

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：中国建设银行股份有限公司

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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设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。

本报告期内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

基金基本情况	
基金名称	嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金
基金代码	000406
基金类型	债券型基金
基金合同生效日	2017年3月16日
报告期末基金资产净值	4,999,476,648.00
报告期末基金份额总额	5,000,200,268.00
基金总资产	5,000,200,268.00
基金总负债	-5,000,200,268.00
基金份额净值	1.0000
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	
报告期	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	54,792,125.29
2.本期利润	54,579,435.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109
4.期末基金资产净值	5,092,200,268.00
5.期末基金份额净值	1.0002

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

报告期	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-②	③-④
2017年7月1日至2017年9月30日	1.09%	0.02%	-0.42%	0.00%	1.51%	-0.04%

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

# 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

### 嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金历史业绩对比图



图：嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金历史业绩对比图

(2017年3月16日至2017年9月30日)

注：1.本基金基金合同生效日2017年3月16日至报告期末未满1年。按基金合同及相关招募说明书的约定，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。

2.增聘谢思维女士担任本基金基金经理，与基金经理曲扬女士共同管理本基金。

§ 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	性别	任职日期	离任日期	当年从业年限	说明
基金经理	女	2017年7月6日		6年	基金经理曲扬女士，2011年7月加入公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务，现任本基金基金经理。
基金经理	女	2017年7月16日		13年	基金经理谢思维女士，2004年7月加入公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务，现任本基金基金经理。
基金经理	男	2017年4月18日		14年	基金经理曲扬先生，2003年11月加入公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务，现任本基金基金经理。
基金经理	男	2017年7月12日		14年	基金经理谢思维先生，2004年7月加入公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务，现任本基金基金经理。

注：(1)本基金经胡永萍的任职日期起指本基金合同生效之日，基金经理王亚明的任职日期起指本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合规情况的说明

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》及其他各项配套法规、《嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚信、信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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作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 管理人对基金投资策略和操作分析

报告期内，本基金严格按照基金合同规定的投资范围和投资比例进行投资，不存在违反基金合同约定的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年第三季度经济数据呈现低开高走的格局，7月受到基数因素、财政投放力度减弱、环保压力等原因，经济数据整体偏弱，但8-9月逐步改善，整体经济运行较为平稳，三季度整体经济运行较为稳定，但三季度末整体信贷和社融增速仍然保持相对稳定，债券发行量有所回升，对实体经济资金支持仍然保持较快水平。流动性方面，8-9月资金面依然较为宽松，但随着货币基金快速增长，而非银机构配置仓位提升，以及央行面对资金面的超预期宽松，资金利率持续下行，市场对于央行政策的预期也得到一定修复，9月末在季末和跨节因素的影响下资金利率有所回调，但整体仍维持在较低水平。

在基本面和流动性没有趋势性变化的情况下，债券市场逐步修复，6-7月的前期利差压缩较为明显，超长期利率债收益率下行20-30bp，中高等级信用债由于流动性较弱，估值调整幅度不大。

权益市场方面，股市7月在实体低库存和流动性宽松预期下，周期股和创业板

## 5.1 重要提示

报告期末，本基金未持有股票。

5.2 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

报告期末，本基金未持有股票。

## 5.3 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。

## 5.4 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

报告期末，本基金未持有股指期货。

## 5.10 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国债期货投资明细

报告期末，本基金未参与国债期货交易。

## 5.11 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## 5.12 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组合

报告期末，本基金未持有股票。

## 5.13 其他资产构成

报告期末，本基金未持有其他资产。

## 5.11.3 其他资产构成

报告期末，本基金未持有其他资产。

序号	类别	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收保证金	-	-
2	应收交易费用	-	-
3	应收利息	269,457,000.00	5.34
4	应收申购款	269,457,000.00	5.34
5	应收赎回款	50,190,000.00	0.99
6	应收股利	3,815,530,150.00	75.51
7	应收申购款	-	-
8	应收利息	811,858,000.00	16.08
9	其他	-	-
10	合计	4,945,035,150.00	97.92

88,165,105.65

## 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，本基金未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

报告期：单位：份

报告期初基金份额总额	报告期期间内增加份额	报告期末基金份额总额
4,999,035,150.00	366,000.00	5,000,391,150.00
报告期初基金份额总额	报告期期间内增加份额	报告期末基金份额总额
4,999,035,150.00	366,000.00	5,000,391,150.00

4,999,476,648.00

## § 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 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内单一投资者持有基金份比例达到或超过 20%的情况

报告期初单一投资者持有基金份比例达到或超过 20%的情况	报告期期间内单一投资者持有基金份比例变动情况	报告期末单一投资者持有基金份比例
序号	报告期初代持代码	报告期初代持名称
1	2017070125	170701MTN1
2	1382275	131707MTN1
3	1117654	171707C0204
4	1382075	131707MTN1
5	123645	1217