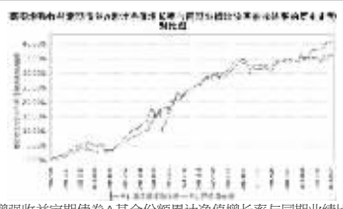

图1:嘉实增强收益定期债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年9月24日至2018年9月30日)

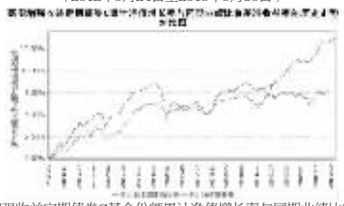

图2:嘉实增强收益定期债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年9月25日至2018年9月30日)

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"第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制"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		
胡永青	本基金、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券、嘉实纯债债券、嘉实信用债券(LOF)、嘉实年益短债定期债券、嘉实元和、新买新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳健债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题精选混合、嘉实价值增强混合、嘉实稳定债券、嘉实稳悦债券、嘉实新绝量化定期混合、嘉实新和量化定期混合基金经理	2014年3月26日	-	15年	曾任天安保险股份有限公司固定收益投资经理。自2008年加盟嘉实基金管理有限公司投资经理,国泰基金管理有限公司固定收益部投资助理、基金经理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系全球策略组组长、硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)任职日期指公司作出决定后公告之日;(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、《嘉实增强收益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

2018年3季度,国内经济下行压力显现,中美贸易战正式开打,央行货币政策进一步边际放松,年内第三次定向降准实施,国常委会议要求维持流动性合理充裕,积极财政政策要更加积极,理财新规细则征求意见稿有所放松。整个三季度,央行通过定向降准和公开市场操作和维持了流动性的合理充裕,公开市场操作以逆回购+MLF为主。公开市场逆回购到期2.11万亿,操作1.64万亿;MLF到期1.05万亿,操作1.66万亿,含国库现金合计净投放6800亿。随着中美贸易战的正式开打并进一步升级,人民币汇率延续了6月下旬开始的大幅贬值趋势,进入8月,为防范外汇市场顺周期行为和投机推动人民币贬值进入失控状态,央行接连采取了3次实质性干预措施,包括启动"逆周期因子"调节来稳定人民币币值。即期美元兑人民币虽一度贬值至6.9,但整体稳定在6.85附近。三季度银行间市场流动性保持充裕,8月上旬,流动性大幅宽松推动隔夜资金价格一度下行至1.45%,随后资金价格随着流动性有所收紧而回升100bps至2.4%附近。与二季度均值相比,三季度DR001均值下行34BP至2.26%、DR007均值下行23BP至2.58%、DR1M均值下行117BP至2.8%、DR3M均值下行128BP至2.99%。三季度债券市场收益率先有所下行,后略有回升。三季末1年期和10年期国开债收益率分别收于3.08%和4.20%,较6月底下行60bps和5bps。三季度信用债收益率回调幅度整体弱于利率债,信用利差压缩。1年AA短融与同期限国开债利差从6月末的175bps回落至9月末的127bps。1年期AAA级短融收益率由6月底的4.41%下行72bps至3.69%,同期限中等评级的AA+级短融收益率则由4.90%下行95bps至3.95%。三季度信用违约风险持续发酵,新增违约主体7家,虽然违约仍多集中于民营企业,但国企兵团六师、美兰机场违约的影响更为深远,打破了很多投资机构的金边信仰;且由于涉及个券均为超短融,也打破了市场普遍对短端相对安全的信仰。

18年3季度,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务;灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款,管理现金流分布,保障组合充足流动性;控制银行存款和债券资产配置比例,组合保持中性久期,在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险;谨慎筛选组合投资个券,严控信用风险;灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看,3季度本基金成功应对了市场和规模波动,投资业绩平稳,实现了安全性、流动性和收益性的目标,并且整体组合的持仓结构相对安全,流动性和弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为0.7220%,业绩比较基准收益率为0.0881%。

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	2,543,321,843.17	26.41
	其中:债券	2,543,321,843.17	26.41
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,266,706,660.08	33.93
	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	3,793,412,272.75	39.40
4	其他资产	25,611,128.43	0.27
5	合计	9,629,051,904.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.21
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,380,296,689.56	16.74
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)本基金基金合同第十二部分约定:债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120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	88.79	16.74
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	2.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	23.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		116.49	16.74

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	569,676,236.92	6.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,206,283.21	2.55
	其中:政策性金融债	210,206,283.21	2.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	630,141,710.77	7.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,143,298,613.27	13.87
8	其他	-	-
9	合计	2,543,321,843.17	30.85
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	030009	03国债09	2,400,000	240,323,148.17	2.92
2	011801762	18中电投SCP027	2,200,000	220,000,064.34	2.67
3	111813067	18浙银行CD067	2,000,000	199,705,156.46	2.42
4	111816238	18上海银行CD238	2,000,000	199,617,499.96	2.42
5	111813362	18交生银行CD362	2,000,000	199,541,174.70	2.42
6	111818269	18华夏银行CD269	2,000,000	196,082,569.51	2.37
7	130425	13农发25	1,500,000	150,158,947.49	1.82
8	011801772	18中电投SCP028	1,500,000	150,000,085.28	1.82
9	111818206	18华夏银行CD206	1,500,000	149,738,825.33	1.82
10	011801767	18陕延油SCP008	1,300,000	130,000,130.17	1.58

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	0.0670%
报告期内偏离度的最低值	-0.0017%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0213%

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	-
3	应收利息	25,611,128.43
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,611,128.43

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实增强收益定期债券A	嘉实增强收益定期债券C
报告期期初基金份额总额	75,067,068.79	41,492.45
报告期期间基金总申购份额	7,883.01	-
减:报告期期间基金总赎回份额	23,183,044.94	9,698.73
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	51,891,906.86	31,793.72

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金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

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。

7.2 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实增强收益定期开放债券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)报告期内嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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

嘉实增益宝货币市场基金

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:兴业银行股份有限公司
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