

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
报告书公告日期：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实、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数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期中的财务数据未经审计。

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

2.1 基金基本情况

基金名称：嘉实富时中国A50ETF联接

基金主代码：004488

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年6月29日

报告期末基金份额总额：50,718,758.76份

投资目标：紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。

投资策略：本基金通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。

业绩比较基准：富时中国A50收益指数*95%+银行存款利率(1年)*5%

风险收益特征：本基金为长期投资和短期投资收益率高于同类基金，净值收益以货币市场基金。

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称：嘉实富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码：512500

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2017年7月3日

报告期自上市的证券交易所：上海证券交易所

2017年8月7日

基金管理人名称：嘉实基金管理有限公司

基金托管人名称：中国银行股份有限公司

2.1.2 基金产品说明

投资目标：本基金通过被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争在扣除管理费后的净值增长率在任何连续的30个交易日内不超过标的指数同期增长或下降幅度的12%。

投资策略：本基金完全按照标的指数的构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而进行相应调整。

业绩比较基准：中证50指数收益率

风险收益特征：本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险与收益的波动，以及对所代表的指数的跟踪误差都与标的指数的市场表现密切相关。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 主要财务指标

报告期：2017年7月1日-2017年9月30日

单位：人民币元

1.本期实现收益 218,462.88

2.本期利润 1,07,994.60

3.期末基金资产净值 0.0128

4.期末基金份额净值 51,389,492.44

5.期末基金份额净值 10122

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，计算费用后实际收益水平以扣除非费用后的净值为准。

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(%) 净值增长率偏离度(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.22% 0.49% 4.17% 0.66% -2.56% -0.17%

3.2.2 本基金自成立以来基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，计算费用后实际收益水平以扣除非费用后的净值为准。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 主要财务指标

报告期：2017年7月1日-2017年9月30日

单位：人民币元

1.本期实现收益 251,857,972.96

2.本期利润 647,196,165.38

3.期末基金资产净值 0.0892

4.期末基金资产净值 5,973,405,899.36

5.期末基金份额净值 0.855

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，计算费用后实际收益水平以扣除非费用后的净值为准。

3.3.2 本基金的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(%) 净值增长率偏离度(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 11.47% 0.94% 13.62% 0.85% -2.15% -0.09%

3.3.3 本基金的净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：(1)本基金已实现收益指基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(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，计算费用后实际收益水平以扣除非费用后的净值为准。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金基金经理期间 证券从业年限 说明

任日期 离任日期

蒋海 本基金、嘉实富时中国A50ETF基金经理 2015年10月24日 8年 曾任上海申银证券机构销售部及风险管理部高级经理，现任职于嘉实基金管理有限公司。

注：(1)任职日期、离任日期均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的有关规定，具体人员指基金业从业人员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的总体评价

报告期内，本基金严格按照基金合同的规定及有关法律法规的要求，认真履行诚实信用、勤勉尽责的基金管理职责，较好地完成了投资运作目标，实现了基金资产的保值增值，较好地完成了投资运作目标，实现了基金资产的保值增值。

4.3 公司主要财务指标

报告期：2017年7月20日-2017年9月30日止。

报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

报告期自20