嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年03月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2018年9月27日(基金合同生效日)起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实新添康定期混合	
基金主代码	005603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年9月27日	
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	
报告期末基金份额总额	213,181,446.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实新添康定期混合A	嘉实新添康定期混合C
下属分级基金的交易代码	005603	005604
报告期末下属分级基金的份额总额	207,223,506.37份	5,957,939.63份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合财富指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年09月27日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	嘉实新添康定期混合A	嘉实新添康定期混合C
本期已实现收益	1,154,823.45	23,841.74
本期利润	1,768,524.97	41,471.83
加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0070
本期加权平均净值利润率	0.85%	0.69%
本期基金份额净值增长率	0.85%	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	
期末可供分配利润	1,154,823.45	23,841.74
期末可供分配基金份额利润	0.0056	0.0040
期末基金资产净值	208,992,031.34	5,999,411.46
期末基金份额净值	1.0085	1.0070
3.1.3 累计期末指标	2018年末	
基金份额累计净值增长率	0.85%	0.70%

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;(2)嘉实新添康定期混合A收取认(申)购费用和赎回费,嘉实新添康定期混合C从本类基金资产中计提销售服务费,不收取认(申)购费用但收取赎回费;(3)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;(4)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。(5)本基金合同生效日为2018年9月27日,本报告期自2018年9月27日起至2018年12月31日止。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

嘉实新添康定期混合A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.84%	0.05%	-4.99%	0.81%	5.83%	-0.76%
自基金合同生效起至今	0.85%	0.05%	-4.63%	0.80%	5.48%	-0.75%

嘉实新添康定期混合C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.69%	0.05%	-4.99%	0.81%	5.68%	-0.76%
自基金合同生效起至今	0.70%	0.05%	-4.63%	0.80%	5.33%	-0.75%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合财富指数收益率×50%

沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子,每日计算债券市场整体表现,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=50%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+50%*(中债综合财富指数(t)/ 中债综合财富指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))*Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,…。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

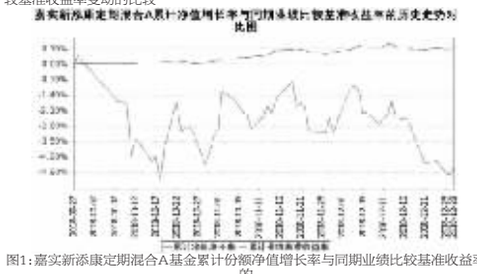


图1:嘉实新添康定期混合A基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年9月27日至2018年12月31日)

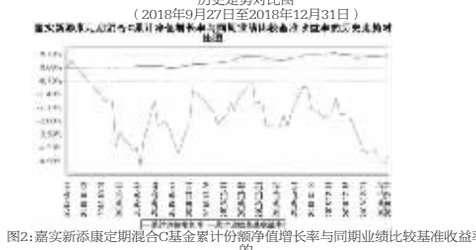
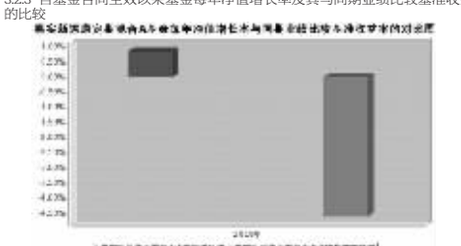
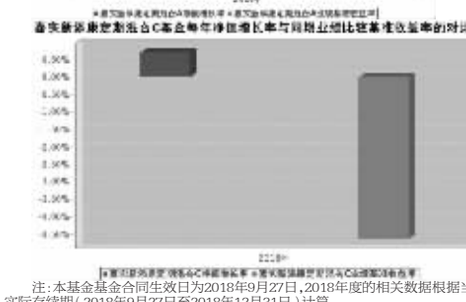


图2:嘉实新添康定期混合C基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年9月27日至2018年12月31日)

注:本基金基金合同生效日2018年9月27日至报告期末未满1年。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,本报告期处于建仓期内。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金基金合同生效日为2018年9月27日,2018年度的相关数据根据当年实际存续期(2018年9月27日至2018年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII,特定资产管理业务资格。

截止2018年12月31日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、144只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数(QDII)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实新金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、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3个月理财债券A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快钱货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实如意宝定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新任选混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳荣债券、嘉实新添瑞混合、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实致盈债券基金经理	2018年9月27日	-	14年	经济学硕士,2004年5月加入嘉实基金管理有限公司。在公司多个业务部门工作,2005年开始从事投资相关工作,曾任债券专职交易员、市场部合规专员、基金组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。

注:(1)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 管理人对报告期内本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、《嘉实新添康定期开放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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照监监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《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;对投资交易行为进行监察稽核,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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12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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年是在对外贸易战、对内去杠杆两条主线交叉作用下变化最快的一年,资本市场从年初对权益的追捧、对金融监管对债市的强烈看空转换到经济下行压力大、风险偏好下行明显带来的权益市场深度调整而债市一枝独秀。

年初市场对全球通胀、加息预期走强以及监管加码担忧较强,资金面宽松程度超预期;之后伴随监管政策并未落地、中美贸易战风波、节后复工偏缓和大宗商品下跌、地方政府债务清理等引发基本面预期的进一步下行;二季度国内信用环境不断恶化、信用传导不畅,信用风险上升,内外双重压力下政策层面较上半年有明显转向,8-9月,在宽信用政策不断出台但收效不佳的情况下,财政政策继续发力,重点在于加快地方债发行、以及推进减税降费等,政策面出现放松;中美贸易摩擦一波三折,对市场影响明显,对经济影响逐步体现,叠加国内基本面下行态势明显,政府稳增长诉求上升,降准、创设TMLF、推出风险缓释工具等稳定民企预期、维持资金面宽松的相关政策也在不断出台。

债券市场年初延续调整半月有余,随后分别在资金面超预期宽松、信用大幅收缩、贸易战、宏观经济预期差从而政策放松等不同时期的主导因素下收益下行,全年仅在地方债供给冲击、通胀预期阶段性提高、资金面可能的收缩(定向正回购)等情况下出现20bp以内的调整。类属上从利率债+高等级信用债为主,拓展到下半年在疏导信用传导机制的情况下信用息差得到一定幅度的修复的行情主线上,同时资金宽松,全年出现了久期、杠杆、适度信用下沉均获得较好收益的情况,债市录得明显正收益。

权益方面,全年股市在诸多利空因素的影响下波动显著变大,投资者风险偏好下降趋势明显,国内A股主要指数均出现了20%以上的下跌,下跌幅度和持续性在A股历史上也极为罕见。纵观全年,除于经济下行对上市公司业绩造成的负面影响外,风险偏好的急剧下降很大程度上持续压制股票市场的估值,使得市场承受业绩与估值的双重压力。从内部的结构上看,全年市场热点切换较快,市场风格缺少持续的主线,同时黑天鹅事件频发,部分行业受产业政策预期的改变也出现了很大的波动。

报告期内本基金成立,且成立时间在三季度末,规模不大,本着稳健投资原则,前期以中短久期中高等级信用债持仓为主获取稳定收益,并积极参与利率债交易,提升组合业绩。股票部分以稳健策略为主,控制仓位,选择安全边际高的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新添康定期混合A基金份额净值为1.0085元,本报告期基金份额净值增长率为0.85%;截至本报告期末嘉实新添康定期混合C基金份额净值为1.0070元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%;业绩比较基准收益率为-4.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济仍在寻底过程中,下行周期尚未结束。但阶段性来看,政策对于宽信用和稳增长的诉求近期在加大:1)2019年地方债将从1月开始提前发行,考验市场承接能力,2)地产新开工加快、基建对冲加大,一定程度上对冲年初出口快速下滑的拖累;3)社融和M1在一季度或边际企稳,对风险偏好起到一定提振作用。总体看,经济下行进入深水区,逆周期调控加码,未来一个阶段宏观环境进入宽货币+宽信用的组合。

债券市场趋势暂不改变,但由于绝对收益较低同时政策托底逐步累积,债市下行空间有限,风险收益比有所下降,同时债市结构发生变化,信用利差有望进一步压缩,曲线阶段性陡峭化,市场波动可能有所加大。中期来看,基本面下行过程中利率中枢仍是震荡下移的过程。居民加杠杆乏力依然是影响趋势所在,也是下行超预期的风险。利率中期内不改变方向。

权益市场方面,随着政策托底手段的逐步到位,之前过于悲观的市场情绪得到一定修复,并改变过去半年市场单边下跌的态势,在未来一段时间内将震荡波动,阶段性的风险偏好改善和流动性回升,对市场情绪起到稳定作用,趋势性的大行情可能较难见到。展望未来,在经济衰退、流动性宽松和外资持续流入的市场环境下,市场风格将更加均衡,主题更为活跃,自下而上的投资机会大概率多于2018年,并提供更好的投资标的。

本基金将继续本着稳健投资的原则,平衡类属配置,纯债部分维持中短久期中高等级信用债为核心的持仓结构,利率债择机调降久期,股票部分维持个股精选,选股思路仍以高安全边际为主,考虑下行风险较小,估值合理的个股,积极参与股票IPO、可转债打新。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同(十六(三)基金收益分配原则)约定,报告期内本基金未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师薛竞、张勇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2019)第22751号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	219,216.29
结算备付金		2,398,830.75
存出保证金		17,957.91
交易性金融资产	7.4.7.2	285,616,019.40
其中:股票投资		5,435,384.00
基金投资		-
债券投资		280,180,635.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		219,381.51
应收利息	7.4.7.5	3,906,849.14
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		292,378,255.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		76,999,755.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		145,915.91
应付托管费		27,359.24
应付销售服务费		3,054.67
应付交易费用	7.4.7.7	9,792.82
应交税费		12,976.80
应付利息		52,957.76
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	135,000.00
负债合计		77,386,812.20
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	213,181,446.00
未分配利润	7.4.7.10	1,809,996.80
所有者权益合计		214,991,442.80
负债和所有者权益总计		292,378,255.00

注:本基金合同生效日为2018年9月27日,本报告期自基金合同生效日2018年9月27日起至2018年12月31日止。报告截止日2018年12月31日,嘉实新添康定期混合A基金份额净值1.0085元,基金份额总额207,223,506.37份;嘉实新添康定期混合C基金份额净值1.0070元,基金份额总额5,957,939.63份。基金份额总额合计为213,181,446.00份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年9月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年9月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入		2,868,985.88
1.利息收入		2,126,922.66
其中:存款利息收入	7.4.7.11	306,138.38
债券利息收入		1,732,629.25
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		88,155.03
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		110,731.61
其中:股票投资收益	7.4.7.12	36,215.24
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	74,516.37
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	631,331.61
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-
减:二、费用		1,058,989.08
1.管理人报酬		445,656.87
2.托管费		83,560.67
3.销售服务费		9,334.32
4.交易费用	7.4.7.18	9,218.86
5.利息支出		368,150.06
其中:卖出回购金融资产支出		368,150.06
6.税金及附加		3,166.26
7.其他费用	7.4.7.19	139,902.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,809,996.80
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,809,996.80

注:本基金合同生效日为2018年09月27日,本期是指2018年09月27日至2018年12月31日,无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年9月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	213,181,446.00	-	213,181,446.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,809,996.80	1,809,996.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	213,181,446.00	1,809,996.80	214,991,442.80

注:本基金合同生效日为2018年09月27日,本期是指2018年09月27日至2018年12月31日,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:		
经雷	王红	公充	
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人	

7.4 报表附注

7.4.1 重要会计政策和会计估计

7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年9月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本