

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。

本报告期的财务数据未经审计。

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	嘉实逆向策略股票型证券投资基金
基金代码	000985
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月12日
基金份额总额	1,486,886,952.00份
基金资产净值	1,486,886,952.00元
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

主要财务指标		报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)			
1.本期实现收益	收入	17,457,307.83			
2.本期利润	收入	140,291,407.23			
3.期初现金余额本期变动		8,089.99			
4.期末现金余额	净值	1,804,985,957.12			
5.期末可供分配利润	净值	1,230.00			

(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，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

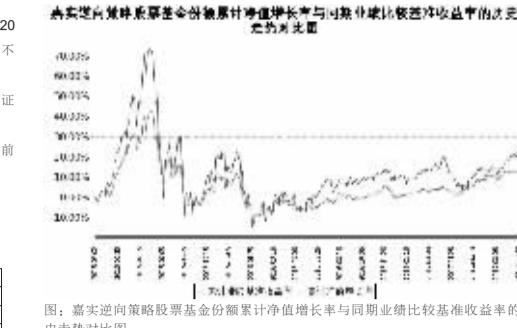
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较基	净值增长	业绩比较基
过去3月	8.08%	0.90%	3.84%	0.47%	4.24%

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

嘉实逆向策略股票型证券投资基金

2017年第三季度报告



图：嘉实逆向策略股票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

(2015年2月12日至2017年9月30日)

注：按本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”的有关规定。

§ 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
葛东源	本基金基金经理	2015年2月2日	13年	曾担任证券分析师，2007年9月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究员、行业研究员、研究部研究总监、基金经理助理、基金经理等职，现任基金经理，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)基金经理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，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、《嘉实逆向策略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《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》和公司《公平交易制度》，经评估各投资产品的风险水平，本基金尚属股票型基金，主要通过沪深交易所进行买卖，涉及的行业广，且买入卖出的股票品种繁多，因此，本基金在公平交易方面不存在明显异常。

3.2.3 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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在异常交易行为。

3.2.4 报告期内基金投资组合类别的前20名股票

注：按本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”的有关规定。

3.2.5 报告期内债券投资组合情况

注：按本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”的有关规定。

3.2.6 报告期内股票投资组合的重大关联交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.7 报告期内基金的融资融券交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.8 报告期内基金的衍生品投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.9 报告期内基金的投资组合报告

注：按本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”的有关规定。

3.2.10 报告期内基金的资产支持证券投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.11 报告期内基金的国债期货投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.12 报告期内基金的股票期权投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.13 报告期内基金的沪股通交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.14 报告期内基金的融资融券交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.15 报告期内基金的资产支持证券投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.16 报告期内基金的国债期货投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.17 报告期内基金的股票期权投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.18 报告期内基金的沪股通交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.19 报告期内基金的融资融券交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.20 报告期内基金的资产支持证券投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.21 报告期内基金的国债期货投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.22 报告期内基金的股票期权投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.23 报告期内基金的沪股通交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.24 报告期内基金的融资融券交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.25 报告期内基金的资产支持证券投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.26 报告期内基金的国债期货投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.27 报告期内基金的股票期权投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.28 报告期内基金的沪股通交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.29 报告期内基金的融资融券交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.30 报告期内基金的资产支持证券投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.31 报告期内基金的国债期货投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.32 报告期内基金的股票期权投资

注：按本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”的有关规定。

3.2.33 报告期内基金的沪股通交易

注：按本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”的有关规定。

3.2.34 报告期内基金的融资融券交易

注：按本基金合同和招募