嘉实新兴产业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	嘉实新兴产业股票
基金主代码	000751
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月17日
报告期末基金份额总额	236,966,585.96份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，分享新兴产业带来的投资机会，力求获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金重点配置股票资产，同时从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个维度进行综合分析，严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。 本基金相对淡化宏观指标，从中观层面分析各行业和上市公司的不同特征，识别经济发展过程中具有良好发展前景、竞争结构相对稳定的行业，从中挑选具备卓越商业模式和较强竞争力的优质企业。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×95%＋中国债券总指数收益率×5%
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	22,183,605.84
2.本期利润	27,440,763.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.1282
4.期末基金资产净值	470,004,351.01
5.期末基金份额净值	1.983

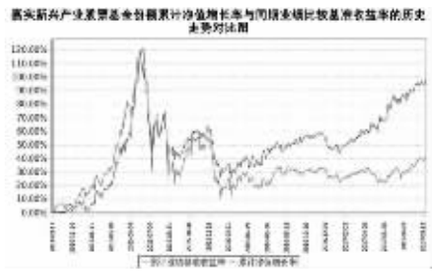
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.02%	0.85%	6.42%	0.81%	0.60%	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



图：嘉实新兴产业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

(2014年9月17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		
季文华	本基金、嘉实优化红利混合基金经理	2016年3月15日		6年	曾任兴业证券证券研究分析师。2012年加入嘉实基金管理有限公司，任研究部研究员一职。

注：(1)基金经理的任职日期是指公司作出决定后公告之日，离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、《嘉实新兴产业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

从宏观层面来看，今年经济超出年初的预期，一方面房地产投资增速接近两位数，非常强劲。另一方面，今年出口增长也非常靓丽。展望未来12个季度，地产在三四线城市改善性需求和棚改带动下将表现出较强韧性，结合各发达经济体各部门杠杆健康、复苏稳健的背景，国内经济增长整体大概率继续呈现平稳下行格局。充分说明中国经济有较大的韧性，预计L型的走势会维持一段时间。

近期流动性格局保持平稳，需求数据略有回落和维稳因素下市场继续呈现震荡格局。长期看，海外资金加速流入、资本账户管理和地产调控的持续进行利好资金对权益资产配置。微观层面，需要关注产能出清和环保趋势下经济触底的态势。而估值方面，目前市场整体，尤其是大市值蓝筹板块的估值水平并不高，盈利平稳增长将逐步推升指数水平。从经济动能积蓄、估值与业绩增长匹配度、资金配置流向等角度出发，我们对市场中长期表现持更加积极的态度。未来一段时间，工业品的价格上涨会面临强约束，但在供给收缩、环保趋严态势下，龙头企业份额将获得持续提升。另外，成长板块中，已有部分公司的估值与成长匹配度呈现显著吸引力。

从投资策略来看，市场环境、供需以及海外投资者“北上”等因素对市场结构性的影响在今年已经有一定程度的体现。未来应当适度淡化风格因素，价值和成长内部都会出现比较大的分化现象。公司质地、核心竞争力、业绩的可达性这些因素无为重要。A股纳入MSCI指数将对资本市场产生深远的影响，真正的价值投资会迎来春天。高估值中小盘成长股整体面临估值调整和分化的较大压力，不宜轻言见底。我们加强了对个股估值和业绩的要求的评估，大幅提高对成长类个股的投资标准，防范可能的估值收缩风险。

回顾本组合的运作，我们的策略积极寻找结构性机会。至上而下两条思路：一是放眼全球范围内，中国有竞争力的制造业，比如家电制造、电子制造等。二是看好国内巨大的消费市场，消费升级是一个大的趋势。因此在资产配置上，我们重点布局了大消费和电子板块。大消费领域重点配置了食品饮料、家电家具、医疗保健和保险板块，电子领域重点配置了苹果产业链和安防。

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1.983元；本报告期基金份额净值增长率为7.02%，业绩比较基准收益率为6.42%。

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	434,470,403.15	91.88
	其中：股票	434,470,403.15	91.88
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	36,733,412.84	7.77
8	其他资产	1,676,105.11	0.35
9	合计	472,879,921.10	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	0.01
C	制造业	337,432,404.23	71.79
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	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	48,852,090.00	10.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	47,930,296.50	10.20
S	综合	-	-
	合计	434,470,403.15	92.44

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	600036	招商银行	1,363,000	34,824,650.00	7.41
2	002415	海康威视	1,039,819	33,274,208.00	7.08
3	000858	五粮液	458,224	26,247,070.72	5.58
4	002008	大族激光	582,417	25,393,381.20	5.40
5	600809	山西汾酒	451,249	24,841,257.45	5.29
6	300251	光线传媒	2,224,400	24,334,936.00	5.18
7	000661	长春高新	162,906	24,199,686.30	5.15
8	603096	新经典	392,000	23,551,360.00	5.01
9	002236	大华股份	956,100	23,013,327.00	4.90
10	002572	索菲亚	469,800	17,758,440.00	3.78

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	240,322.93
2	应收证券清算款	98,847.58
3	应收股利	-
4	应收利息	6,482.61
5	应收申购款	1,330,451.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,676,105.11

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	211,097,561.62
报告期期间基金总申购份额	115,707,470.43
减：报告期期间基金总赎回份额	89,838,446.09
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	236,966,585.96

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)中国证监会核准嘉实新兴产业股票型证券投资基金募集的文件；

(2)《嘉实新兴产业股票型证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实新兴产业股票型证券投资基金招募说明书》；

(4)《嘉实新兴产业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)报告期内嘉实新兴产业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：Email:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017年10月25日

嘉实新消费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	嘉实新消费股票
基金主代码	001044
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月23日
报告期末基金份额总额	1,351,346,345.10份
投资目标	本基金优选消费行业股票，在严格控制投资风险的条件下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，或在大类资产配置，主要通过消费行业子行业间的灵活配置和行业内个股的精选实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%＋中债总指数收益率×5%
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

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	108,344,291.57
2.本期利润	73,592,063.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0498
4.期末基金资产净值	1,731,437,117.15
5.期末基金份额净值	1.281

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	4.49%	0.80%	4.11%	0.76%	0.38%	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

图：嘉实新消费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3月23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		
谭丽	本基金、嘉实沪港深回报混合基金经理	2017年4月11日		16年	曾在北京海问投资咨询有限公司、国信证券股份有限公司及泰达荷银基金管理有限公司任研究员、基金经理助理职务。2007年9月加入嘉实基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理。

注：(1)基金经理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、《嘉实新消费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季度宏观数据印证了国内外经济增长的动能良好，且国内外出现一定程度的共振，市场出现了新周期的论辩，乐观的投资者在逐渐增加，现实是国内经济在需求趋稳、供给侧改革以及环保约束下，上游环节出现盈利的较大幅度改善，并向部分中下游传导，经济在L底的背景下呈现温和复苏态势，因此我们看到表现在3季度的股票市场上，周期股获得了较好的表现，消费行业也获得持续的正收益。

整体经济大环境对于股票投资是比较有利的，尽管在金融去杠杆的背景下，流动性环境仍然有所约束，但经济的强劲表现推动企业盈利增长，从而推动股价的上涨，且各种风格股票表现更加均衡，市场较为活跃，投资机会明显增多。

报告期内，新消费仍然坚持在大消费领域内寻找alpha的投资主旨，对在消费升级背景下的新消费加强研究，我们在中报中提到过我们会在次新股和创业板中，寻找低估的优质企业，进行左侧布局，3季度我们的策略获得了一定的收获，在传媒板块的布局获得了较好的收益，3季度进一步布局了优质传媒个股，我们认为传媒经历了几年前的泡沫破裂之后，估值已经趋于合理，而精神消费无疑是消费升级的主战场之一，目前还处于初期阶段，对应在投资上，会出现长期增长的优质个股。

在3季度我们增加了对优质汽车零部件企业的配置比例，同时加大了在食品饮料以及零售领域的股票配置，食品饮料方面，我们主要买入受益于消费升级的定位高端的额食品饮料个股，另外在经济复苏背景下，具有较强可选消费属性的高端零售也值得重点关注。

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1.281元；本报告期基金份额净值增长率为4.49%，业绩比较基准收益率为4.11%。

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	1,625,738,494.94	93.11
	其中：股票	1,625,738,494.94	93.11
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	114,821,505.60	6.58
8	其他资产	5,539,103.46	0.32
9	合计	1,746,099,104.00	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	97,762,559.36	8.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
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	-	-
J	金融业	29,775,009.00	2.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,146,555.00	0.65
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	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	134,754,509.31	12.25

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	600104	上汽集团	1,327,000	40,062,130.00	3.64
2	000513	丽珠集团	468,588	23,757,411.60	2.16
3	002108	沧州明珠	801,000	11,790,720.00	1.07
4	600885	宏发股份	269,100	11,173,032.00	1.02
5	000001	平安银行	981,300	10,902,243.00	0.99
6	002050	三花智控	656,900	10,562,952.00	0.96
7	601288	农业银行	2,602,900	9,943,078.00	0.90
8	601988	中国银行	2,167,400	8,929,688.00	0.81
9	002027	分众传媒	711,100	7,146,555.00	0.65
10	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.01

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	19,852,000.00	1.81
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	179,056,603.20	16.28
5	企业短期融资券	190,319,000.00	17.31
6	中期票据	211,191,000.00	19.20
7	可转债(可交换债)	1,000.00	-
8	同业存单	585,377,000.00	53.23
9	其他	-	-
10	合计	1,185,796,603.20	107.83

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	111781410	17南京银行CD141	1,000,000	95,520,000.00	8.69
2	111782954	17广州农村商业银行CD146	800,000	76,384,000.00	6.95
3	1382265	13青啤MTN1	500,000	50,175,000.00	4.56
4	111712173	17北京银行CD173	500,000	48,895,000.00	4.45
5	111711400	17平安银行CD400	500,000	48,325,000.00	4.39

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	277,613.23
2	应收证券清算款	3,196,346.12
3	应收股利	-
4	应收利息	22,637.36
5	应收申购款	2,042,506.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,539,103.46

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	1,598,871,417.46
报告期期间基金总申购份额	123,552,477.40
减：报告期期间基金总赎回份额	371,077,549.76
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	1,351,346,345.10

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)中国证监会核准嘉实新消费股票型证券投资基金募集的文件；

(2)《嘉实新消费股票型证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实新消费股票型证券投资基金招募说明书》；

(4)《嘉实新消费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)报告期内嘉实新消费股票型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2存放地点

(1)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

(2)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

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：Email:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017年10月25日

嘉实新添泽定期开放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14日(基金合同生效日)起至2017年9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	嘉实新添泽定期混合
基金主代码	004775
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月14日
报告期末基金份额总额	1,091,732,566.97份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期内，本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四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。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%＋中债综合财富指数收益率×70%
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。
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14日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	6,427,821.51
2.本期利润	7,980,864.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0073
4.期末基金资产净值	1,099,713,431.79
5.期末基金份额净值	1.0073

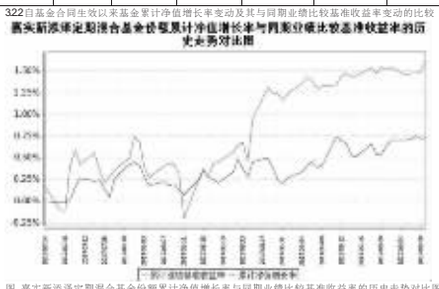
注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。(3)本基金合同生效日为2017年7月14日，本报告期自2017年7月14日起至2017年9月30日止。

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
2017年7月14日(基金合同生效日)至2017年9月30日	0.73%	0.10%	1.63%	0.17%	-0.90%	-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：嘉实新添泽定期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

(2017年7月14日至2017年9月30日)

注：本基金基金合同生效日2017年7月14日至报告期末未满1年。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，本报告期处于建仓期内。

§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		
刘宁	本基金、嘉实增强