嘉实美国成长股票型证券投资基金

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	嘉实美国成长股票(QDII)
基金主代码	000043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	46,002,348.93份
投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票,在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段,力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统,构建投资组合。其中,核心模型包括成长性模型、多因子Alpha模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势,定期或不定期地对模型进行复核,并做出相应调整,以不断改善模型的适用性。
业绩比较基准	95%×罗素1000成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长型股票,属于主动投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。
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
下属分级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
下属分级基金的交易代码	000043 000044
报告期末下属分级基金的份额总额	42,102,901.02份 3,899,447.91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)	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
1.本期已实现收益	1,490,994.73	806,921.67
2.本期利润	2,020,283.24	1,113,054.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0471	0.2883
4.期末基金资产净值	66,443,289.90	37,715,705.88
5.期末基金份额净值	1.578	1.457

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)嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额以人民币申购获得人民币份额,赎回获得人民币赎回款;嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额以美元申购获得美元份额,赎回获得美元赎回款;(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;(4)嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

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	3.07%	0.60%	5.26%	0.49%	-2.19%	0.11%

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

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	5.12%	0.56%	5.26%	0.49%	-0.14%	0.07%

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

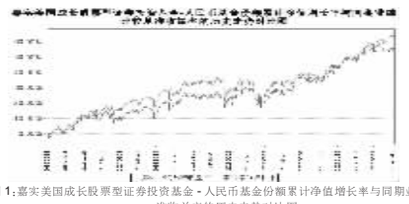

图1:嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月14日至2017年9月30日)

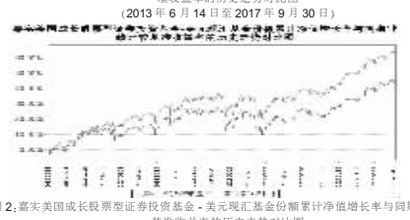

图2:嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月14日至2017年9月30日)

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"第十四部分(三)投资范围和(九)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		
张自力	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实中低波动股票、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理,人工智能投资部负责人	2013年6月14日		21年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学。曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理,支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《嘉实美国成长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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美国股票市场在2017年3季度,整体延续了近几年的持续上涨趋势。金融市场对美联储的加息预期的反应已经逐步弱化,既有加息概率预期的下降,也有加息对整体经济活动影响强度的下降。本季度没有发生重大意外的国际风险事件,市场整体走势平稳,在市场整体表现企稳之下,出现一次较强的市场风格反转,自8月中旬起至季度末,美股市场整体转为小盘和价值股的强势行情,大盘风格和成长风格相对弱势,在此期间,代表小盘价值的罗素1000价值指数比代表大盘成长的罗素1000成长指数跑赢超过6%。

投资业绩上,本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了基本持平的收益,受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响,组合净值层面的超额收益略有减损。行业上,本基金主要配置于信息科技等行业,以高科技龙头企业为主要配置,包括科技企业,新兴人工智能的主力,生物医药领域的高科技企业等,第二大配置行业为非必须消费品。

本报告期间,本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长,单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤,涉及国内外券商和银行的多个环节,在市场大幅震荡背景下,申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩,本基金在保证90%股票仓位和5%现金仓位的合规约束下,成功实现了流动性操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为1.578元,本报告期基金份额净值增长率为3.07%;截至本本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为1.457美元,本报告期基金份额净值增长率为5.12%;同期业绩比较基准收益率为5.26%。

4.5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	89,343,288.49	84.84
	其中:普通股	87,910,083.18	83.48
	优先股	-	-
	存托凭证	1,433,205.31	1.36
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	8,863,765.92	8.42
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	26,339.60	0.03
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	26,339.60	0.03
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,316,143.41	6.00
8	其他资产	755,317.66	0.72
9	合计	105,304,855.08	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	89,343,288.49	85.78
合计	89,343,288.49	85.78

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	15,189,107.21	14.58
必需消费品	2,329,451.35	2.24
能源	-	-
金融	4,848,102.20	4.65
医疗保健	17,002,862.80	16.32
工业	7,194,269.85	6.91
信息技术	41,152,873.92	39.51
原材料	1,060,027.35	1.02
房地产	-	-
电信服务	566,593.81	0.54
公用事业	-	-
合计	89,343,288.49	85.78

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,943	9,147,607.15	8.78
2	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	795	5,072,405.13	4.87
3	Alphabet Inc	Alphabet公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	765	4,943,798.94	4.75
4	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,467	4,185,938.16	4.02
5	NVIDIA Corp	NVIDIA公司	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,328	3,948,600.82	3.79
6	Facebook Inc	Facebook公司	FB UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,390	3,844,419.68	3.69
7	United Health Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约证券交易所	美国	1,924	2,500,886.13	2.40
8	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	1,123	2,312,665.44	2.22
9	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	2,054	1,924,865.60	1.85
10	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约证券交易所	美国	2,029	1,908,709.12	1.83

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	Safeways general merchandise retailer	25,131.22	0.02
2	权证投资	Safeways real-estate development subsidiary PDC	1,208.38	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述2只金融衍生品投资。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	VANECK VECTORS GOLD MINERS E	ETF基金	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	2,747,621.91	2.64
2	ISHARES EUROPE ETF	ETF基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,323,704.13	2.23
3	POWERSHARES QQQ TRUST SERIES	ETF基金	交易型开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	1,163,231.21	1.12
4	GLOBAL X ROBOTICS & ARTIFICI	ETF基金	交易型开放式	Global X Management Co LLC	1,135,621.71	1.09
5	IPATH S&P 500 VIX S/T FU ETN	ETN基金	交易型开放式	Barclays Capital Inc	515,258.32	0.49
6	ISHARES MSCI EMERGING MARKET	ETF基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	412,493.09	0.40
7	VANECK VECTORS JUNIOR GOLD M	ETF基金	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	349,559.68	0.34
8	ISHARES 20+ YEAR TREASURY BO	ETF基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	215,285.11	0.21
9	ISHARES RUSSELL 3000 ETF	ETF基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	990.76	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述9只基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	528,548.11
3	应收股利	19,127.61
4	应收利息	457.33
5	应收申购款	207,184.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	755,317.66

5.10.4 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。

5.10.5 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,本基金前十名股票投资中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元
报告期期初基金份额总额	44,000,428.55	3,865,572.46
报告期期间基金总申购份额	10,649,186.31	185,504.18
减:报告期期间基金总赎回份额	12,546,713.84	151,628.73
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	42,102,901.02	3,899,447.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实美国成长股票型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)报告期内嘉实美国成长股票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

2017年10月25日

嘉实领先成长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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	嘉实领先成长混合
基金主代码	070022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月31日
报告期末基金份额总额	1,208,009,454.17份
投资目标	本基金致力于挖掘中国经济中快速成长的行业,并投资于其中领先成长的企业,在严格控制风险的前提下,力争为基金持有人获取长期、持续的超额收益。
投资策略	在大类资产配置上,首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,在控制风险的前提下优先配置股票资产;在股票选择层面,本基金将在快速成长行业备选库中寻找市场占有率较高、具有较强竞争优势的领先成长公司。在债券投资方面,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。
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	中国农业银行股份有限公司

§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	39,415,855.67
2.本期利润	21,628,442.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0153
4.期末基金资产净值	2,366,991,945.88
5.期末基金份额净值	1.959

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	1.56%	0.72%	4.41%	0.56%	-2.85%	0.16%

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

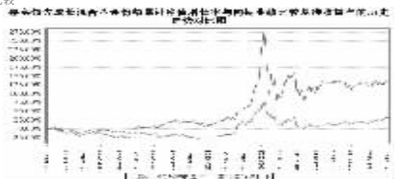

图:嘉实领先成长混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年5月31日至2017年9月30日)

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、基金的投资(三)投资范围和(七)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		
邵秋涛	本基金、嘉实成长收益混合、嘉实成长增强混合基金经理,股票投资业务助理CIO兼股票投资部总监	2011年5月31日		19年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券,从事行业研究工作,先后担任研究员、高级研究员;2006年12月加盟嘉实基金管理有限公司,历任公司高级研究员、投资经理、现任助理CIO兼股票投资部总监。金融硕士,具有基金从业资格,澳大利亚籍。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《嘉实领先成长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

2017年3季度中国宏观经济小幅回落但仍处于平稳运行状态。工业增加值增速从2017年6月的7.6%小幅回落到7月的6.4%、和8月的6%;通胀小幅回升但依然可控,从2017年6月的1.5%提高到8月的1.8%,但扣除食品后的核心通胀自2017年3月以来持续高于2%;PPI高位运行,8月达到8.3%。

受益于上游原材料价格上涨,钢铁、煤炭、化工、有色等周期股表现突出,推动中国A股震荡上行,上证综指3季度上涨4%。

传统产业受益于供给侧改革和环保约束,供给大幅收缩,价格上涨,享受了供给侧改革红利;但是其相对于经济总量而言是相对萎缩的,显然无法推动中国经济长期健康发展。

这意味着,要想跨越中等收入陷阱,实现长期可持续发展,还是要依靠转型创新才能形成新的经济增长点。我们相信,受益于中国经济转型创新的新经济产业,蕴含着巨大的投资机遇。

感谢持有人对我们的长期信任和支持。我们将继续以新消费、新服务、新科技、新改革为主要方向,在新经济领域深度挖掘长线空间巨大、成长确定、估值合理、治理良好的优秀上市公司,力争为持有人获取长期稳定的良好回报。

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1.959元;本报告期基金份额净值增长率为1.56%,业绩比较基准收益率为4.41%。

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	2,182,914,293.67	90.87
	其中:股票	2,182,914,293.67	90.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,946,000.00	1.25
	其中:债券	29,946,000.00	1.25
	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	171,210,900.86	7.13
8	其他资产	18,063,384.10	0.75
9	合计	2,402,134,578.63	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	39,793.60	0.00
C	制造业	1,663,240,081.67	70.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	65,887,050.00	2.78
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	171,141,956.03	7.23
J	金融业	73,501,925.00	3.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,574,000.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	77,320,040.00	3.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	54,094,842.99	2.29
R	文化、体育和娱乐业	75,031,553.58	3.17
S	综合	-	-
	合计	2,182,914,293.67	92.22

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	002614	奥佳华	12,900,000	226,266,000.00	9.56
2	601799	星宇股份	3,657,454	182,250,932.82	7.70
3	000858	五粮液	3,000,034	171,841,947.52	7.26
4	002439	启明星辰	7,729,200	171,124,488.00	7.23
5	600176	中国巨石	13,829,200	158,482,632.00	6.70
6	000513	丽珠集团	2,384,467	120,892,476.90	5.11
7	603579	荣泰健康	2,012,722	118,750,598.00	5.02
8	600887	伊利股份	4,000,000	110,000,000.00	4.65
9	002236	大华股份	4,034,219	97,103,651.33	4.10
10	300274	阳光电源	5,477,555	92,187,250.65	3.89

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,946,000.00	1.27
	其中:政策性金融债	29,946,000.00	1.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,946,000.00	1.27

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	170408	17农发01	300,000	29,946,000.00	1.27

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

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	957,808.09
2	应收证券清算款	16,255,536.05
3	应收股利	-
4	应收利息	515,800.81
5	应收申购款	334,239.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,063,384.10

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	1,602,153,681.56
报告期期间基金总申购份额	294,941,951.84
减:报告期期间基金总赎回份额	689,086,179.23
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	1,208,009,454.17

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,436,113.57
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	4,436,113.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.37

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 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	2017/09/15至2017/09/30	-	248,942,389.00	-	248,942,389.00	20.61
	2	2017/07/01至2017/07/09	338,678,935.66	-	338,678,935.66	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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)中国证监会批准嘉实领先成长混合型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实领先成长混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实领先成长混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实领先成长混合型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)报告期内嘉实领先成长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

嘉实量化阿尔法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