

嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司
送出日期：2019年03月26日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通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基金更新。

本报告期自2018年1月1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。

2.1 基金简介

2.1.1 基金基本情况

基金名称	嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实丰益策略定期开放债券
基金代码	000103
运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月30日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金总份额	101,686,566.04份
报告期末存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争当期总回报超越业绩比较基准并实现长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，通过分散化投资，力争实现当期总回报超越业绩比较基准并实现长期增值。
业绩比较基准	一年期定期存款利率（税后）+0.35%
风险收益特征	本基金为债券基金，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。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
姓名	胡欣	胡欣
联系电话	010-65051588	010-65051588
电子邮箱	service@jia.com	service@jia.com
客户服务电话	400-600-8800	400-600-8800
传真	010-65051588	021-62701216

2.4 信息披露方式

本基金年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.jsfund.com>

基金年度报告备置地点：北京市西城区大街1号嘉实大厦10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

项目	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	2,930,501.08	20,321,062.37	7,659,966.03
本期利润	3,417,319.01	29,102,574.27	-4,061,831.51
加权平均基金份额净值增长率	0.0394	0.0312	-0.0764
本期基金份额净值增长率	3.97%	3.10%	-1.62%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	3.76%	0.00%	3.83%

3.2 基金净值表现

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.3 基金业绩比较基准

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申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）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。

3.4 基金净值表现

3.4.1 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.2 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.3 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.4 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.5 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.6 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.7 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.8 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.9 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.10 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.11 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.12 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.13 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.14 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.15 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.16 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.17 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.18 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.19 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.20 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.21 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.22 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.23 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.24 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款利率（税后）+0.30%。

3.4.25 基金净值表现增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率与基金份额净值增长率之差
过去三个月	0.08%	0.06%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.06%	1.01%
过去一年	3.76%	0.11%	2.02%
过去三年	7.62%	0.12%	6.01%
过去五年	29.58%	0.18%	12.86%
自基金合同生效以来	30.88%	0.17%	14.55%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.05%+0.30%一年期银行定期存款