

嘉实领航资产配置混合型基金中基金 (FOF) 2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 26 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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实领航资产配置混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	嘉实领航资产配置混合（FOF）	
基金主代码	005156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 10 月 26 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	
报告期末基金份额总额	1,368,666,416.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实领航资产配置混合（FOF）A	嘉实领航资产配置混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	005156	005157
报告期末下属分级基金的份额总额	1,218,969,202.01 份	149,697,214.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以风险为核心进行分散化资产配置，通过风险模型定量调整各类资产比例，审慎甄选基金，综合利用市场结构、投资者行为、资产风险收益特征等研究成果优化基金组合，力争创造优秀稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取风险平价的投资策略，基于产品业绩比较基准确定组合波动、回撤限制目标，根据不同资产的风险特征进行配置，希望使本基金对各类资产的风险暴露保持均衡。投资策略以流动性、资产风险收益特征、市场结构三大类风险信号为基础，专注解决长期收益与短期波动之间的矛盾，根据宏观经济分析和基本面研究精选投资标的，根据风险模型计算资产配置比例，尽可能降低单一资产价格波动对组合的冲击。
业绩比较基准	中证 800 股票指数收益率×20%+中债综合财富指数收益率×70%+Wind 商品综合指数收益率×10%

风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险和收益水平的投资品种。
--------	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	(010)67595096
传真	(010)65215588	(010)66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	报告期(2018年01月01日-2018年 12月31日)		2017年10月26日(基金合同生效日) - 2017年12月31日	
	嘉实领航资产配置 混合(FOF)A	嘉实领航资产配置 混合(FOF)C	嘉实领航资产配置 混合(FOF)A	嘉实领航资产配置 混合(FOF)C
本期已 实现收 益	-61,503,302.45	-9,652,550.83	8,462,130.53	1,172,837.79
本期利 润	-74,621,549.42	-11,305,463.95	9,692,067.99	1,283,611.96
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0493	-0.0580	0.0046	0.0021

本期加权平均净值利润率	-5.06%	-5.98%	0.46%	0.21%
本期基金份额净值增长率	-4.58%	-5.44%	0.47%	0.28%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	-50,326,268.74	-7,760,015.48	8,112,787.46	793,294.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0413	-0.0518	0.0041	0.0022
期末基金资产净值	1,168,642,933.27	141,937,199.06	2,001,422,145.95	366,504,088.11
期末基金份额净值	0.9587	0.9482	1.0047	1.0028
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.13%	-5.18%	0.47%	0.28%

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）嘉实领航资产配置混合（FOF）A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实领航资产配置混合（FOF）C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；（3）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；（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

嘉实领航资产配置混合（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.66%	0.24%	-1.68%	0.37%	1.02%	-0.13%
过去六个月	-0.50%	0.21%	-0.89%	0.32%	0.39%	-0.11%
过去一年	-4.58%	0.26%	-1.08%	0.30%	-3.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-4.13%	0.24%	-1.21%	0.28%	-2.92%	-0.04%

嘉实领航资产配置混合（FOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.86%	0.24%	-1.68%	0.37%	0.82%	-0.13%
过去六个月	-0.91%	0.21%	-0.89%	0.32%	-0.02%	-0.11%
过去一年	-5.44%	0.26%	-1.08%	0.30%	-4.36%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.18%	0.24%	-1.21%	0.28%	-3.97%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 股票指数收益率×20%+中债综合财富指数收益率×70%+Wind 商品综合指数收益率×10%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场 800 只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非

银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

$$\text{Return}(t)=20\%*(\text{中证 800 股票指数}(t)/\text{中证 800 股票指数}(t-1)-1)+70%*(\text{中债综合财富指数}(t)/\text{中债综合财富指数}(t-1)-1)+10%*(\text{Wind 商品综合指数}(t)/\text{Wind 商品综合指数}(t-1)-1)$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t))*\text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实领航资产配置混合（FOF）A 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

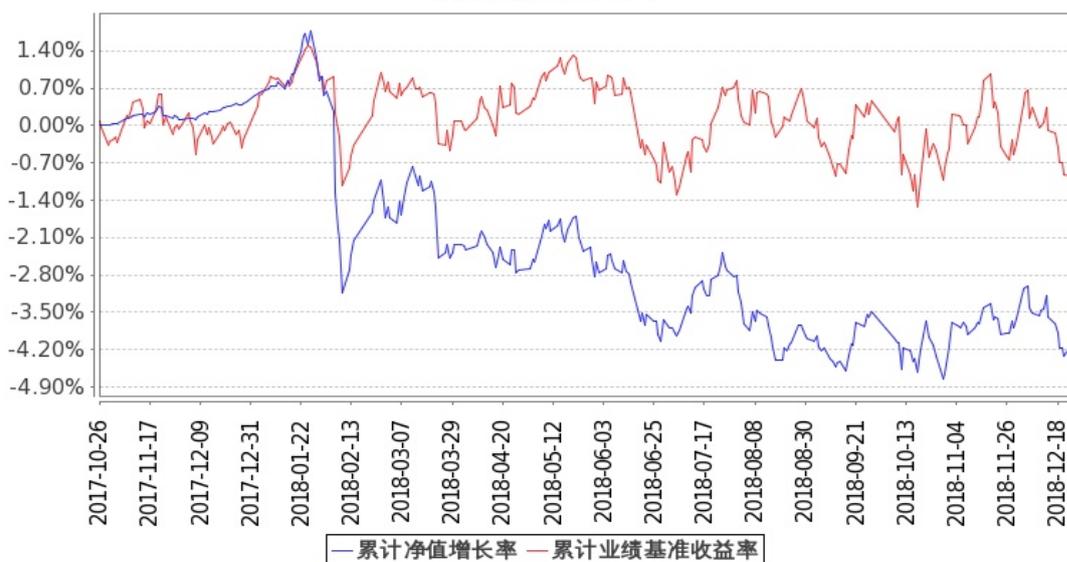


图 1：嘉实领航资产配置混合（FOF）A 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2017 年 10 月 26 日至 2018 年 12 月 31 日）

嘉实领航资产配置混合（FOF）C 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

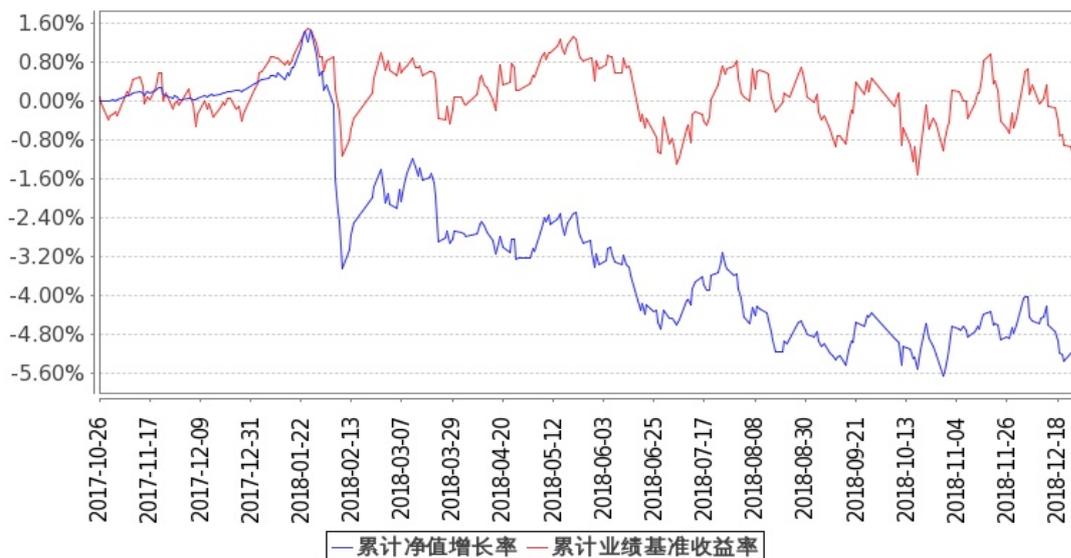


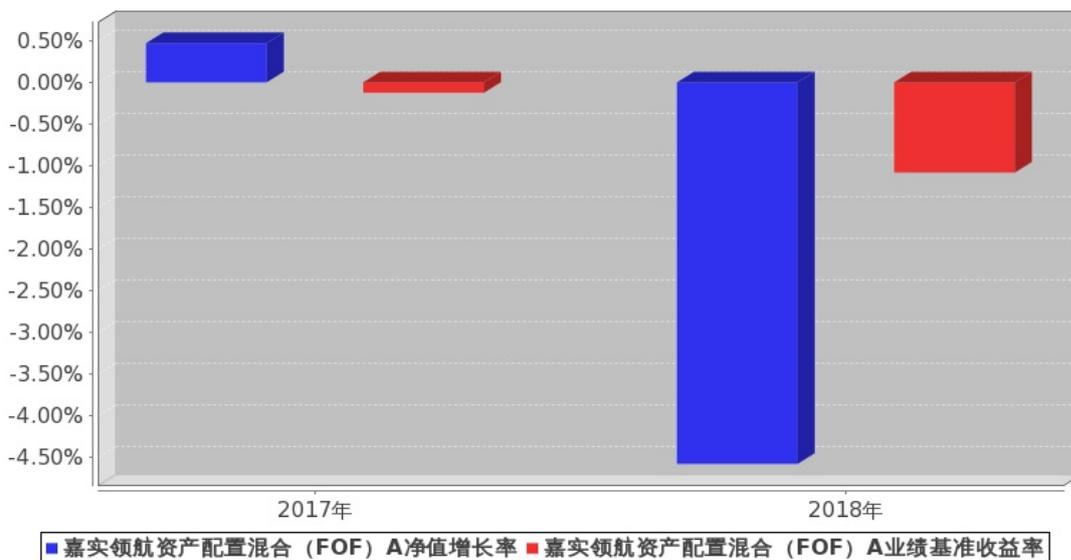
图 2：嘉实领航资产配置混合（FOF）C 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2017 年 10 月 26 日至 2018 年 12 月 31 日）

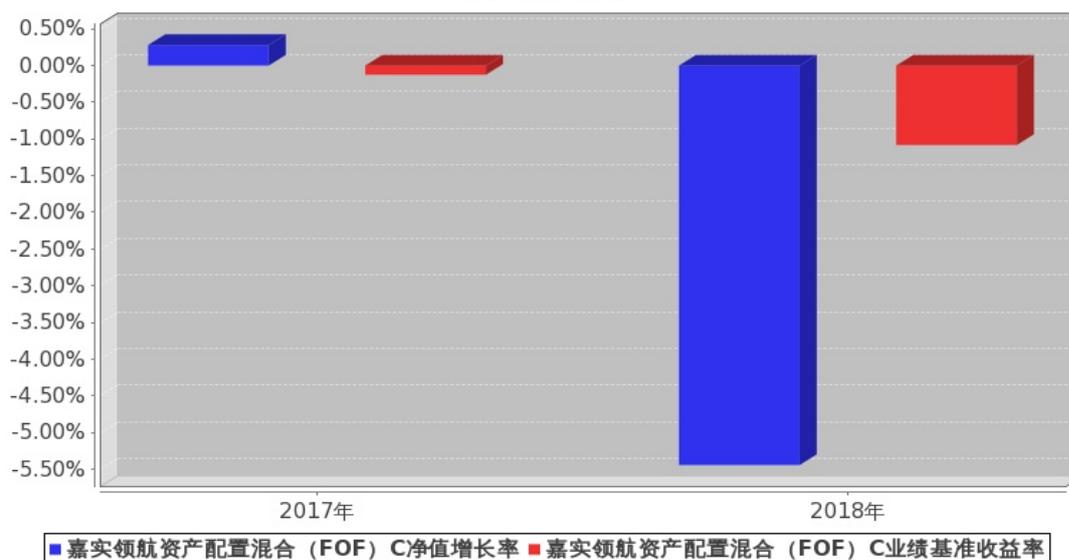
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实领航资产配置混合（FOF）A 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实领航资产配置混合（FOF）C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2017 年 10 月 26 日，2017 年度的相关数据根据当年实际存续期（2017 年 10 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、144 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创

400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、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、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、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、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、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
王欣	本基金基金经理	2017 年 10 月 26 日	-	8 年	2010 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，先后担任高级软件工程师、金融工程研究员和投资经理。博士，CFA，具有基金从业资格。
张静	本基金基金经理	2017 年 10 月 27 日	-	7 年	曾任 Pine River Capital Management 策略师。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，从事资产配置策略及量化交易策略研究工作。博士，具有基金从业资格。

注：（1）基金经理王欣任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理张静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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实领航资产配置混合型基金中基金（FOF）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 管理人对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多方面，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信息、投资建议，

并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。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部集中交易。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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 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。

报告期内，公司对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同向交易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。

4.3.3 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 12 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 管理人对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

2018 年全球以美元计价的资产回报占比高达 90% 以上，创下了有记录以来的最高比例。自 2008 年金融危机以来，美联储等各大央行资产负债表迅速扩张，2017 年终于意识到盛宴结束的必要性，纷纷加息或退出宽松，支撑过去 10 年资产价格上涨的核心开始拐头。2018 年各类风险事件主导了整一年的金融市场情绪，从年初，美元重拾强势，新兴市场出现危机；到随后美国揭开贸易战的帷幕，与全球各主要贸易对手重新进行贸易谈判；到下半年欧洲民粹主义抬头，意大利政府赤字问题以及英国脱欧出现问题。四季度，美债长短端利率的“倒挂”，油价的大幅回落，更是增加了市场的波动性，全球风险资产大幅承压。

2018 年中国经济的压力逐渐显现，固定资产投资数据持续走低，靠投资拉动经济的边际效应逐渐走弱；居民部门的高负债大幅挤压了消费需求，社会零售品消费增速不断下行；出口压力更

是越来越大，自加入 WTO 后的全球一体化格局面临重构，中国在全球贸易产业链中面临重新定位。虽然政府出台了很多政策，包括减税、扶持民营企业、稳杠杆等，但是只是缓解了问题，宽货币向宽信用的传导仍然不畅，社会融资等信贷数据始终未能企稳。内忧外患下，A 股全年经历了 30% 的单边下跌，几乎没有像样的反弹；债券收益率全年下行约 100bps，高等级信用债和利率债受益明显；黄金受益于下半年风险事件频发和实际利率的下行，录得正收益。

报告期内本基金秉承科学化和纪律性的组合管理理念，保持各大类资产承担的风险相对均衡，除年初因对经济基本面的预判失误超配权益外，全年相较于基准均低配股票，降低了权益资产单边下跌带来的负贡献；债券方面，二季度以来拉长久期，是组合收益的主要来源；组合层面，遵循分散风险的投资理念，全年配置黄金，有效降低了组合的波动。在基金选择上，通过定量和定性分析相结合的方式，选取历史业绩优秀、风格稳定且投资方法论完善的主动基金经理构建组合，不做细分行业的偏离，多数取得了显著的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实领航资产配置混合（FOF）A 基金份额净值为 0.9587 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.58%；截至本报告期末嘉实领航资产配置混合（FOF）C 基金份额净值为 0.9482 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.44%；业绩比较基准收益率为-1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，全球宏观经济动力下行，叠加日益加剧的国际政治纷争，压制全球风险偏好，且存在预期盈利下调的可能，风险资产预计仍会承压。中国经济下行仍大，A 股盈利存在负增长的可能，但经历 2018 年全年的调整后，估值已处于底部区间，结构性机会日益显现；发达市场的基本面风险处于抬升初期，流动性收缩带来的压力仍会持续，并会逐渐蔓延到实体，权益市场存在下调风险。债券方面，鉴于中国经济下行风险仍未消除，预计利率仍有下行空间，约 4% 的票息仍是具有吸引力的绝对收益资产，中间不排除大幅波动的可能性。黄金，受益于美国实际利率的下行压力，和全球政治风险的攀升，预计成为较好的相对收益资产。本基金仍将秉承风险“分散”的投资理念，配置具有风险收益相匹配的优质资产，争取为投资者在中长周期获得稳定合理的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告嘉实领航资产配置混合（FOF）A 3.1.1 “本期利润”为-74,621,549.42 元，3.1.2 “期末可供分配利润”为-50,326,268.74 元；嘉实领航资产配置混合（FOF）C 3.1.1 “本期利润”为-11,305,463.95 元，3.1.2 “期末可供分配利润”为-7,760,015.48 元，以及本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）的约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

嘉实领航资产配置混合型证券投资基金（FOF）2018 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师许薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字（2019）第22812号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实领航资产配置混合型证券投资基金（FOF）

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,301,785.02	163,846,044.18
结算备付金		1,094,022.73	1,222,998.18
存出保证金		55,484.70	15,549.87
交易性金融资产	7.4.7.2	1,303,869,088.48	2,259,492,052.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		1,243,677,088.48	2,259,492,052.44
债券投资		60,192,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	958,527.96	44,515.79
应收股利		525,450.01	2,357,027.30
应收申购款		75,771.30	1,267,191.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,320,880,130.20	2,428,245,379.13

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,023,322.12	57,906,641.62
应付管理人报酬		622,957.69	1,407,667.87
应付托管费		174,786.20	484,564.70
应付销售服务费		98,078.28	333,624.38
应付交易费用	7.4.7.7	600.00	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	380,253.58	186,646.50
负债合计		10,299,997.87	60,319,145.07
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,368,666,416.55	2,357,529,074.61
未分配利润	7.4.7.10	-58,086,284.22	10,397,159.45
所有者权益合计		1,310,580,132.33	2,367,926,234.06
负债和所有者权益总计		1,320,880,130.20	2,428,245,379.13

注： 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，嘉实领航资产配置混合（FOF）A 份额净值 0.9587 元，基金份额总额 1,218,969,202.01 份；嘉实领航资产配置混合（FOF）C 份额净值 0.9482 元，基金份额总额 149,697,214.54 份。基金份额总额合计为 1,368,666,416.55 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实领航资产配置混合型证券投资基金中基金（FOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-67,145,226.62	16,948,361.32
1. 利息收入		1,499,270.65	660,364.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,095,497.92	510,858.59
债券利息收入		320,175.34	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		83,597.39	149,506.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-56,004,548.45	13,939,294.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-103,418,776.01	-729,022.02
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	47,414,227.56	14,668,316.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-14,771,160.09	1,340,711.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,131,211.27	1,007,990.31
减：二、费用		18,781,786.75	5,972,681.37
1. 管理人报酬		9,777,546.61	3,261,323.66
2. 托管费		2,914,629.08	1,123,312.85
3. 销售服务费		1,515,204.18	892,354.78
4. 交易费用	7.4.7.19	4,135,323.02	558,332.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,479.07	-
7. 其他费用	7.4.7.20	437,604.79	137,357.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-85,927,013.37	10,975,679.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-85,927,013.37	10,975,679.95

注：本基金合同生效日为 2017 年 10 月 26 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 10 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实领航资产配置混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,357,529,074.61	10,397,159.45	2,367,926,234.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-85,927,013.37	-85,927,013.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-988,862,658.06	17,443,569.70	-971,419,088.36
其中：1. 基金申购款	55,546,804.72	-482,200.08	55,064,604.64
2. 基金赎回款	-1,044,409,462.78	17,925,769.78	-1,026,483,693.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,368,666,416.55	-58,086,284.22	1,310,580,132.33
项目	上年度可比期间		
	2017年10月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,863,773,157.30	-	2,863,773,157.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,975,679.95	10,975,679.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-506,244,082.69	-578,520.50	-506,822,603.19
其中：1. 基金申购款	16,885,303.92	34,940.66	16,920,244.58

2. 基金赎回款	-523, 129, 386. 61	-613, 461. 16	-523, 742, 847. 77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2, 357, 529, 074. 61	10, 397, 159. 45	2, 367, 926, 234. 06

注：本基金合同生效日为 2017 年 10 月 26 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2017 年 10 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2017 年 10 月 26 日(基金合同生

效日)至 2017 年 12 月 31 日), 本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日（基金 合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,777,546.61	3,261,323.66
其中：支付销售机构的客户维护费	5,217,994.89	1,208,141.64

注：本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费。通常情况下，支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分（若为负数，则取 0）× 0.80% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日（基金 合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,914,629.08	1,123,312.85

注：本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分（若为负数，则取 0）× 0.25% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实领航资产配置混合 (FOF) A	嘉实领航资产配置混合 (FOF) C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	163,869.98	163,869.98
中国建设银行	-	339,624.90	339,624.90
合计	-	503,494.88	503,494.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实领航资产配置混合 (FOF) A	嘉实领航资产配置混合 (FOF) C	合计
	嘉实基金管理有限公司	-	51,931.73
中国建设银行	-	187,633.36	187,633.36
合计	-	239,565.09	239,565.09

注：（1）本基金 C 类份额销售服务费年费率为 0.80%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.80% / 当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日），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。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2018 年 12 月 31 日）及上年度末（2017 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	14,301,785.02	1,066,943.13	163,846,044.18	508,694.44

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2017 年 10 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日)，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金持有基金管理人嘉实基金管理有限公司所管理的基金合计 411,167,962.90 元(2017 年 12 月 31 日：447,086,624.26 元)，占本基金资产净值的比例为 31.37%（2017 年 12 月 31 日：18.88%）。

7.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 10 月 26 日（基金合 同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	891,154.62	115,372.87
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	38,491.83	4,113.15
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,873,361.68	178,397.80
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	754,744.28	60,001.54

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。

本基金管理人运用本基金财产申购、赎回其自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部

分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，当期交易基金产生的赎回费为按规定应当收取并计入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2018年12月31日），本基金未持有因认购 新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2018年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2018年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2018年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,243,677,088.48	94.16
3	固定收益投资	60,192,000.00	4.56
	其中：债券	60,192,000.00	4.56
	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	15,395,807.75	1.17
8	其他各项资产	1,615,233.97	0.12
9	合计	1,320,880,130.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

8.3 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

报告期末，本基金未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,192,000.00	4.59
	其中：政策性金融债	60,192,000.00	4.59
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	60,192,000.00	4.59

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180209	18 国开 09	600,000	60,192,000.00	4.59

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 本报告期投资基金情况**8.12.1 投资政策及风险说明**

本基金为混合型基金中基金，以风险为核心进行分散化资产配置，通过风险模型定量调整各类资产比例，审慎甄选基金，综合利用市场结构、投资者行为、资产风险收益特征等研究成果优化基金组合，投资于公开募集基金份额的比例不少于基金资产的 80%，投资于股票型基金的比例不高于基金资产净值的 30%。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	070005	嘉实债券	契约型开放式	154,058,581.92	194,267,871.80	14.82	是
2	000147	易方达高等级信用债债券 A	契约型开放式	151,185,817.51	188,831,086.07	14.41	否
3	519723	交银双轮动债券 A/B	契约型开放式	142,475,427.67	153,730,986.46	11.73	否
4	000419	大摩优质信价纯债 A	契约型开放式	114,733,809.16	123,224,111.04	9.40	否
5	070037	嘉实纯债债券 A	契约型开放式	88,245,881.29	98,747,141.16	7.53	是

6	070019	嘉实价值优势混合	契约型开放式	49,291,559.61	64,818,400.89	4.95	是
7	519069	汇添富价值精选混合	契约型开放式	28,595,706.10	58,077,879.09	4.43	否
8	004544	嘉实稳华纯债债券	契约型开放式	43,521,452.19	47,925,823.15	3.66	是
9	110037	易方达纯债债券 A	契约型开放式	32,296,733.21	38,207,035.39	2.92	否
10	518880	黄金 ETF	交易型开放式	12,200,000.00	34,477,200.00	2.63	否
11	167501	安信宝利（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	27,785,018.01	34,008,862.04	2.59	否
12	511990	华宝添益	契约型开放式	300,510.00	30,057,611.22	2.29	否
13	001811	中欧明睿新常态混合	契约型开放式	27,536,178.12	27,095,599.27	2.07	否
14	510050	50ETF	交易型开放式	11,200,000.00	25,603,200.00	1.95	否
15	000744	北信瑞丰稳定收益 A	契约型开放式	17,651,368.04	19,275,293.90	1.47	否
16	001256	泓德优选成长混合	契约型开放式	20,941,361.26	19,056,638.75	1.45	否
17	510500	500ETF	交易型开放式	4,000,000.00	17,804,000.00	1.36	否
18	511880	银华交易型货币 A	契约型开放式	150,000.00	15,018,750.00	1.15	否
19	233005	大摩强收益债券	契约型开放式	8,143,448.69	14,508,368.19	1.11	否
20	002229	华夏经济转型股票	契约型开放式	10,930,617.22	11,542,731.78	0.88	否
21	002214	中海沪港深价值优选混合	契约型开放式	6,571,459.86	7,820,037.23	0.60	否
22	519712	交银阿尔法核心混合	契约型开放式	4,388,009.59	7,534,212.47	0.57	否

23	000127	农银行业领先混合	契约型开放式	3,501,776.15	6,635,515.63	0.51	否
24	004450	嘉实前沿科技沪港深股票	契约型开放式	6,007,135.24	5,402,817.43	0.41	是
25	070009	嘉实超短债债券	契约型开放式	5,618.11	5,904.63	0.00	是
26	003474	南方天天利货币 B	契约型开放式	7.05	7.05	0.00	否
27	000917	嘉实快线货币 A	契约型开放式	3.84	3.84	0.00	是

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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。

8.13.2

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。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,484.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	525,450.01
4	应收利息	958,527.96
5	应收申购款	75,771.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,615,233.97

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
嘉实领航资产配置混合 (FOF) A	28,634	42,570.69	5,926,153.35	0.49	1,213,043,048.66	99.51
嘉实领航资产配置混合 (FOF) C	19,955	7,501.74	4,574,551.97	3.06	145,122,662.57	96.94
合计	47,598	28,754.70	10,500,705.32	0.77	1,358,165,711.23	99.23

注：(1) 嘉实领航资产配置混合 (FOF) A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实领航资产配置混合 (FOF) A 份额占嘉实领航资产配置混合 (FOF) A 总份额比例、个人投资者持有嘉实领航资产配置混合 (FOF) A 份额占嘉实领航资产配置混合 (FOF) A 总份额比例；

(2) 嘉实领航资产配置混合 (FOF) C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实领航资产配置混合 (FOF) C 份额占嘉实领航资产配置混合 (FOF) C 总份额比例、个人投资者持有嘉实领航资产配置混合 (FOF) C 份额占嘉实领航资产配置混合 (FOF) C 总份额比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实领航资产配置混合 (FOF) A	534,189.59	0.04
	嘉实领航资产配置混合 (FOF) C	84.00	0.00
	合计	534,273.59	0.04

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实领航资产配置混合（FOF）A	10~50
	嘉实领航资产配置混合（FOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实领航资产配置混合（FOF）A	0
	嘉实领航资产配置混合（FOF）C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实领航资产配置混合（FOF）A	嘉实领航资产配置混合（FOF）C
基金合同生效日（2017年10月26日）基金份额总额	2,136,185,267.47	727,587,889.83
本报告期期初基金份额总额	1,992,049,184.31	365,479,890.30
本报告期基金总申购份额	39,058,834.77	16,487,969.95
减：本报告期基金总赎回份额	812,138,817.07	232,270,645.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,218,969,202.01	149,697,214.54

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内持有基金未发生重大影响事件。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 80,000.00 元，该审计机构已连续 2 年为本基金提供审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司							
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-	新增
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3：报告期内，本基金退租以下交易单元：中信证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		的比例						
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	1,742,378,887.39	57.70%
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	108,894,620.42	3.61%
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	749,734,433.66	24.83%
华泰证券股份有限公司	-	-	430,000,000.00	100.00%	-	-	418,530,401.81	13.86%

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2019年2月2日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年2月2日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019年03月26日