

嘉实智能汽车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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实智能汽车股票
基金代码	002168
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月4日
报告期末基金份额总额	198,118,275.30份
投资目标	本基金为股票型基金,在有效控制风险并保持良好的流动性的前提下,把握汽车产业智能化、电动化及后市场服务机会,力求超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将立足宏观,政策面、基本面和资金面等多个维度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金仓位、行业、基金等各类资产配置比例,并根据宏观经济形势和市场环境的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	中证汽车行业指数收益率×80%+沪深300指数收益率×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,其预期风险水平和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。
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

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	12,302,583.34
2.本期利润	30,001,886.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.1547
4.期末基金资产净值	288,273,815.50
5.期末基金份额净值	1.455

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

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	14.03%	1.06%	3.83%	0.62%	10.20%	0.44%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实债券
基金代码	007005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月9日
报告期末基金份额总额	1,332,535,692.57份
投资目标	以本金安全为前提,追求长期组合回报。
投资策略	采取主动的自上而下的投资策略,通过对投资组合的相对价值分析,充分控制收益并追求收益最大化,力求实现长期增值。
业绩比较基准	中证国债指数收益率+中证中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金属于低风险固定收益类基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、高于货币型基金。
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

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	14,532,779.21
2.本期利润	12,610,386.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117
4.期末基金资产净值	1,578,284,030.04
5.期末基金份额净值	1.183

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

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	1.02%	0.07%	0.33%	0.06%	0.69%	0.01%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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	1.1147%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	1.0266%	0.0004%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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	1.1147%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	1.0266%	0.0004%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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	1.1147%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	1.0266%	0.0004%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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	1.1147%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	1.0266%	0.0004%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

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	1.1147%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	1.0266%	0.0004%

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

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01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。

本报告期内无财务资料未审计。
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	嘉实货币宝
基金代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	11,172,399,216.07份
投资目标	本基金为货币型基金,追求资产的流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合考虑市场利率、债券收益率、流动性需求、信用风险等因素,在控制风险的前提下,合理确定基金资产配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	按日计提的中国银行人民币活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为货币型基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

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	62,824,940.97
2.本期利润	62,824,940.97
3.期末基金资产净值	11,172,399,216.07

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现