嘉实创新成长灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实创新成长混合
基金主代码	001760
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	63,865,562.21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、基本面和资金面等四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。
业绩比较基准	沪深300*50%+中债总指数*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7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,215,929.32
2.本期利润	-4,959,505.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0736
4.期末基金资产净值	56,765,926.45
5.期末基金份额净值	0.889

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	-8.16%	1.31%	-0.39%	0.67%	-7.77%	0.64%

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

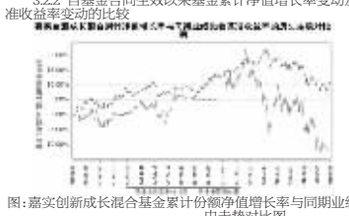

图:嘉实创新成长混合基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年2月3日至2018年9月30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		
周加文	本基金基金经理	2016年10月10日	-	11年	曾任Echo Bridge Capital Partners及Stone Apse & Leach分析师,华夏基金及中信产业基金研究员。2013年9月加入嘉实基金管理有限公司,任研究部研究总一部。现任职于投票投资部。

注:(1)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;(3)2018年10月16日,本基金管理人发布《关于嘉实创新成长混合基金经理变更的公告》,周加文先生不再担任本基金基金经理,由刘美玲女士单独管理本基金。

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、《嘉实创新成长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5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

2018年二季度,在经历了六月份的普跌以后,市场维持底部震荡,结构呈现二八分化。银行和石油石化板块上涨10%左右,而大量的股票依然处于下跌之中,深综指和中小创继续创新低。可选消费下跌幅度较大,尤其是家电和汽车板块。进入8月以后次高端白酒也有较大回调。在贸易战的影响下,电子等硬件板块受冲击较大。高位的医药板块在政策的影响下补跌。货币市场边际宽松,但货币宽松未能传导到信贷宽松,实体经济资金面依然较紧。在报告期内,本基金采取了防御的策略,前期一方面对行业配置进行了调整,减少了贝塔较高的行业配置比例;另一方面提高了选股标准,减少了持股数量,只持有行业中核心竞争力强的龙头。后期本基金对仓位也进行了调整,力求在复杂的市场环境中控制回撤,减小组合波动。

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0.889元;本报告期基金份额净值增长率为-8.16%,业绩比较基准收益率为-0.39%。

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	6,239,613.76	10.94
	其中:股票	6,239,613.76	10.94
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	50,766,908.23	88.98
8	其他资产	44,693.13	0.08
9	合计	57,051,215.12	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,427,229.00	7.80
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	1,413,353.76	2.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	247,276.00	0.44
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	151,685.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	6,239,613.76	10.99

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	600887	伊利股份	61,600	1,581,888.00	2.79
2	002120	韵达股份	41,496	1,413,353.76	2.49
3	002236	大华股份	83,300	1,230,341.00	2.17
4	600197	伊力特	39,400	728,900.00	1.28
5	000661	长春高新	1,600	379,200.00	0.67
6	002410	广联达	9,200	246,376.00	0.43
7	000063	中兴通讯	11,100	203,130.00	0.36
8	603678	火炬电子	9,300	179,397.00	0.32
9	603096	新经典	2,300	151,685.00	0.27
10	300136	信维通信	3,900	103,935.00	0.18

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

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	25,886.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,110.68
5	应收申购款	9,696.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,693.13

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	62,790,147.23
报告期期间基金总申购份额	2,811,720.56
减:报告期期间基金总赎回份额	1,736,315.56
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	63,865,562.21

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创新成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实创新成长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)报告期内嘉实创新成长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

2018年10月26日

嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实创业板ETF
场内简称	创业板K
基金主代码	159915
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年7月14日
报告期末基金份额总额	53,634,838.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	创业板指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,219,731.66
2.本期利润	-4,757,724.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0983
4.期末基金资产净值	41,039,595.84
5.期末基金份额净值	0.7651

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	-12.13%	1.52%	-12.16%	1.53%	0.03%	-0.01%

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

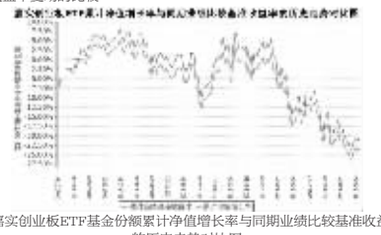

图:嘉实创业板ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年7月14日至2018年9月30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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实红股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中关村A股ETF、嘉实国时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF基金经理	2017年7月15日	-	13年	曾任职于中国台湾台胥证券,中国台湾保诚投信。2008年4月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理,硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实红股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证500ETF、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联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF基金经理	2017年7月14日	-	12年	曾任职于IA摩根资产管理公司(IA-Charlington Investments Inc.)、富兰克林邦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部、现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)基金经理何如的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理陈正宪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、《嘉实创业板交易型开放式指数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5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

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差为0.38%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

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0.7651元;本报告期基金份额净值增长率为-12.13%,业绩比较基准收益率为-12.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金2018-7-1至2018-9-30连续64个工作日基金资产净值低于五千万元,未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境影响,本基金将继续运作。

§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	40,845,595.09	98.96
	其中:股票	40,845,595.09	98.96
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	406,544.47	0.98
8	其他资产	23,534.29	0.06
9	合计	41,275,673.85	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	3,826,656.00	9.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,193,431.63	49.21
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	429,004.50	1.05
F	批发和零售业	333,927.00	0.81
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	10,252,766.21	24.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	262,260.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	116,640.00	0.28
N	水利,环境和公共设施管理业	1,133,493.00	2.76
O	居民服务,修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,174,980.75	5.30
R	文化,体育和娱乐业	2,122,436.00	5.17
S	综合	-	-
	合计	40,845,595.09	99.53

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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	300498	温氏股份	164,800	3,826,656.00	9.32
2	300760	东方财富	168,129	1,891,350.00	4.61
3	300003	乐普医疗	39,600	1,201,860.00	2.93
4	300124	汇川技术	42,600	1,180,020.00	2.88
5	300015	爱尔眼科	35,699	1,151,292.75	2.81
6	300142	沃森生物	50,700	1,105,260.00	2.69
7	300122	智飞生物	20,000	979,200.00	2.39
8	300408	三环集团	46,945	975,986.55	2.38
9	300136	信维通信	34,100	908,765.00	2.21
10	300024	机器人	53,400	872,022.00	2.12

5.2.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

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

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	1,434.14
2	应收证券清算款	22,023.15
3	应收股利	-
4	应收利息	77.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,534.29

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	42,434,838.00
报告期期间基金总申购份额	18,200,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	7,000,000.00
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	53,634,838.00

§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创业板交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实创业板交易型开放式指数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)报告期内嘉实创业板交易型开放式指数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

2018年10月26日

嘉实农业产业股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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2018年10月23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7月1日起至2018年9月30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	000634
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	168,494,684.27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、公司价值管理和流动性分析,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择合适股票池,并在此基础上,通过自上而下自下而上相结合的方法挖掘具优质的上市公司,构建股票投资组合,同时在各个投资环节中实现风险分散,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结构。
业绩比较基准	中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7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-6,929,299.78
2.本期利润	-5,474,593.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0323
4.期末基金资产净值	158,280,376.67
5.期末基金份额净值	0.9394

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	-3.36%	1.17%	-4.29%	0.94%	0.93%	0.23%

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9月30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		
施爽	本基金基金经理	2016年12月7日	-	9年	曾任中再资产农业及食品饮料研究员;中信产业基金农业及食品行业高级研究员。2014年11月加入嘉实基金管理有限公司,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5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

三季度,国内宏观经济经济动能有所放缓,9月PMI降到近两年低位,地产增速回落,基建短期获政策支持从低迷环比回升;消费相对平稳但二季度以来部分行业出现波动;出口由于中美贸易摩擦而放缓。

股票市场受到中美贸易摩擦、金融领域流动性收紧等因素的影响,市场表现低迷,A股市场在整体风险偏好下降的环境下持续下行,上证综指下跌0.92%,创业板指下跌12.16%,其中上证综指接近2016年以来的低点位置。

农业板块景气度在三季度有所回升,猪鸡价格和大宗农产品价格出现上涨,但非洲猪瘟在国内的发生给板块造成了短期的负面情绪影响和下跌。非洲猪瘟会使养猪产业链的部分公司经营遭受一些短期的扰动,行业和周期的长期运行趋势不会改变。

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、饲料、食品、白酒、农化等行业的长期龙头公司;2)顺应消费升级方向,需求受到中美贸易冲突扰动较小的个股;3)周期趋势上行的养殖股等。

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0.9394元;本报告期基金份额净值增长率为-3.36%,业绩比较基准收益率为-4.29%。

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