

信息披露

Disclosure

嘉实安益灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

市场对于宽松政策的预期得到一定修复。

权益市场方面,7月在实体经济存流动性宽松预期下,周期股和创业板有较佳表现;3季度后随随期中报披露,前期市场集中追捧的板块有所调整,但业绩确定性较强的蓝筹白马,以及5G、新能源汽车等主题仍有不俗表现。

报告期内,本基金本着稳健投资原则,在风险和收益之间进行平衡,在获取绝对回报为主的前提下,积极参与股票打新并可转债打新,大类资产配置上以存单和高等级信用债投资为主,维持组合较低杠杆和较低久期,目下而上精选信用债。

截至本报告期末,本基金份额净值为1.046元;本报告期基金份额净值增长率为1.75%,业绩比较基准收益率为2.49%。

4.6 报告期内本基金持有人人数或基金资产净值预警说明

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	127,472,679.34	10.16
2	其中:股票	127,472,679.34	10.16
3	固定收益投资	1,099,526,123.90	84.44
4	其中:债券	1,099,526,123.90	84.44
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	42,928,424.39	3.42
8	其中:买断式回购	-	-
9	其他资产	5,295,087.84	0.42
10	其他资产	1,254,775,062.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	50,738,956.87	4.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	7,379,968.03	0.59
J	金融业	40,196,738.00	3.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,191,807.00	1.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,714,469.00	0.86
O	医药制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
合计		127,472,679.34	10.17

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	601398	工商银行	4,584,700	27,588,200.00	2.20
2	600104	上汽集团	833,878	25,174,776.82	2.01
3	002027	分众传媒	1,810,140	18,191,907.00	1.45
4	300124	汇川技术	609,900	17,626,110.00	1.41
5	601288	农业银行	3,305,900	12,628,538.00	1.01
6	300070	碧水源	594,300	10,714,469.00	0.86
7	300030	阿特斯	117,800	7,382,600.00	0.59
8	000858	五洲药业	128,000	7,331,840.00	0.58
9	603882	金麒麟	2,763	115,299.99	0.01
10	603106	恒顺醋业	2,786	84,025.76	0.01

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	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	144,740,642.40	11.55
4	其中:政策性金融债	144,738,619.60	11.55
5	企业债券	117,347,491.50	9.36
6	中期票据	330,297,000.00	26.54
7	资产支持证券	-	-
8	其他	328,825,000.00	26.07
9	合计	1,059,526,123.90	84.52

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	160206	16国债06	600,000	57,600,000.00	4.59
2	11179752	17广发转债 CD074	400,000	38,628,000.00	3.08
3	101456023	14晋交债 MTN0016(半年)	300,000	30,801,000.00	2.46
4	101330037	15民生 MTN002	300,000	30,489,000.00	2.43
5	1282421	13国债转债 MTN2	300,000	30,384,000.00	2.42

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 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

5.12 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.13 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.14 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.15 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.16 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.17 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.18 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.19 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.20 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.21 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.22 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.23 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.24 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.25 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.26 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.27 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.28 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.29 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.30 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.31 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.32 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.33 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.34 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.35 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.36 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.37 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.38 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.39 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.40 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.41 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.42 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.43 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.44 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.45 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.46 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.47 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.48 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.49 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.50 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.51 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.52 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.53 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.54 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.55 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.56 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.57 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.58 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.59 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.60 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.61 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.62 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.63 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.64 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.65 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.66 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.67 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.68 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.69 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.70 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.71 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.72 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.73 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.74 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.75 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.76 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.77 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.78 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.79 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.80 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.81 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.82 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.83 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.84 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.85 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.86 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.87 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.88 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.89 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.90 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.91 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.92 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.93 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.94 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.95 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.96 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.97 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.98 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.99 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.100 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.101 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.102 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.103 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.104 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.105 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.106 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.107 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.108 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.109 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.110 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.111 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.112 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.113 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.114 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.115 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.116 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.117 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.118 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.119 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.120 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.121 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.122 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.123 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.124 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.125 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.126 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.127 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.128 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.129 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.130 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.131 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.132 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.133 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.134 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.135 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.136 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.137 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.138 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.139 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.140 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.141 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.142 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.143 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形

5.144 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体是否受到公开谴责、处罚的情形