

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:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年10月25日  
§ 1重要提示  
基金管理人的董事及董事会、监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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人  
中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，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。投资者有风险，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。

本报告财务数据未经审计。

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

4.1基金管理人或基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
吴国峰	本基金基金经理	2017年3月20日	9年	曾任中国金融租赁有限公司资产管理部研究员，泰康人寿保险股份有限公司资产管理部研究员，2012年2月加入本基金基金管理人，现担任本基金基金经理。吴国峰先生具有基金从业资格，中国国籍。

注:①)基金管理人任职日期是指本基金基金合同生效之日起;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投资人对报告期内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》、《证券投资基金管理法》及其各项配套法规、《嘉实丰和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取最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》及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；通过完善交易系统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；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.4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，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%，合计1次，为旗下组合被动跟踪标的的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.5公平交易策略说明

在3季度当中，上证综指上涨4.9%，沪深300指数上涨4.63%，中小板指数上涨8.86%，创业板指数2.69%。经历了2季度的金融去杠杆之后，整体金融市场的流动性有所恢复，加上宏观经济指标向好，市场出现了较大的底部上涨。具体板块来看，有色、煤炭、钢铁涨幅靠前，电力、纺织、传媒等板块跌幅靠前。宏观经济经历了2季度的去库存后，再次进入库存阶段，环保、供给侧改革带来的产能去化，上游周期品在3季度再次出现较大幅度的产品价格上涨，因此3季度当中上游资源品涨幅较大。受到人民币升值带来的汇兑损益影响导致部分权重股业绩低于预期，传媒板块在3季度当中表现较差。

本基金在3季度集中配置的电解铝、钴、保险、新能源汽车等板块都获得了不错的收

益，嘉实丰和灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率

4.6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股票投资明细

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

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债券投资明细

5.4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贵金属投资明细

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十名股票投资明细

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债券投资明细

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十名贵金属投资明细

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十名权证及金融衍生品投资明细

5.9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

5.10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保险及赔款投资明细

5.11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组合

5.12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债券投资组合

5.13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贵金属投资组合

5.14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权证及金融衍生品投资组合

5.15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组合

5.16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保险及赔款投资组合

5.17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组合

5.18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债券投资组合

5.19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贵金属投资组合

5.20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权证及金融衍生品投资组合

5.21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组合

5.22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保险及赔款投资组合

5.23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组合

5.24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债券投资组合

5.25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贵金属投资组合

5.26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权证及金融衍生品投资组合

5.27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组合

5.28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保险及赔款投资组合

5.29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组合

5.30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债券投资组合

5.31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贵金属投资组合

5.32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权证及金融衍生品投资组合

5.33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组合

5.34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保险及赔款投资组合

5.35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组合

5.36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债券投资组合

5.37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贵金属投资组合

5.38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权证及金融衍生品投资组合

5.39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组合

5.40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保险及赔款投资组合

5.41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组合

5.42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债券投资组合

5.43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贵金属投资组合

5.44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权证及金融衍生品投资组合

5.45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组合

5.46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保险及赔款投资组合

5.47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组合

5.48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债券投资组合

5.49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贵金属投资组合

5.50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权证及金融衍生品投资组合

5.51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组合

5.52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保险及赔款投资组合

5.53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组合

5.54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债券投资组合

5.55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贵金属投资组合

5.56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权证及金融衍生品投资组合

5.57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组合

5.58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保险及赔款投资组合

5.59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组合

5.60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债券投资组合

5.61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贵金属投资组合

5.62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权证及金融衍生品投资组合

5.63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组合

5.64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保险及赔款投资组合

5.65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组合

5.66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债券投资组合

5.67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贵金属投资组合

5.68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权证及金融衍生品投资组合

5.69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组合

5.70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保险及赔款投资组合

5.71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组合

5.72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债券投资组合

5.73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贵金属投资组合

5.74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权证及金融衍生品投资组合

5.75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组合

5.76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保险及赔款投资组合

5.77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组合

5.78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债券投资组合

5.79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贵金属投资组合

5.80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权证及金融衍生品投资组合

5.81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组合

5.82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保险及赔款投资组合

5.83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组合

5.84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债券投资组合

5.85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贵金属投资组合

5.86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权证及金融衍生品投资组合

5.87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组合

5.88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保险及赔款投资组合

5.89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组合

5.90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债券投资组合

5.91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贵金属投资组合

5.92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权证及金融衍生品投资组合

5.93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组合

5.94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保险及赔款投资组合

5.95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组合

5.96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债券投资组合

5.97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贵金属投资组合

5.98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权证及金融衍生品投资组合

5.99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组合

5.10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保险及赔款投资组合

5.11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组合