嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1 基金基本情况

基金简称	嘉实富时中国A50ETF联接
基金主代码	004488
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年6月29日
报告期末基金份额总额	57,947,113.70份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金 嘉实富时中国A50ETF联接基金C类基金
下属分级基金的交易代码	004488 006229
报告期末下属分级基金的份额总额	55,176,073.07份 2,771,040.63份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年7月3日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017年8月7日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制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股票市场相似的风险收益特征。

§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)
	嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金	嘉实富时中国A50ETF联接基金C类基金
1.本期已实现收益	-837,373.91	-45,169.74
2.本期利润	1,518,379.72	65,924.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0293	0.0206
4.期末基金资产净值	55,637,905.88	2,517,404.03
5.期末基金份额净值	1.0084	0.9085

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)自2018年2月5日起对本基金增加C类基金份额类别;自2018年2月5日起开放嘉实富时中国A50ETF联接C的申赎业务;(4)嘉实富时中国A50ETF联接A收取认(申)购费和赎回费,嘉实富时中国A50ETF联接C不收取认(申)购费但收取赎回费、计提销售服务费。

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

嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金

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	3.25%	1.41%	2.40%	1.42%	0.85%	-0.01%

嘉实富时中国A50ETF联接基金C类基金

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	3.24%	1.41%	2.40%	1.42%	0.84%	-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

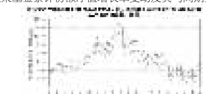


图1:嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年6月29日至2018年9月30日)

图2:嘉实富时中国A50ETF联接基金C类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

(2018年2月22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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中关村A股ETF、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2017年6月29日	-	13年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2017年6月29日	-	12年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)基金经理的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、《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.07%,年化跟踪误差为1.06%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金基金份额净值为1.0084元,本报告期基金份额净值增长率为3.25%;截至本报告期末嘉实富时中国A50ETF联接基金C类基金基金份额净值为0.9085元,本报告期基金份额净值增长率为3.24%;业绩比较基准收益率为2.40%。

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	1,281,976.20	2.17
	其中:股票	1,281,976.20	2.17
2	基金投资	53,653,133.16	90.86
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	3,721,110.40	6.30
8	其他资产	392,914.13	0.67
9	合计	59,049,133.89	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	-	-
B	采矿业	37,370.00	0.06
C	制造业	398,293.00	0.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,380.00	0.03
E	建筑业	37,102.80	0.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,328.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,140.00	0.02
J	金融业	688,295.20	1.18
K	房地产业	74,430.00	0.13
L	租赁和商务服务业	14,637.20	0.03
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	1,281,976.20	2.20

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	601318	中国平安	2,400	164,400.00	0.28
2	600036	招商银行	3,000	92,070.00	0.16
3	600519	贵州茅台	100	73,000.00	0.13
4	000333	美的集团	1,700	68,510.00	0.12
5	601166	兴业银行	3,500	55,825.00	0.10
6	600016	民生银行	7,000	44,380.00	0.08
7	000651	格力电器	1,100	44,220.00	0.08
8	000002	万科A	1,700	41,310.00	0.07
9	600000	浦发银行	3,660	38,869.20	0.07
10	601288	农业银行	8,900	34,621.00	0.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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

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 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实富时中国A50ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	53,653,133.16	92.26

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

(1)2018年1月19日,上海浦东发展银行股份有限公司发布《上海浦东发展银行股份有限公司关于成都分行行政处罚事项公告》,公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书(川银监罚决字【2018】2号),对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46,175万元人民币。 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)4号),对上海浦东发展银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,通过资管计划投资分行协议存款、虚增一般存款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。2018年8月1日,中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号,于2018年7月26日作出行政处罚决定,对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,处以50万元罚款;未按照规定保存客户身份资料和交易记录,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(二)项规定,处以30万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以50万元罚款;存在与身份不明的客户进行交易的行为,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(四)项规定,处以40万元罚款;对浦发银行合计处以170万元罚款,并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项、第(二)项、第(三)项和第(四)项规定,对相关责任人共处以18万元罚款。

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。

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(银保监银罚决字(2018)1号),对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产等违规事实,于2018年4月19日作出行政处罚决定,罚款5870万元。

2018年3月16日,中国人民银行发布银支付罚决字【2018】1号,对中国民生银行股份有限公司厦门分行(新兴支付清算中心),违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,于2018年3月14日作出行政处罚决定,给予警告,没收违法所得48,418,193.27元,并处罚款114,639,752.47元,合计处罚金额163,057,945.74元。

本基金投资于“浦发银行(600000)”、“招商银行(600036)”、“兴业银行(601166)”、“民生银行(600016)”的决策程序说明:本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,浦发银行、招商银行、兴业银行、民生银行为标的指数的成份股,本基金投资于“浦发银行”、“招商银行”、“兴业银行”、“民生银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他六名证券发行主体无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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,217.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	658.86
5	应收申购款	373,037.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	392,914.13

5.12.4 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。

5.12.5 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	000333	美的集团	68,510.00	0.12	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实富时中国A50ETF联接基金A类基金	嘉实富时中国A50ETF联接基金C类基金
报告期期初基金份额总额	45,028,858.01	2,917,152.63
报告期期间基金总申购份额	18,778,180.50	12,920,233.24
减:报告期期间基金总赎回份额	8,630,965.44	13,066,345.24
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	55,176,073.07	2,771,040.63

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)中国证监会准予嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复文件;

(2)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;

(3)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

(4)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金联接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

嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

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

基金简称	嘉实富时中国A50ETF
场内简称	富时A50
基金主代码	512550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年7月3日
报告期末基金份额总额	84,905,968.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制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股票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	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	-2,823,512.59
2.本期利润	2,849,571.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0346
4.期末基金资产净值	86,701,820.64
5.期末基金份额净值	1.0212

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	3.73%	1.50%	2.49%	1.49%	1.24%	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

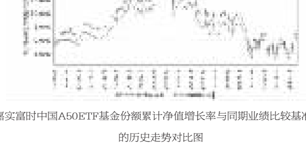


图:嘉实富时中国A50ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年7月3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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中关村A股ETF、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实创业板ETF联接、嘉实创业板ETF基金经理	2017年7月3日	-	13年	曾任职于中国台湾台育证券,中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实创业板ETF基金经理	2017年7月3日	-	12年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部,指数投资部,现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)基金经理的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、《嘉实富时中国A50交易型开放式指数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

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.06%,年化跟踪误差为0.96%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争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

截至本报告期末本基金份额净值为1.0212元;本报告期基金份额净值增长率为3.73%,业绩比较基准收益率为2.49%。

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	86,174,972.10	98.93
	其中:股票	86,174,972.10	98.93
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	689,028.87	0.79
8	其他资产	247,010.71	0.28
9	合计	87,111,011.68	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	-	-
B	采矿业	2,513,121.00	2.90
C	制造业	25,980,125.00	29.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,120,392.00	1.29
E	建筑业	2,594,457.00	2.99
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	805,729.00	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	911,690.00	1.05
J	金融业	46,447,071.50	53.57
K	房地产业	4,813,865.00	5.55
L	租赁和商务服务业	988,521.60	1.14
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	86,174,972.10	99.39

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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

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	601318	中国平安	159,017	10,892,664.50	12.56
2	600036	招商银行	200,597	6,156,321.93	7.10
3	600519	贵州茅台	7,600	5,548,000.00	6.40
4	601166	兴业银行	239,300	3,816,835.00	4.40
5	600016	民生银行	477,540	3,027,603.60	3.49
6	000651	格力电器	73,500	2,954,700.00	3.41
7	000333	美的集团	67,400	2,716,220.00	3.13
8	000002	万科A	111,700	2,714,310.00	3.13
9	600000	浦发银行	248,400	2,638,008.00	3.04
10	601288	农业银行	661,400	2,572,846.00	2.97

注:本基金采取完全复制法,完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合。

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

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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

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 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。

(1)2018年1月19日,上海浦东发展银行股份有限公司发布《上海浦东发展银行股份有限公司关于成都分行行政处罚事项公告》,公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书(川银监罚决字【2018】2号),对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46,175万元人民币。 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)4号),对上海浦东发展银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,通过资管计划投资分行协议存款、虚增一般存款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。2018年8月1日,中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号,于2018年7月26日作出行政处罚决定,对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,处以50万元罚款;未按照规定保存客户身份资料和交易记录,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(二)项规定,处以30万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以50万元罚款;存在与身份不明的客户进行交易的行为,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(四)项规定,处以40万元罚款;对浦发银行合计处以170万元罚款,并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项、第(二)项、第(三)项和第(四)项规定,对相关责任人共处以18万元罚款。

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。

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(银保监银罚决字(2018)1号),对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产等违规事实,于2018年4月19日作出行政处罚决定,罚款5870万元。

2018年3月16日,中国人民银行发布银支付罚决字【2018】1号,对中国民生银行股份有限公司厦门分行(新兴支付清算中心),违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,于2018年3月14日作出行政处罚决定,给予警告,没收违法所得48,418,193.27元,并处罚款114,639,752.47元,合计处罚金额163,057,945.74元。

本基金投资于“浦发银行(600000)”、“招商银行(600036)”、“兴业银行(601166)”、“民生银行(600016)”的决策程序说明:本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,浦发银行、招商银行、兴业银行、民生银行为标的指数的成份股,本基金投资于“浦发银行”、“招商银行”、“兴业银行”、“民生银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他六名证券发行主体无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。

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	6,302.84
2	应收证券清算款	240,575.12
3	应收股利	-
4	应收利息	132.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,010.71

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

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

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	000333	美的集团	2,716,220.00	3.13	重大事项停牌

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

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	78,905,968.00
报告期期间基金总申购份额	42,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	36,000,000.00
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	84,905,968.00

§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 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	
	序号	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2018/07/01至2018/09/30	42,891,300.00	40,000,000.00	30,352,000.00	52,539,300.00	61.88

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)中国证监会准予嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实富时中国A50交易型开放式指数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)报告期内嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资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

嘉实定期宝6个月理财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: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	嘉实定期宝6个月理财债券
基金主代码	003880
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月23日
报告期末基金份额总额	3,778,721,431.20份
投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金通过对各类资产综合判断,决定各类资产的配置比例并适时进行动态调整。在期限配置上,根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均期限。在个券选择方面,本基金综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。同时,通过分析短期市场机会,积极利用市场机会获得超额收益,控制基金组合风险,谋求组合收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的 6 个月定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为理财债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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	嘉实定期宝6个月理财债券A 嘉实定期宝6个月理财债券B
下属分级基金的交易代码	003880 003881
报告期末下属分级基金的份额总额	31,574,372.50份 3,747,147,058.70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)	
	嘉实定期宝6个月理财债券A	嘉实定期宝6个月理财债券B
1.本期已实现收益	574,568.93	44,633,340.30
2.本期利润	574,568.93	44,633,340.30
3.期末基金资产净值	31,574,372.50	3,747,147,058.70

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)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(3) 嘉实定期宝6个月理财债券A与嘉实定期宝6个月理财债券B适用不同的销售服务费率;(4)本基金收益在基金份额 “6 个月持有期到期日” 集中结转为基金份额。

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

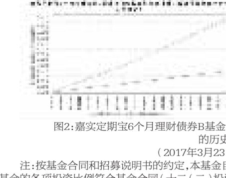
嘉实定期宝6个月理财债券A

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	1.1558%	0.0041%	0.3261%	0.0000%	0.8297%	0.0041%

嘉实定期宝6个月理财债券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	1.2040%	0.0041%	0.3261%	0.0000%	0.8779%	0.0041%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



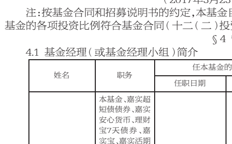


图2:嘉实定期宝6个月理财债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月23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、嘉实安心货币、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、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2017年5月25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。
李曈	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实现金添利货币基金经理	2017年5月25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、嘉实安心货币、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、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币基金经理	2017年3月23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部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)基金经理张文玥的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理李金灿、李曈的任职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、《嘉实定期宝6个月理财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

本报告期嘉实定期宝6个月理财债券A的基金份额净值收益率为1.1558%,嘉实定期宝6个月理财债券B的基金份额净值收益率为1.2040%,业绩比较基准收益率为0.3261%。

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	1,909,151,653.97	49.44
	其中:债券	1,909,151,653.97	49.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	32,400,162.75	0.84
	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	1,857,947,041.03	48.11
4	其他资产	62,032,942.96	1.61
5	合计	3,861,531,800.71	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	12.09	
	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	49,999,805.00	1.32
	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	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	178
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	112

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过180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	18.41	1.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	3.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	54.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.55	1.43

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	659,444,006.23	17.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	501,473,206.08	13.27
	其中:政策性金融债	501,473,206.08	13.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	748,234,441.66	19.80
8	其他	-	-
9	合计	1,909,151,653.97	50.52
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	189935	18贴现国债35	3,600,000	359,435,825.19	9.51
2	180209	18国开09	3,000,000	300,491,448.49	7.95
3	130023	13附息国债23	2,000,000	200,440,647.93	5.30
4	111815485	18民生银行CD485	2,000,000	195,082,569.51	5.16
5	111893578	18杭州银行CD018	1,500,000	146,735,899.40	3.88
6	180407	18农发07	1,000,000	100,455,037.52	2.66
7	111898971	18厦门国际银行CD124	1,000,000	96,866,586.40	2.56
8	111899536	18中原银行CD138	1,000,000	96,755,865.39	2.56
8	111821216	18渤海银行CD216	1,000,000	96,755,865.39	2.56
10	180404	18农发04	800,000	80,431,663.59	2.13

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	10
报告期内偏离度的最高值	0.3537%
报告期内偏离度的最低值	0.0823%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1938%

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	62,032,942.96
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	62,032,942.96

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实定期宝6个月理财债券A	嘉实定期宝6个月理财债券B
报告期期初基金份额总额	50,528,881.09	3,688,044,632.31
报告期期间基金总申购份额	635,894.42	59,102,426.39
报告期期间基金总赎回份额	19,590,403.01	-
报告期期末基金份额总额	31,574,372.50	3,747,147,058.70

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投。

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实定期宝6个月理财债券型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实定期宝6个月理财债券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)报告期内嘉实定期宝6个月理财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