嘉实农业产业股票型证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实农业产业股票
基金主代码	003634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月7日
报告期末基金份额总额	161,447,974.29份
投资目标	本基金通过投资于农业产业中具有长期稳定成长性的上市公司,在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平,本基金所界定的农业产业股票主要是指农林牧渔行业及与其密切相关的上市公司,根据农业产业的范畴选出备选股票池,并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合,同时在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。
业绩比较基准	申万农林牧渔指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,333,995.39
2.本期利润	-13,468,736.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0835
4.期末基金资产净值	138,364,988.90
5.期末基金份额净值	0.8570

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.77%	1.53%	0.73%	1.18%	-9.50%	0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

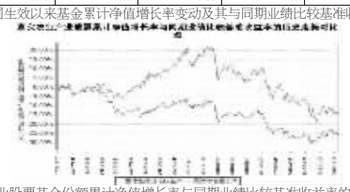

图:嘉实农业产业股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月7日至2018年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚爽	本基金基金经理	2016年12月7日	-	9年	曾任申万菱信(上海)资产管理有限公司农业研究员、嘉实基金管理有限公司农业研究员、嘉实基金管理有限公司农业研究员、现任嘉实基金农业研究员,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实农业产业股票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规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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;通过完善交易范围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。

4.3.2 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3次,均为旗下组合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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内宏观经济经济动能放缓,PMI下降,12月到了49.4降至荣枯线以下;1-11月工业企业利润同比增长11.8%,盈利增速下滑;房地产景气度同样下降;基建投资增速因政策支持出现反弹;消费相对平稳但行业和公司间出现分化;出口短期平稳,预计未来也会因中美贸易摩擦明显放慢。

股票市场因流动性偏紧、信用风险和中美贸易摩擦风险持续的影响,市场表现低迷,A股市场在整体风险偏好下降的环境下继续下行,上证综指下跌10.67%,创业板指下跌10.70%。

农业板块景气度相对而言受宏观的影响较小,国内发生的非洲猪瘟疫情仍在传播,导致生猪的生产和供给出现了收缩,猪、鸡价格表现坚挺。非洲猪瘟的影响可能很深远,未来对养猪产业链的公司竞争力的考验更大,但真正优秀的公司能够穿越行业和疫情的周期更加壮大。

本基金主要着眼于企业的中长期核心竞争力精选个股,主要投资于以下几类机会:1)种业、疫苗、食品、农化等行业的长期龙头公司;2)周期趋势上行的养殖股;3)顺应消费升级方向,需求受中美贸易冲突影响较小的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.8570元;本报告期基金份额净值增长率为-8.77%,业绩比较基准收益率为0.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

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	120,274,775.39	86.56
	其中:股票	120,274,775.39	86.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,753,585.60	4.86
	其中:债券	6,753,585.60	4.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,388,743.76	6.76
8	其他资产	2,525,346.25	1.82
9	合计	138,942,451.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	51,748,675.94	37.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,526,099.45	49.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	120,274,775.39	86.93

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	000998	隆平高科	837,924	12,401,275.20	8.96
2	000895	双汇发展	504,652	11,904,740.68	8.60
3	600887	伊利股份	476,800	10,909,184.00	7.88
4	300498	温氏股份	409,600	10,723,328.00	7.75
5	002299	圣农发展	611,979	10,122,132.66	7.32
6	002746	仙坛股份	723,996	9,904,265.28	7.16
7	600201	生物股份	424,697	7,049,970.20	5.10
8	603566	普莱柯	560,508	6,619,599.48	4.78
9	600872	中炬高新	216,100	6,366,306.00	4.60
10	000876	新希望	856,300	6,233,864.00	4.51

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,753,585.60	4.88
	其中:政策性金融债	6,753,585.60	4.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,753,585.60	4.88

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	018005	国开1701	67,240	6,753,585.60	4.88

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,500.46
2	应收证券清算款	2,204,318.09
3	应收股利	-
4	应收利息	190,014.24
5	应收申购款	105,513.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,525,346.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	168,494,684.27
报告期期间基金总申购份额	9,759,524.58
减:报告期期间基金总赎回份额	16,806,234.56
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	161,447,974.29

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实农业产业股票型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实农业产业股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实农业产业股票型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实农业产业股票型证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实农业产业股票型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

(1)北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

(2)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2019年1月21日

嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

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
报告送出日期:2019年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年1月17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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实研究增强混合
基金主代码	001758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月1日
报告期末基金份额总额	381,068,522.49份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面、资金面和估值等五个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。在股票投资方面,本基金采取自下而上的个股精选策略,以深入的基本面研究为基础,精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票。在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合,同时在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§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

主要财务指标	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-33,291,440.18
2.本期利润	-38,394,896.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0992
4.期末基金资产净值	294,242,598.92
5.期末基金份额净值	0.772

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.37%	1.42%	-5.04%	0.82%	-6.33%	0.60%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实研究增强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的历史走势对比图

(2016年12月1日至2018年12月31日)

注:1:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

2:2018年11月1日,本基金管理人发布《关于嘉实研究增强混合基金经理变更的公告》,增聘张丹华先生担任本基金基金经理职务。陈少平女士不再担任本基金基金经理职务。

3:2018年11月27日,本基金管理人发布《关于新增嘉实研究增强混合基金经理的公告》,增聘张露女士担任本基金基金经理职务,与基金经理张丹华先生共同管理本基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张露	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实研究阿尔法股票基金经理	2018年11月27日	-	6年	2012年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部,从事研究和分析工作,博士,具有基金从业资格。
张丹华	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实互联网股票、嘉实沪港深精选股票、嘉实文体娱乐股票、嘉实沪港深回报混合、嘉实前沿科技沪港深股票基金经理	2018年11月1日	-	7年	2011年4月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员,博士,具有基金从业资格。
陈少平	本基金基金经理	2016年12月1日	2018年11月1日	15年	曾任海问投资咨询公司研究员、泰达宏利基金管理公司研究部总监,基金经理,2014年9月加入嘉实基金管理有限公司,现任策略投资资总监,硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理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》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实研究增强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规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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;通过完善交易范围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。

4.3.2 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3次,均为旗下组合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 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度市场可以说是最有赚钱效应的熊市超跌反弹,也就是长期的A股投资者俗称的"吃饭行情",由于所处经济和盈利的快速下行期、而宽货币向宽信用的改善推进较慢,且市场新增参与资金有限,当前的反弹是显著的风险偏好推动的行情。高层力挺民营经济、鲍援股权质押、乃至于储备中的减税降费手段是这轮行情的前提条件。行业层面,成长行业表现较好,受经济周期下行以及油价下跌的影响银行、煤炭、石油石化、钢铁跌幅较大。

本基金始终坚持以研究部的模拟组合为蓝本构建投资组合,坚持执行自下而上精选个股的投资策略,股票仓位保持在85%以上,行业偏离依照研究员的推荐进行可控范围内的偏移,基于企业内在价值的基础研究的投资模式成为获取超额收益来源的重要方式。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.772元;本报告期基金份额净值增长率为-11.37%,业绩比较基准收益率为-5.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

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	259,918,044.49	88.02
	其中:股票	259,918,044.49	88.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	35,098,840.16	11.89
8	其他资产	270,157.75	0.09
9	合计	295,287,042.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,759,304.00	0.60
B	采矿业	9,565,109.44	3.25
C	制造业	105,850,161.27	35.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,588,490.25	2.92
E	建筑业	6,109,729.00	2.08
F	批发和零售业	8,293,210.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	8,437,917.28	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,814,693.90	3.68
J	金融业	72,943,117.40	24.79
K	房地产业	13,185,894.75	4.48
L	租赁和商务服务业	5,923,157.60	2.01
M	科学研究和技术服务业	2,660,330.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,661,450.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	4,125,479.60	1.40
S	综合	-	-
	合计	259,918,044.49	88.33

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	601336	新华保险	394,840	16,678,041.60	5.67
2	600030	中信证券	761,800	12,196,418.00	4.15
3	600036	招商银行	475,400	11,980,080.00	4.07
4	601939	建设银行	1,245,800	7,935,746.00	2.70
5	601288	农业银行	2,200,700	7,922,520.00	2.69
6	601318	中国平安	112,300	6,300,030.00	2.14
7	601166	兴业银行	333,900	4,988,466.00	1.70
8	000001	平安银行	521,500	4,891,670.00	1.66
9	600519	贵州茅台	7,600	4,484,076.00	1.52
10	601668	中国建筑	704,400	4,015,080.00	1.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

(1)2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕1号),对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产等违规事实,于2018年4月19日作出行政处罚决定,罚款5870万元。

2018年3月16日,中国人民银行发布(银支付)罚字〔2018〕第2号,对平安银行股份有限公司,违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,于2018年3月14日作出行政处罚决定,给予警告,没收违法所得3,036,061.39元,并处罚款10,308,084.15元,合计处罚金额13,344,145.54元。

2018年8月1日,中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号,于2018年7月26日作出行政处罚决定,对平安银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,处以50万元罚款;未按照规定保存客户身份资料和交易记录,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(二)项规定,处以40万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以50万元罚款;对平安银行合计处以140万元罚款,并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项、第(二)项和第(三)项规定,对相关责任人处以处以14万元罚款。

本基金投资于"招商银行(600036)"、"兴业银行(601166)"、"平安银行(000001)"的决策程序说明:基于对招商银行、兴业银行和平安银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"招商银行"、"兴业银行"、"平安银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他七名证券发行主体无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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,852.75
2	应收证券清算款	40,254.27
3	应收股利	-
4	应收利息	7,588.48
5	应收申购款	82,462.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	270,157.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	12,196,418.00	4.15	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	392,684,812.12
报告期期间基金总申购份额	10,749,666.50
减:报告期期间基金总赎回份额	22,365,956.13
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	381,068,522.49

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实研究增强灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2019年1月21日

嘉实增益宝货币市场基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实增益宝货币
基金主代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	7,044,744,495.32份
投资目标	在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金跟踪分析市场资金面变化及投资者交易行为变化,结合宏观和微观研究制定投资策略,谋求在满足安全性、流动性需要的基础上,实现较高的当期收益。
业绩比较基准	按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	81,353,183.46
2.本期利润	81,353,183.46
3.期末基金资产净值	7,044,744,495.32

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6597%	0.0009%	0.0881%	0.0000%	0.5716%	0.0009%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实增益宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月27日至2018年12月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项