嘉实腾讯自选股大数据策略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。

基金托管人中国工商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	嘉实腾讯自选股大数据策略股票
基金主代码	001637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 12 月 7 日
报告期末基金份额总额	441,069,486.52 份
投资目标	本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将腾讯自选股大数据和行为金融模型相结合,构建大数据量化投资策略模型,在此基础上生成基金股票组合,力争获得长期、持续的超额收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率 *90%+ 中证综合债券指数收益率 *10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 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	34,641,556.40
2.本期利润	46,902,486.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0987
4.期末基金资产净值	510,415,758.51
5.期末基金份额净值	1.157

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	8.84%	0.91%	4.97%	0.57%	3.87%	0.34%

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

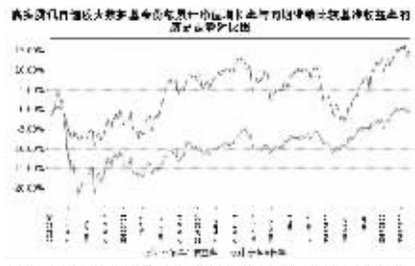

图:嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 12 月 7 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(二)投资范围和(四)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		
龙昌伦	本基金、嘉实对冲套利定期混合基金经理	2017年6月22日		4年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部,从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于股票投资部。
刘斌	本基金、嘉实他对收益策略定期混合、嘉实对冲套利定期混合基金经理	2015年12月7日		11年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部,从事投资、研究工作。博士,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理刘斌的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理龙昌伦的任职日期是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《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,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、《嘉实腾讯自选股大数据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 年三季度,市场整体流动性保持中性,在企业盈利能力超预期的情况下,市场迎来普涨行情。从宏观逻辑层面来看,基于宏观量化模型的推演,我们认为中国经济仍处于长期下行的趋势,但微观经济数据则表明短期需求结构并未变差,同时流动性在宏观调控下维持平稳,因此宏观基本面和流动性都不是当前估值以及风格转换的核心变量和主要矛盾。在这样的环境下,微观层面变得更加重要,特别是企业自身盈利能力。而反映到市场表现上,由于前期流动性偏紧状态得到缓解,投资者风险偏好逐渐提升,投资者逐渐从之前市值较大、ROE 较高的绩优白马股转向业绩大幅改善且弹性较强的周期类股票。行业方面,有色金属、钢铁、煤炭和食品等行业涨幅居前,而传媒、纺织服装、电力和医药则表现相对较差。总体而言,在无风险利率保持稳定的三季度,企业盈利成为最重要的驱动因素,市场呈现普涨下的个股分化行情。

本基金始终依据腾讯自选股等相关数据,深入挖掘用户的选股行为模式,同时发挥嘉实基金的量化研究优势,结合价值、成长、流动性等传统金融数据指标,选取成长性较好的优质公司,剔除基本面和流动性较差的股票,最终构建大数据组合。

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 1.157 元;本报告期基金份额净值增长率为 8.84%,业绩比较基准收益率为 4.97%。

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	453,059,193.96	87.80
	其中:股票	453,059,193.96	87.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	20,000,000.00	3.88
	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	39,766,705.85	7.71
8	其他资产	3,198,820.02	0.62
9	合计	516,024,719.83	100.00

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 年三季度,市场整体流动性保持中性,在企业盈利能力超预期的情况下,市场迎来普涨行情。从宏观逻辑层面来看,基于宏观量化模型的推演,我们认为中国经济仍处于长期下行的趋势,但微观经济数据则表明短期需求结构并未变差,同时流动性在宏观调控下维持平稳,因此宏观基本面和流动性都不是当前估值以及风格转换的核心变量和主要矛盾。在这样的环境下,微观层面变得更加重要,特别是企业自身盈利能力。而反映到市场表现上,由于前期流动性偏紧状态得到缓解,投资者风险偏好逐渐提升,投资者逐渐从之前市值较大、ROE 较高的绩优白马股转向业绩大幅改善且弹性较强的周期类股票。行业方面,有色金属、钢铁、煤炭和食品等行业涨幅居前,而传媒、纺织服装、电力和医药则表现相对较差。总体而言,在无风险利率保持稳定的三季度,企业盈利成为最重要的驱动因素,市场呈现普涨下的个股分化行情。

本基金始终依据腾讯自选股等相关数据,深入挖掘用户的选股行为模式,同时发挥嘉实基金的量化研究优势,结合价值、成长、流动性等传统金融数据指标,选取成长性较好的优质公司,剔除基本面和流动性较差的股票,最终构建大数据组合。

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 1.157 元;本报告期基金份额净值增长率为 8.84%,业绩比较基准收益率为 4.97%。

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	453,059,193.96	87.80
	其中:股票	453,059,193.96	87.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	20,000,000.00	3.88
	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	39,766,705.85	7.71
8	其他资产	3,198,820.02	0.62
9	合计	516,024,719.83	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	16,042,355.00	3.14
B	采矿业	32,089,259.60	6.29
C	制造业	258,896,900.31	50.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,761,224.92	2.30
E	建筑业	8,229,119.17	1.61
F	批发和零售业	27,198,535.45	5.33
G	交通运输、仓储和邮政业	13,128,847.91	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,411,050.25	6.15
J	金融业	2,365,275.00	0.46
K	房地产业	28,176,203.00	5.52
L	租赁和商务服务业	12,834,365.09	2.51
M	科学研究和技术服务业	2,357,069.27	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	3,568.50	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	8,450,120.50	1.66
S	综合	-	-
	合计	453,059,193.96	88.76

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	600410	华胜天成	913,872	10,189,672.80	2.00
2	000426	兴业矿业	925,600	10,172,344.00	1.99
3	000951	中国重汽	525,900	10,013,136.00	1.96
4	600161	天坛生物	292,900	9,627,623.00	1.89
5	601168	西部矿业	1,004,500	9,261,490.00	1.81
6	000517	荣安地产	2,118,900	8,962,947.00	1.76
7	002496	辉丰股份	1,635,400	8,814,806.00	1.73
8	600415	小商品城	1,250,100	8,788,203.00	1.72
9	600282	南钢股份	1,570,200	8,698,908.00	1.70
10	300122	智飞生物	320,700	8,591,553.00	1.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

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	187,546.13
2	应收证券清算款	2,304,613.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-18,600.79
5	应收申购款	725,261.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,198,820.02

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没有流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	517,210,832.47
报告期期间基金总申购份额	97,352,755.88
减:报告期期间基金总赎回份额	173,494,101.83
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	441,069,486.52

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实腾讯自选股大数据策略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)报告期内嘉实腾讯自选股大数据策略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

嘉实文体娱乐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	嘉实文体娱乐股票
基金主代码	003053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 9 月 7 日
报告期末基金份额总额	276,169,050.39 份
投资目标	本基金通过投资于文体娱乐行业中具有长期稳定成长性的上市公司,在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面、资金面和估值等五个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。对文体娱乐主题相关产业的发展进行密切跟踪,在个股选择上采用定性和定量相结合的方法;通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,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	中证文体指数× 80%+ 中债综合指数× 20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§ 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	12,123,297.16
2.本期利润	13,423,759.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400
4.期末基金资产净值	291,239,747.51
5.期末基金份额净值	1.102

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)嘉实文体娱乐股票 A 收取认(申)购费和赎回费,嘉实文体娱乐股票 C 不收取认(申)购费但收取赎回费,计提销售服务费。(3)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	3.38%	0.27%	1.08%	0.01%	2.30%	0.26%

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

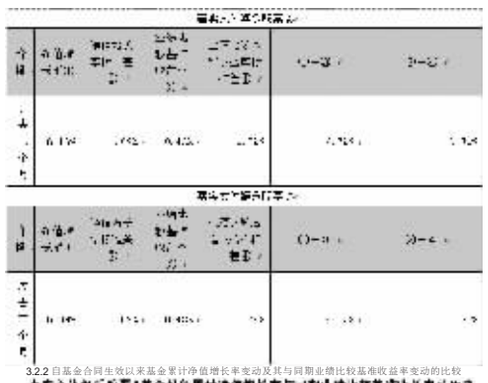

图 2:嘉实文体娱乐股票 C 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 9 月 7 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(二)投资范围和(四)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		
王凯	本基金基金经理	2016年 9 月 7 日		7年	曾任职于景顺长城基金管理有限公司,担任行业研究员一职。2013 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司研究部,从事计算机、传媒等行业研究工作。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。

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 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,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、《嘉实文体娱乐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 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度上证综指上涨 4.9%,沪深 300 指数上涨 4.63%。市场在经历了 2 季度的金融去杠杆以后,逐步从极度悲观的预期中恢复过来。随着经济数据的发布,市场对经济的信心也在逐步加强,从而推动了整个市场的上涨。A 股市场在 3 季度仍然维持了分化行情,在补库存、环保限产和供给侧改革的背景下,周期品相关的板块表现较好,有色、煤炭、钢铁等板块涨幅靠前,而纺织、传媒等板块跌幅靠前。

本基金的主要操作是高位减持了苹果产业链相关的公司,增持了传媒板块中潜在被低估的龙头公司。随着 iPhone 8 和 iPhone X 的发布,行业最大的催化剂结束并且进入了销量验证期。我们认为 iPhone 8 的销量可能会低于预期,而 iPhone X 可能会受制于供应链产能而供不应求,从而导致总量低于预期,相关产业链的个股业绩增长存在阶段性的向下风险。传媒行业今年整体表现不佳,行业指数大幅跑输上证和沪深 300 指数,行业龙头的估值水平也都处于历史相对低位,我们认为未来有修复和上涨的可能性,所以我们增持了营销和影视板块里的龙头公司。另一方面,本基金也增持了 LED 行业的一些龙头公司。随着价格的下降,LED 替代传统发光源开始进入加速期,并且大量的应用在户外广告、显示照明和娱乐设备中。我们看好行业未来的发展前景和相关公司估值相对较低的优势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 A 基金份额净值为 1.086 元,本报告期基金份额净值增长率为 6.16%;截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 C 基金份额净值为 1.080 元,本报告期基金份额净值增长率为 6.09%;同期业绩比较基准收益率为 -0.43%。

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	271,801,824.74	89.59
	其中:股票	271,801,824.74	89.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	30,534,325.94	10.06
8	其他资产	1,040,113.83	0.34
9	合计	303,376,264.51	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	-	-
C	制造业	149,919,432.25	50.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
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	65,954,669.00	22.00
J	金融业	6,362,145.00	2.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,291,326.00	4.43
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	36,243,159.05	12.09
S	综合	-	-
	合计	271,801,824.74	90.68

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	300097	智云股份	867,195	25,538,892.75	8.52
2	600703	三安光电	926,400	21,436,896.00	7.15
3	002008	大族激光	486,524	21,212,446.40	7.08
4	002439	启明星辰	838,700	18,568,818.00	6.19
5	002343	慈文传媒	354,700	13,730,437.00	4.58
6	002027	分众传媒	1,322,520	13,291,326.00	4.43
7	300232	洲明科技	815,100	12,332,463.00	4.11
8	002555	三七互娱	432,500	9,644,750.00	3.22
9	600563	法拉电子	139,093	8,039,575.40	2.68
10	002449	国星光电	388,500	7,478,625.00	2.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

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	257,058.73
2	应收证券清算款	139,806.73
3	应收股利	-
4	应收利息	5,426.29
5	应收申购款	637,822.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,040,113.83

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没有流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
报告期期初基金份额总额	476,963,213.04	41,856,577.35
报告期期间基金总申购份额	17,423,698.61	10,919,966.25
减:报告期期间基金总赎回份额	250,263,334.28	20,731,070.58
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	244,123,577.37	32,045,473.02

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实文体娱乐股票型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实文体娱乐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

嘉实稳固收益债券型证券投资基金

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。

基金托管人中国工商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	嘉实稳固收益债券
基金主代码	070020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年 9 月 1 日
报告期末基金份额总额	264,333,485.02 份
投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力争持续稳定地获得高于存款利率的收益。
投资策略	运用本金保护机制(包括嘉实护本目标抬升机制、嘉实固定比例投资组合保险机制、嘉实债券组合风险控制措施)、课求有效控制投资风险。以"3 年运作周期滚动"的方式,实施开放式运作。 优先配置债券类资产;投资于剩余期限匹配组合当期运作期剩余期限、具有较高信用等级的中短期债券,以持有到期策略为主;择机少量投资权益类资产;采用收益增强型权益类投资策略。
业绩比较基准	本基金当期运作期平均年化收益率 = 三年期定期存款利率 + 1.6%
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型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 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	12,123,297.16
2.本期利润	13,423,759.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400
4.期末基金资产净值	291,239,747.51
5.期末基金份额净值	1.102

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)嘉实文体娱乐股票 A 收取认(申)购费和赎回费,嘉实文体娱乐股票 C 不收取