

嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

三季度外部环境不断恶化,贸易战持续升级、美元指数走强,权益市场风险偏好显著降低。

报告期内,组合增配中短期中长期高等级信用债以提高组合静态和组合久期,维持中等杠杆水平,同时基金通过利率波段交易增厚收益,股票部分维持中低位仓位。

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1.069元;本报告期基金份额净值增长率为0.66%,业绩比较基准收益率为-0.39%。 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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists assets like 权益投资, 债券投资, 货币市场基金, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元). Lists industry investments like 农林牧渔, 医药, 食品饮料, etc.

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists top 10 stock holdings.

注:报告期末,本基金仅持有上述7只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists bond investments like 国债, 央行票据, 金融债, etc.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists top 5 bond holdings.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元). Lists top 10 asset-backed securities.

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(银保监罚决字(2018)11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严重问题,予以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3,024.74万元,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定。 (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未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

基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中国民生银行股份有限公司 报告送出日期:2018年10月26日

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法律责任。

基金托管人中国民生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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2016年3月14日至2018年9月30日)

注:按基金合同及招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票A基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票C基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票B基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票型证券投资基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票型证券投资基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票型证券投资基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图:嘉实新能源新材料股票型证券投资基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比走势图(2017年3月16日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书约定,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)投资范围和(四)投资限制的有关约定。

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

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法律责任。

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。

本报告期内,本基金未发生审计。 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

Table with 2 columns: 基金名称, 嘉实新能源新材料股票型证券投资基金. Lists fund details like 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日. Lists financial metrics like 1.本期投资收益, 2.本期利润, etc.

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