

# 嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金

# 2017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:中国工商银行股份有限公司  
送出日期:2018年03月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月23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。

本报告自2017年1月1日起至2017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

基金名称	嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	嘉实新机遇混合发起式
基金代码	004020
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期间	不定期
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产净值	40,010,000,000.00
报告期末基金份额总额	4,000,000,000.00

基金产品说明	本基金为混合型发起式基金,通过在大类资产配置和选择安全证券的方式,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的方式进行资产配置,在控制仓位和保持流动性风险的前提下,通过精选个股,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数+中国债总指数70%
风险收益特征	本基金为混合型发起式基金,风险和收益水平高于货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中风险收益较高的品种。

基金管理人	基金托管人	基金销售人
嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	嘉实基金管理有限公司
名称	名称	名称
注册地址	注册地址	注册地址
办公地址	办公地址	办公地址
客服电话	客服电话	客服电话
网址	网址	网址

基金信息披露方式	基金信息披露方式
基金年度报告摘要刊登在指定网站和指定报刊上,投资者可免费查阅。	基金年度报告摘要刊登在指定网站和指定报刊上,投资者可免费查阅。

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金销售人	嘉实基金管理有限公司
基金注册登记人	嘉实基金管理有限公司
基金审计会计师事务所	普华永道会计师事务所

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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实沪深深精选股票、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、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳安债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增值混合、嘉实新瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实添鑫宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实新添混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳福纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新嘉华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实安添利货币、嘉实原油(ODII-LOF)、嘉实稳洁科技沪深深股票、嘉实稳安纯债债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳纯债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业灵活配置混合、嘉实稳裕混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实安和双债两年定期债券、嘉实新添泽定期混合、嘉实稳悦纯债债券、嘉实稳纯债券、嘉实新添泽定期混合、嘉实领航资产配置混合(POF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康混合、嘉实稳健成长混合、嘉实稳健混合和嘉实安泰3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产管理基金组合。

## 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏巍	基金经理	2016年01月01日	-	10年	2007年12月加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实基金研究员、基金经理助理、基金经理,具有多年基金管理经验。
王茜	基金经理	2016年01月01日	-	10年	曾任嘉实基金研究员、基金经理助理、基金经理,具有多年基金管理经验。

注:(1)基金经理王茜的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理谢泽林的任职日期是指公司作出决定后公告之日;(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 管理人对于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守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》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约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对于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》,按照证监会《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机会,投资建议,并在投资决策委员会的制度化框架下独立决策,实施投资决策时享有平等的机会。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,各投资组合按投资决策制度和流程独立决策,并在获得投资机会、投资建议和实施投资策略方面享有平等的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,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持续监控稽核,通过T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。

### 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19次,均为旗下成交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 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年国内经济稳中向好,GDP实际增速为6.9%,而名义增速达到11.2%,远高于2016年7.9%的名义增速。从2017年三大产业的名义增速来看,第一产业为2.8%,第二产业为12.8%,第三产业为11.4%,工业制造业对GDP的拉动作用显著,2017年国内CPI相对平穩,全年增速为1.6%,而PPI全年增速为6.3%,价格因素对工业的影响显著,全年工业企业的利润总额实现21%的增长,增速创六年来的新高,绝对创历史新高,这是2017年国内经济的亮点之一。

报告期内,公司对于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间向交易员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。

### 4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为旗下成交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。

### 4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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19次,均为