嘉实创新成长灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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2017年7月1日起至2017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	106,633,755.21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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-69,129.28
2.本期利润	5,967,780.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0514
4.期末基金资产净值	118,020,480.77
5.期末基金份额净值	1.107

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	5.23%	0.77%	2.49%	0.29%	2.74%	0.48%

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分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2017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		10年	曾任Echo Bridge Capital Partners及Sterne Agee & 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,任研究部研究员一职。现任职于股票投资部。

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。

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

报告期内经济增长相对平稳,固定资产投资温和略有回落,消费增速总体平稳,工业增加值增速平稳。国内CPI仍在2%以下温和运行,但PPI略有上升,3季度大宗商品先大幅上涨后有所回落。经济的结构性分化仍在继续,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越来越多的发展机会。

在经历4-5月份的下跌后,市场在三季度有了普涨行情,以周期股涨幅最大,其中有色板块(铝、新能源汽车上游材料锂和钴、稀土)领涨,钢铁和煤炭板块紧随其后,食品饮料、通信、电子板块涨幅靠前。创业板指数在7月中旬新低以后,也展开了一轮反弹行情,但传媒板块依然是三季度涨幅最小的板块。

本基金在8月下旬进行了加仓,加仓的板块以电子及其它行业成长股、周期股(钢铁、有色)为主,净值有了一定幅度的上涨。

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1.107元;本报告期基金份额净值增长率为5.23%,业绩比较基准收益率为2.49%。

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	105,134,449.95	88.35
	其中:股票	105,134,449.95	88.35
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	13,683,736.79	11.50
8	其他资产	182,034.31	0.15
9	合计	119,000,221.05	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	2,420,298.00	2.05
C	制造业	87,580,328.95	74.21
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	2,334,615.00	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	4,212,563.00	3.57
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	2,533,149.00	2.15
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	6,053,496.00	5.13
S	综合	-	-
	合计	105,134,449.95	89.08

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	300136	信维通信	227,800	9,567,600.00	8.11
2	300296	利亚德	312,600	6,298,890.00	5.34
3	300097	智云股份	213,280	6,281,096.00	5.32
4	002583	海能达	376,300	6,242,817.00	5.29
5	300433	蓝思科技	175,500	5,052,645.00	4.28
6	600233	圆通速递	190,700	4,212,563.00	3.57
7	300602	飞荣达	62,459	3,950,531.75	3.35
8	600529	山东药玻	160,000	3,465,600.00	2.94
9	600231	凌钢股份	516,000	3,312,720.00	2.81
10	300628	亿联网络	21,400	3,292,176.00	2.79

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	68,230.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,712.38
5	应收申购款	111,091.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,034.31

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	129,452,830.48
报告期期间基金总申购份额	6,079,592.37
减:报告期期间基金总赎回份额	28,898,667.64
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	106,633,755.21

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/08/08至2017/09/30	23,650,898.77	-	-	23,650,898.77	22.18
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品持有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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

9.3 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

2017年10月25日

嘉实纯债债券型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

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:中国建设银行股份有限公司
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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实纯债债券
基金主代码	070037
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月11日
报告期末基金份额总额	1,349,384,149.59份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求长期稳定增值。
投资策略	本基金在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上,以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心,自上而下地决定债券组合久期,动态调整各类金融资产比例,结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	嘉实纯债债券A 嘉实纯债债券C
下属分级基金的交易代码	070037 070038
报告期末下属分级基金的份额总额	570,551,638.01份 778,832,511.58份

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
1.本期已实现收益	-466,191.46	3,517,863.05
2.本期利润	2,486,239.57	12,113,159.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0067
4.期末基金资产净值	653,876,637.70	887,014,413.67
5.期末基金份额净值	1.146	1.139

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)嘉实纯债债券A收取认(申)购费,嘉实纯债债券C不收取认(申)购费但计提销售服务费。(3)所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

嘉实纯债债券A

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	0.70%	0.05%	0.33%	0.06%	0.37%	-0.01%

嘉实纯债债券C

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	0.62%	0.04%	0.33%	0.06%	0.29%	-0.02%

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

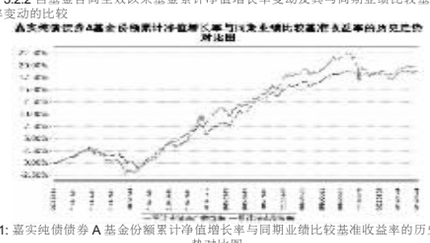

图1:嘉实纯债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年12月11日至2017年9月30日)

图2:嘉实纯债债券C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

(2012年12月11日至2017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"第十二部分(二)投资范围和(六)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		
曲扬	本基金、嘉实债券、嘉实稳固收益债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、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、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新策略混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、嘉实稳丰纯债、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实稳悦债券、嘉实稳悦纯债债券、嘉实新添辉定期混合基金经理	2012年12月11日		13年	曾任中信基金任债券研究员和债券交易员、光大银行债券自营投资业务副主管,2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理,现任职于固定收益业务体系全回报策略组。硕士研究生,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、《嘉实纯债债券型发起式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

报告期内,收益率曲线仍旧平坦,债券收益率区间震荡,十年国债波动幅度在10bp,基本面以及资金面的预期差主导了三季度的债券市场走势,债券市场逐步修复6-7月的乐观情绪,收益率整体上扬,其中前期利差压缩较为明显的超长期利率债收益率上行20-30bp,中低等级信用债由于流动性较弱,估值调整幅度不大。

基本面方面,三季度经济数据呈现低开高走的格局,经济韧性较足,7月受到基数因素,财政投放力度减弱,环保压力等原因,经济数据整体偏弱,但8-9月向好的海外基本面,国内制造业和房地产投资,仍带动整体经济稳中向好。上半年信贷投放较快,市场起初普遍对下半年信贷额度持谨慎态度,但三季度来看整体信贷和社融增速依然保持稳健,债券发行量有所回升,也支持了实体经济的发展。

资金面及监管方面,7月流动性整体较为宽松,但不松不紧的大环境叠加货币基金快速增长、非银债券配置仓位提高、以及银行面临大量存单到期,财政投放与市场资金传导的时间差等因素,8-9月资金面仍然一路走高,季末资金面紧张程度大超预期,市场对监管放松的预期也得到一定修复。

报告期内本基金本着稳健投资原则,在风险和收益之间进行平衡。因组合面临较大规模赎回,在获取绝对回报为主的前提下,大类资产配置上以利率债和高等级信用债投资为主,保持组合较低杠杆和久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实纯债债券A基金份额净值为1.146元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%;截至本报告期末嘉实纯债债券C基金份额净值为1.139元,本报告期基金份额净值增长率为0.62%;同期业绩比较基准收益率为0.33%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,835,327,790.91	90.51
	其中:债券	1,835,327,790.91	90.51
	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	150,000,465.00	7.40
	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	944,939.57	0.05
8	其他资产	41,505,039.28	2.05
9	合计	2,027,778,234.76	100.00

5.2 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。

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

报告期末,本基金未持有股票。

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	517,192.00	0.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	449,517,000.00	29.17
	其中:政策性金融债	449,517,000.00	29.17
4	企业债券	609,365,598.91	39.55
5	企业短期融资券	70,004,000.00	4.54
6	中期票据	705,924,000.00	45.81
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,835,327,790.91	119.11

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	140224	14国开24	1,100,000	111,221,000.00	7.22
2	1182057	11中建MTN1	1,000,000	101,080,000.00	6.56
3	130307	13进出07	1,000,000	99,430,000.00	6.45
4	120312	12进出12	700,000	69,692,000.00	4.52
5	1282387	12北国资MTN1	600,000	60,594,000.00	3.93

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	7,117.12
2	应收证券清算款	4,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	37,458,487.46
5	应收申购款	39,434.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,505,039.28

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,本基金未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	215,607,546.32
报告期期间基金总申购份额	449,387,794.66
减:报告期期间基金总赎回份额	94,443,702.97
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	570,551,638.01

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

	嘉实纯债债券A	嘉实纯债债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,981.79	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,981.79	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.75	-

注: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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,981.79	0.74	10,001,981.79	0.74	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	0
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0
合计	10,001,981.79	0.74	10,001,981.79	0.74	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/07/01至2017/09/30	2,535,140,587.09	-	1,772,500,000.00	762,640,587.09	56.52
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品持有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实纯债债券型发起式证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实纯债债券型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

10.2 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

10.3 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

2017年10月25日

嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

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2017年7月1日起至2017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E
基金主代码	159955
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2017年7月14日
报告期末基金份额总额	34,734,838.00份
投资目标	交易型开放式
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(2017年7月14日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	752,841.15
2.本期利润	1,380,113.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087
4.期末基金资产净值	35,538,790.99
5.期末基金份额净值	1.0231

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)本基金合同生效日为2017年7月14日,本报告期自2017年7月14日起至2017年9月30日止。

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
2017年7月14日(基金合同生效日)至2017年9月30日	2.31%	0.49%	4.95%	1.18%	-2.64%	-0.69%

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

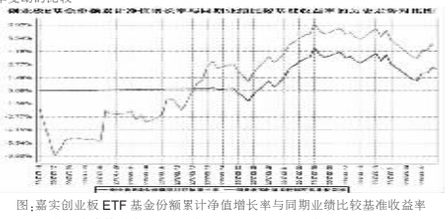

图:嘉实创业板ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2017年7月14日至2017年9月30日)

注1:本基金基金合同生效日2017年7月14日