

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25日

基金管理人的董事、监事和高级管理人员不存在虚假记载、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2017年10月20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,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人有风险,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。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金份额

嘉实安益灵活配置混合型证券投资基金

基金代码:003187

类别:契约型开放式

基金合同生效日:2016年8月25日

报告期末基金份额总额:1,198,261,020.18份

投资目标

在严格控制组合风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值回报。

基金的运作方式

契约型开放式

基金合同生效日:2016年8月25日

报告期末基金份额总额:1,198,261,020.18份

投资策略

本基金通过宏观经济、行业及区域政策、货币市场与资金面、国际资本流动、其他影响短期资金供求关系等的分析,判断大类资产配置比例;通过深入分析宏观经济、行业政策、资金面和利率变化趋势以及不同类型的收益率水平、流动性风险和预期收益等因素,以久期匹配和结构分层策略为主,以收益为辅,并结合低杠杠和较低久期,自下而上精选信用债。

报告期末基金份额总额:1,198,261,020.18份

业绩比较基准

沪深300指数收益率*50%+中债国债收益率*50%

风险收益特征

本基金为混合型基金,风险收益特征介于股票型基金与货币市场基金、低风险收益特征的债券型基金之间,属于“风险收益特征为中等”的基金品种。

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

报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)

1.本期已实现收益 13,755,268.39

2.本期利润 21,289,699.02

3.加权平均基金份额本期利润 0.0178

4.期末可供分配基金份额净值 1,253,617,320.00

5.期末基金资产净值 1,046

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,计费费用以实际发生的为准,从而影响本期业绩表现。

3.2 自基金成立以来至报告期末总回报情况

3.2.1 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.2 自基金成立以来至报告期末总回报情况

3.2.3 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.4 自基金成立以来至报告期末总回报情况

3.2.5 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.6 自基金成立以来至报告期末总回报情况

3.2.7 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.8 自基金成立以来至报告期末总回报情况

3.2.9 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.10 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.11 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.12 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.13 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.14 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.15 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.16 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.17 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.18 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.19 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.20 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.21 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.22 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.23 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.24 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.25 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.26 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.27 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.28 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.29 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.30 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.31 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%

3.2.32 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.24% 0.29% -0.74% -0.22%