

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、准确和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人中行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，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。投资人投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期的财务资料未经审计。

§ 2基金产品概况

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 基金简称       | 嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金 |
| 基金主代码      | 070203                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2011年8月1日                    |
| 报告期末基金资产总额 | 94,774,322.91                |

投资目标

紧密跟踪由基本面120ETF（深证基本面120指数）的走势，追求与同行业绩比较基准收益变动的比较基准。

投资策略

本基金通过投资于标的ETF，在投资操作上利用本基金在场内合成分仓、风险分散、流动性强等优势，力求通过与标的ETF的紧密跟踪，实现与标的ETF的收益相比较基准收益变动的比较基准。

业绩比较基准

深证基本面120ETF（深证基本面120指数）的收益率×95%+银行定期存款利率（税后）×5%

风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，本基金为指数型基金，被动跟踪的指数的预期收益率具有与标的指数类似的特征。

基金管理人

嘉实基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

§ 2.1 基金基本概况

基金名称 深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人 嘉实基金管理有限公司 159910

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年8月1日

报告期末基金资产总额 94,774,322.91

投资目标

紧密跟踪由基本面120ETF（深证基本面120指数）的走势，追求与同行业绩比较基准收益变动的比较基准。

投资策略

本基金通过投资于标的ETF，在投资操作上利用本基金在场内合成分仓、风险分散、流动性强等优势，力求通过与标的ETF的紧密跟踪，实现与标的ETF的收益相比较基准收益变动的比较基准。

业绩比较基准

深证基本面120ETF（深证基本面120指数）的收益率×95%+银行定期存款利率（税后）×5%

风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，本基金为指数型基金，被动跟踪的指数的预期收益率具有与标的指数类似的特征。

基金管理人

嘉实基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

§ 2.2 基金基本信息说明

基金名称 深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人 嘉实基金管理有限公司 159910

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年8月1日

报告期末基金资产总额 94,774,322.91

投资目标

紧密跟踪由基本面120ETF（深证基本面120指数）的走势，追求与同行业绩比较基准收益变动的比较基准。

投资策略

本基金通过投资于标的ETF，在投资操作上利用本基金在场内合成分仓、风险分散、流动性强等优势，力求通过与标的ETF的紧密跟踪，实现与标的ETF的收益相比较基准收益变动的比较基准。

业绩比较基准

深证基本面120ETF（深证基本面120指数）的收益率×95%+银行定期存款利率（税后）×5%

风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，本基金为指数型基金，被动跟踪的指数的预期收益率具有与标的指数类似的特征。

基金管理人

嘉实基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

§ 2.3 主要财务指标

报告期 2017年7月1日至2017年9月30日

净值增长率 10,954,827.60

净值增长率标准差 10,237,003.44

报告期平均基金份额本期利润 0.0875

报告期末基金份额总额 161,511,398.74

基金管理人报酬率 1,7042

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，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

§ 2.4 基金净值各项

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 0.73% 净值增长率标准差 4.72% 净值增长率差额 0.47% 净值增长率差额标准差 0.06%

过去三个月 5.38% 0.77% 4.72% 0.77% 0.60% 0.04%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 73.73% 净值增长率标准差 0.88% 净值增长率差额 3.30% 净值增长率差额标准差 0.41%

过去三个月 73.73% 0.88% 3.30% 0.41% 40.7% 0.47%

§ 2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

最近一月 净值增长率 7