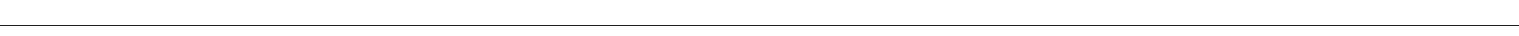
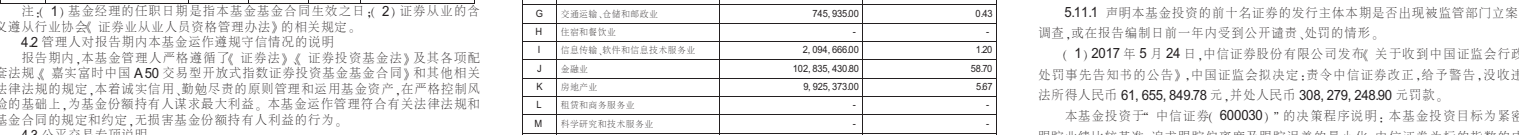
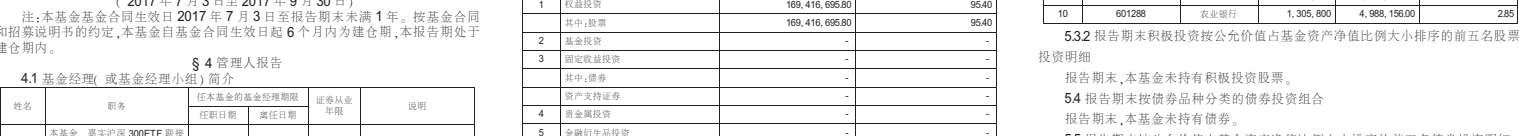
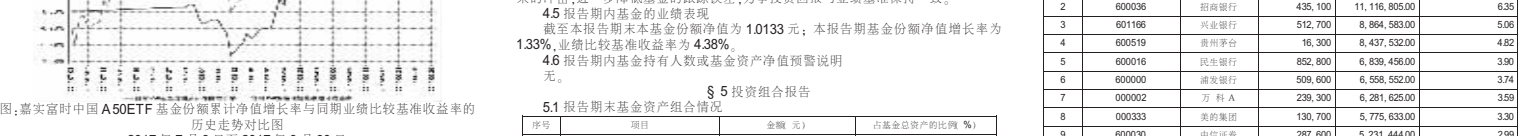
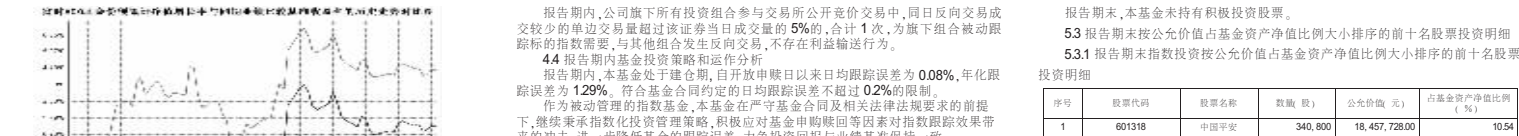
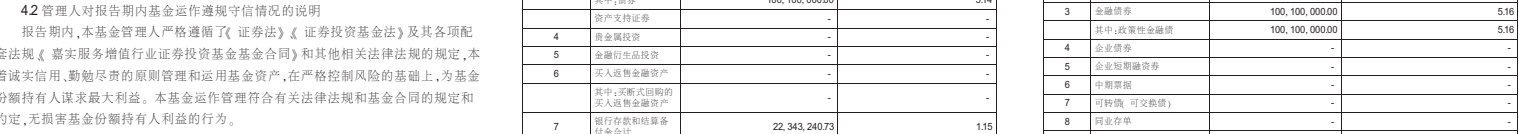
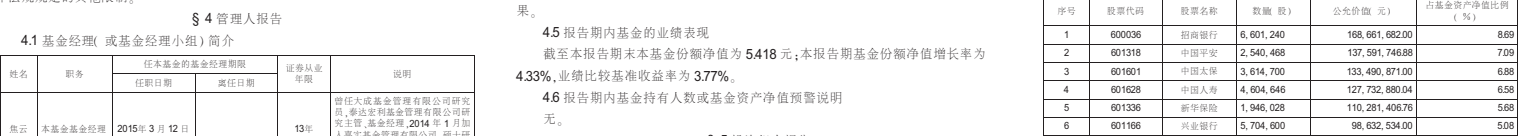
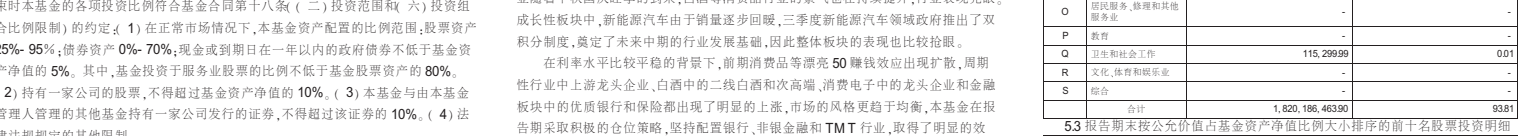
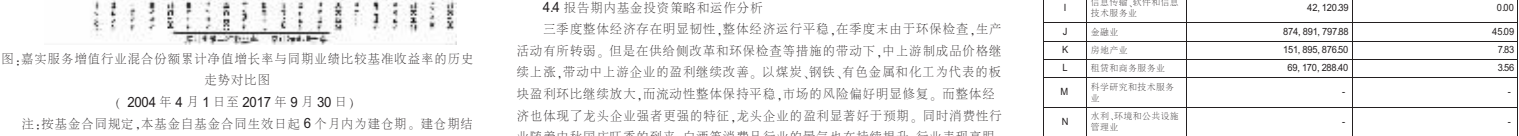
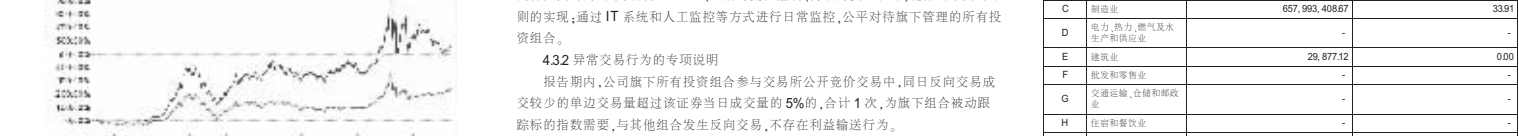
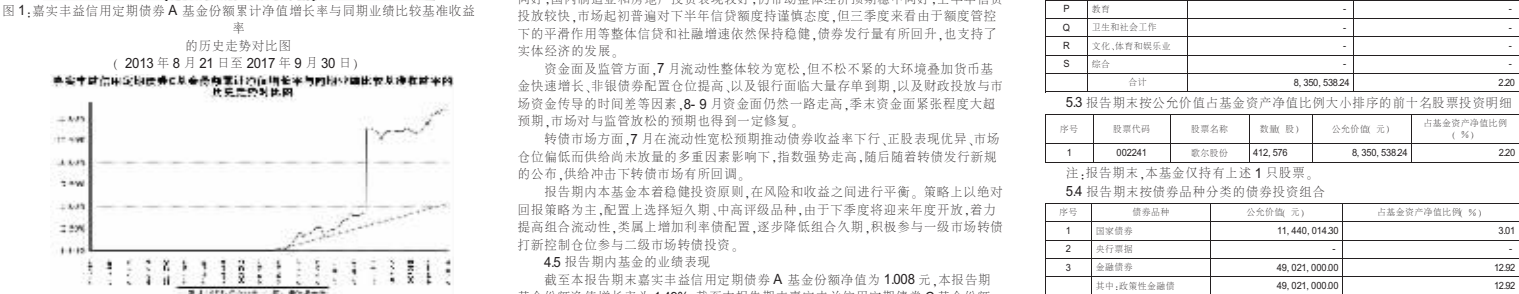
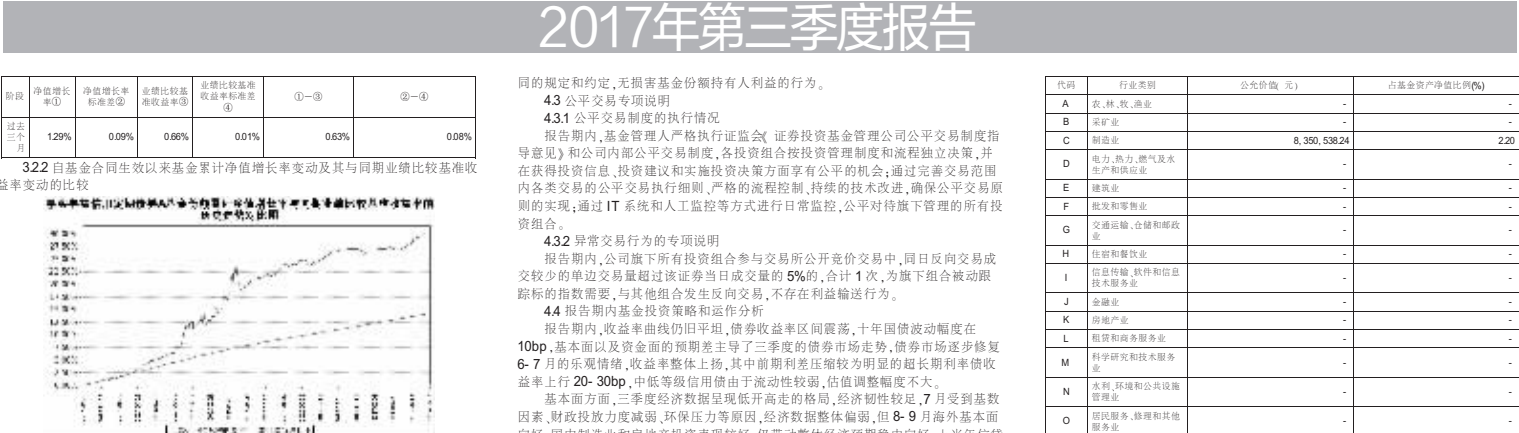


信息披露Disclosure

嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金



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当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	嘉实丰益信用定期债券
基金代码	001077
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	376,524,604.52份
投资目标	本基金通过积极主动的投资管理,力争实现当期净值最大化,以谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合,深入分析宏观经济和货币政策对经济运行的影响,结合大类资产配置原则制定大类资产配置策略,并在此基础上进行行业配置和个股选择,定期或不定期对投资组合进行动态优化和调整。在股票基金中,本基金将采取一种稳健的投资策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*70%+1.7%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
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

项目	嘉实丰益信用定期债券 A	嘉实丰益信用定期债券 C
1.本期已实现收益	4,636,291.03	296,567.95
2.本期利润	5,196,102.27	333,741.91
3.期末可供分配基金份额利润	0.0148	0.0139
4.期末基金资产净值	355,254,655.38	24,268,202.75
5.期末基金份额净值	1.0030	1.007

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自2015年9月22日起对基金净值增加C类基金份额奖励;④嘉实丰益信用定期债券A收取以中购,嘉实丰益信用定期债券C计提销售服务费,不收取以中购。

§3.1主要财务指标

项目	嘉实丰益信用定期债券 A	嘉实丰益信用定期债券 C
1.本期已实现收益	4,636,291.03	296,567.95
2.本期利润	5,196,102.27	333,741.91
3.期末可供分配基金份额利润	0.0148	0.0139
4.期末基金资产净值	355,254,655.38	24,268,202.75
5.期末基金份额净值	1.0030	1.007

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自2015年9月22日起对基金净值增加C类基金份额奖励;④嘉实丰益信用定期债券A收取以中购,嘉实丰益信用定期债券C计提销售服务费,不收取以中购。

§3.2基金净值表现

32.1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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三十个月	145%	0.09%	0.6%	0.01%	0.83%	0.08%

嘉实丰益信用定期债券 C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三十个月	145%	0.09%	0.6%	0.01%	0.83%	0.08%

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当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	嘉实服务增值行业基金
基金代码	070005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月9日
报告期末基金份额总额	358,122,927.27份
投资目标	在力争基金本金安全的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现当期净值最大化,以谋求长期稳健增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合,深入分析宏观经济和货币政策对经济运行的影响,结合大类资产配置原则制定大类资产配置策略,并在此基础上进行行业配置和个股选择,定期或不定期对投资组合进行动态优化和调整。在股票基金中,本基金将采取一种稳健的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于中高风险程度证券投资基金
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

项目	嘉实服务增值行业基金
1.本期已实现收益	-48,953,644.13
2.本期利润	81,677,984.55
3.期末可供分配基金份额利润	0.2224
4.期末基金资产净值	1,940,280,538.48
5.期末基金份额净值	5.418

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自2015年9月22日起对基金净值增加C类基金份额奖励;④嘉实丰益信用定期债券A收取以中购,嘉实丰益信用定期债券C计提销售服务费,不收取以中购。

§3.1主要财务指标

项目	嘉实服务增值行业基金
1.本期已实现收益	-48,953,644.13
2.本期利润	81,677,984.55
3.期末可供分配基金份额利润	0.2224
4.期末基金资产净值	1,940,280,538.48
5.期末基金份额净值	5.418

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自2015年9月22日起对基金净值增加C类基金份额奖励;④嘉实丰益信用定期债券A收取以中购,嘉实丰益信用定期债券C计提销售服务费,不收取以中购。

§3.2基金净值表现

32.1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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三十个月	433%	0.69%	377%	0.47%	0.56%	0.22%

32.2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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三十个月	433%	0.69%	377%	0.47%	0.56%	0.22%

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当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	嘉实富时中国 A50ETF
基金代码	A50
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月3日
报告期末基金份额总额	172,905,968.00份
投资目标	本基金通过被动式跟踪投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争将跟踪误差控制在0.2%以内,力争跟踪误差率不超过2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全复制标的指数的成份股构成及其权重来构建基金投资组合,并定期对投资组合的跟踪误差进行动态调整,以保持基金投资组合与标的指数的高度一致。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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

项目	嘉实富时中国 A50ETF
1.本期已实现收益	3,275,091.98
2.本期利润	4,976,285.47
3.期末可供分配基金份额利润	0.0166
4.期末基金资产净值	176,198,719.04
5.期末基金份额净值	1.0133

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3日,本报告期自2017年7月3日起至2017年9月30日止。

§3.2基金净值表现

32.1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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017年7月3日至2017年9月30日	133%	0.40%	438%	0.69%	-305%	-0.23%

32.2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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017年7月3日至2017年9月30日	133%	0.40%	438%	0.69%	-305%	-0.23%

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当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	嘉实富时中国 A50ETF
基金代码	A50
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月3日
报告期末基金份额总额	172,905,968.00份
投资目标	本基金通过被动式跟踪投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争将跟踪误差控制在0.2%以内,力争跟踪误差率不超过2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全复制标的指数的成份股构成及其权重来构建基金投资组合,并定期对投资组合的跟踪误差进行动态调整,以保持基金投资组合与标的指数的高度一致。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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

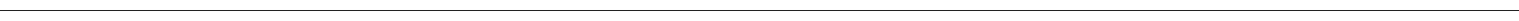
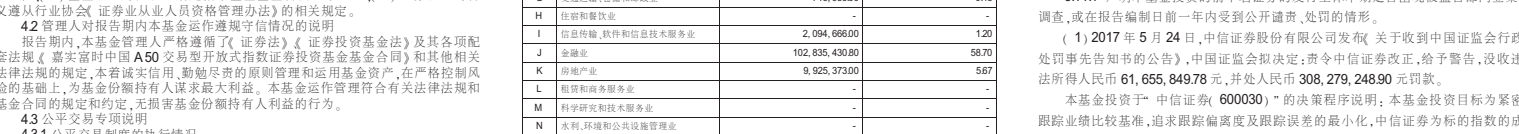
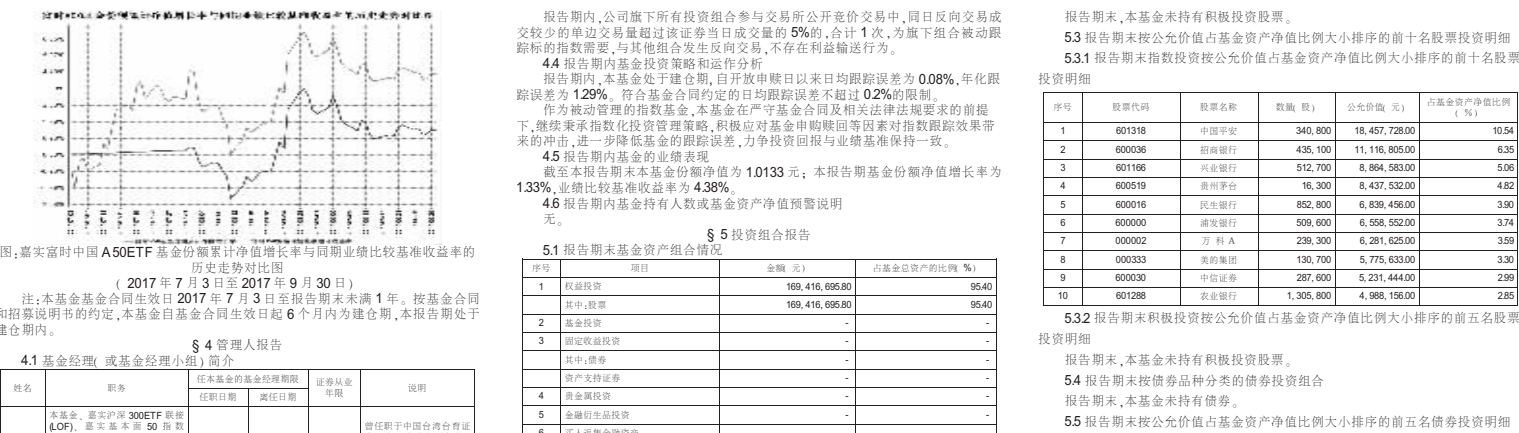
项目	嘉实富时中国 A50ETF
1.本期已实现收益	3,275,091.98
2.本期利润	4,976,285.47
3.期末可供分配基金份额利润	0.0166
4.期末基金资产净值	176,198,719.04
5.期末基金份额净值	1.0133

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3日,本报告期自2017年7月3日起至2017年9月30日止。

32.2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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017年7月3日至2017年9月30日	133%	0.40%	438%	0.69%	-305%	-0.23%

嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金



代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,300,538.24	2.20
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	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	8,300,538.24	2.20

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	002241	启明星辰	412,976	8,300,538.24	2.20

5.4 报告期末投资组合品种公允价值投资组合					
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	国债逆回购	11,440,014.30	3.01		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	49,021,000.00	12.92		
	其中:政策性金融债	49,021,000.00	12.92		
4	企业债券	62,022,031.16	16.34		
5	企业短期融资券	170,569,000.00	44.94		