

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金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、完整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“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。投资人对投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内的财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称：嘉实策略混合

基金主代码：070011

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年12月12日

报告期末基金份额总额：3,343,298,687.0份

投资目标：通过有效的组合管理，为基金持有人创造长期的中长期资产增值。

从宏观经济政策、资金面和基本面进行综合分析，在具备多头预期收益的基础上，精选具有成长性的股票，通过有效的组合管理，为基金持有人创造长期的中长期资产增值。

投资策略：本基金将重点在价值低估的成长股，包括网络安全、大数据、储能、安防、乳制品、新材料等领域的行业龙头，以及部分估值高分红的价值股，部分受益于供给侧改革的周期股等，“3季度的净值增长率相对上半年的后市业绩带来了较为明显的改善。本基金将继续以价值持续成长、价值偏低的优质成长企业为配置主线，以期在短期和长期能给持有人带来良好投资回报。

4.3 特殊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%，合计1次，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

国内三季度经济增长相对平稳，固定资产投资温和回落，消费增速总体平稳，工业增加值增速稳中略降，年内CPI仍在2%以下温和运行，但PPI略有上升，3季度大宗商品先升后降上有所回落，经济的结构性变化仍在继续，包括消费的全面升级、制造业的高端升级、经济的结构性变化，给国内的优秀企业带来更多发展机会。

A股在三季度呈现震荡向上的行情，沪深300指数上涨4.63%，中证500指数上涨5.78%，从板块表现来看，3季度有色金属、钢铁板块涨幅居前，主要受益于大宗商品的上涨，而化工、公用事业板块涨幅居后。

通过有效的组合管理，为基金持有人创造长期的中长期资产增值。

报告期内，本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分(二)、(三)、(四)、(五)的投资限制的有关规定。

5.1 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

报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)

1.本期已实现收益 233,330,316.59

2.本期利润 302,380,685.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0886

4.期末基金资产净值 4,354,314,418.16

5.期末基金份额净值 1.302

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)相扣相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(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将低于所列数字。

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

报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.4.1 公平交易特别说明

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.4.3 公平交易专项说明

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%，合计1次，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。

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

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、严格的过程控制、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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 4,046,271,031.71 92.61

2 固定收益投资 - -

3 货币市场工具 - -

4 银行存款和结算备付金 302,190,188.45 6.92

5 其他资产 20,486,996.00 0.47

9 合计 4,368,947,217.06 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：(1)本基金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将低于所列数字。

(3)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额，基金业绩指标不包含H类基金份额。

3.5 主要财务指标和基金净值表现

3.6.1 公平交易特别说明

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.6.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.6.3 公平交易专项说明

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%，合计1次，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。

4.7 报告期内基金投资策略和运作分析

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、严格的过程控制、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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.3 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 21,383,990 37.05

2 固定收益投资 316,243,503.84 53.59

3 货币市场工具 303,261,402.88 6.69

4 银行存款和结算备付金 10,193,444 2.14

5 其他资产 18,526,300 4.17

9 合计 595,854,739.99 100.00

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：(1)本基金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将低于所列数字。

(3)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额，基金业绩指标不包含H类基金份额。

3.6 主要财务指标和基金净值表现

3.7.1 公平交易特别说明

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.7.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.7.3 公平交易专项说明

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%，合计1次，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。

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析

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、严格的过程控制、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。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.5 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 3,224,676,920.00 93.56

2 固定收益投资 204,446,367.16 4.70

3 货币市场工具 1,091,850.00 0.03

4 银行存款和结算备付金 68,682,526.04 1.58

5 交通设施、仓储物流 47,329,709.19 1.09

6 信息技术、软件和信息技术服务 4,944,600.00 0.10

7 制造业 3,861,36 0.09

8 农林牧渔业 3,055,056 0.08

9 其他 2,595,055 0.06

9 合计 3,433,298,687.00 100.00

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：(1)本基金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将低于所列数字。

(3)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额，基金业绩指标不包含H类基金份额。

3.8 主要财务指标和基金净值表现

3.9.1 公平交易特别说明

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.9.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

3.9.3 公平交易专项说明

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%，合计1次，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。

4.10 报告期内基金投资策略和运作分析

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、严格的过程控制、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。

4.11 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：(1)本基金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将低于所列数字。

(3)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额，基金业绩指标不包含H类基金份额。

3.10 主要财务指标和基金净值表现

3.11.1 投资组合报告

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%，合计1次，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。

4.12 报告期内基金投资策略和运作分析

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、严格的过程控制、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。

4.13 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：(1)本基金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将低于所列数字。

(3)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额，基金业绩指标不包含H类基金份额。