嘉实中小企业量化活力灵活配置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4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	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合
基金主代码	004536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月4日
报告期末基金份额总额	204,956,191.44份
投资目标	本基金采用积极、主动的量化投资策略,以中小企业经营、发展和创新的内在活力为研究基础,通过系统的专业性研究分析,积极挖掘符合经济规律及产业发展规律的优质中小企业所蕴含的投资机会,在严控投资风险的条件下,追求基金资产的稳健增值。
投资策略	立足于中国资本市场独特的变化,利用综合评价对中小企业经营、发展和创新的内在活力进行由点到面的多层次量化分析,构建包含中小企业投资价值、成长性、创新力、经营质量、管理层模式以及企业文化等方面的全方位投资策略,优选增长潜力最大的中小企业股票进行投资。
业绩比较基准	中证500指数*80%+中证综合债券指数*20%
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,属于较高风险、较高收益的品种。
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4日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	979,974.47
2.本期利润	2,032,132.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092
4.期末基金资产净值	206,994,368.54
5.期末基金份额净值	1.010

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4日,本报告期自2017年7月4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4日(基金合同生效日)至2017年9月30日	1.00%	0.22%	5.66%	0.75%	-4.66%	-0.53%

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

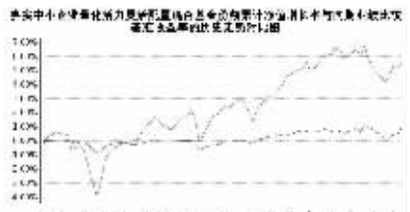

图:嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年7月4日至2017年9月30日)

注:本基金基金合同生效日2017年7月4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		
张自力	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实事件驱动股票基金经理,人工智能投资部负责人	2017年7月4日		21年	理论物理学博士,毕业于美国密歇根大学奥斯汀分校和中国科学技术大学。曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

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、《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合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

报告期内,本基金成立并处于建仓阶段。对中国A股市场中小企业类上市公司进行量化评估,优选估值合理、成长良好、运作稳健以及盈利前景广阔的优选资产构建投资组合,量化策略的执行重点在CPPI风险管控逻辑框架下,有效控制资产净值回撤,考虑合理估值及中小企业的成长性对资产组合的影响力度,积极配置估值合理的优质成长性资产。

风格上,自7月中下旬开始至8月中旬,中小市值与优质成长股票相对大盘和价值风格走出显著反弹行情,持续近一个月的足够强度的风格反转,中断了自去年末开始的价值股强势过程。在这一轮反弹中,更优秀的股票是成长股中估值不虚高,有坚实主营业务支撑,并且经营业绩等财务指标较好的股票,反映出投资者在上市公司盈利能力的确定性有更强诉求,依然放弃概念过度炒作,但已经不局限于白马、保险等稳健型股票,市场已经开始尝试寻找优质成长股。进入9月以来,大盘权重指数如沪深300基本走平,中小板如中证500指数有上探冲高过程,表明市场投资氛围逐渐恢复。

报告期内,本基金遵循谨慎运作的原则,以成长性量化特征及其相关辅助因子作为主导因子,在精耕新作、精选具备长期成长空间和投资价值的中小企业类上市公司的同时,适当进行逆向选择,考虑投资者情绪等影响因子在中小企业成长性投资过程中的影响模式和作用空间,从而提升量化策略进取性。

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1.010元;本报告期基金份额净值增长率为1.00%,业绩比较基准收益率为5.66%。

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	64,542,039.00	29.88
	其中:股票	64,542,039.00	29.88
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	80,600,000.00	37.32
	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	68,534,627.90	31.73
8	其他资产	2,321,556.41	1.07
9	合计	215,998,223.31	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	293,606.00	0.14
B	采矿业	547,370.00	0.26
C	制造业	48,148,317.00	23.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	770,908.00	0.37
F	批发和零售业	1,553,018.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	466,610.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,411,830.00	4.06
J	金融业	978,458.00	0.47
K	房地产业	498,441.00	0.24
L	租赁和商务服务业	522,392.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	471,015.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	831,130.00	0.40
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	1,048,944.00	0.51
S	综合	-	-
	合计	64,542,039.00	31.18

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	600460	士兰微	178,700	1,862,054.00	0.90
2	002766	索菱股份	55,300	1,088,304.00	0.53
3	603005	晶方科技	32,400	1,070,496.00	0.52
4	300045	华力创通	85,100	1,060,346.00	0.51
5	300487	蓝晓科技	54,200	1,051,480.00	0.51
6	300236	上海新阳	29,700	1,041,876.00	0.50
7	600699	均胜电子	28,800	1,021,824.00	0.49
8	300447	全信股份	43,000	1,019,960.00	0.49
9	300445	康斯特	49,900	1,013,968.00	0.49
10	300298	三诺生物	46,500	1,011,840.00	0.49

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

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	中证500股指期货IC1710合约	9	11,838,960.00	66,240.00	-
公允价值变动总额合计(元)					66,240.00
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)					66,240.00

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃、超额收益显著的股指期货合约进行投资。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

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	2,378,545.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-67,702.25
5	应收申购款	10,713.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,321,556.41

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

基金合同生效日(2017年7月4日)持有的基金份额	233,331,386.71
报告期期间基金总申购份额	2,915,774.88
减:报告期期间基金总赎回份额	31,290,970.15
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	204,956,191.44

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中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合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)报告期内嘉实中小企业量化活力灵活配置混合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)北京市西城区国市口大街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,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2017年10月25日

嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金

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	嘉实中关村A股ETF
场内简称	中关村A
基金主代码	159951
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年6月7日
报告期末基金份额总额	55,822,910.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过3%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中关村A股指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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	-1,447,279.98
2.本期利润	-1,270,117.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0071
4.期末基金资产净值	57,756,376.97
5.期末基金份额净值	1.0346

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	2.78%	0.94%	2.24%	1.00%	0.54%	-0.06%

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

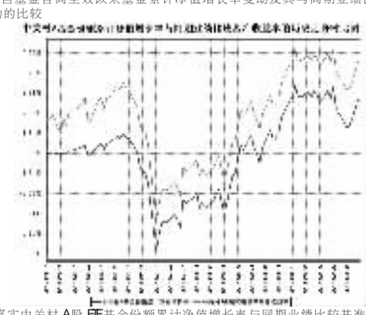

图:嘉实中关村A股ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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3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"第十一部分二、投资范围和六、投资限制(一)投资组合限制"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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2017年6月7日	-	12年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
刘珈吟	本基金、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接基金经理	2017年6月7日	-	8年	2009年加入嘉实基金管理有限公司,曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。

注:(1)基金经理的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管理人对报告期内本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、《嘉实中关村A股交易型开放式指数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

报告期内,本基金处于建仓期,自开放申赎日以来日均跟踪误差为0.09%,年化跟踪误差为1.37%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承指数化投资管理策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

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1.0346元;本报告期基金份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为2.24%。

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	55,914,484.84	95.98
	其中:股票	55,914,484.84	95.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,900.00	0.09
	其中:债券	50,900.00	0.09
	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	2,184,854.84	3.75
8	其他资产	103,561.43	0.18
9	合计	58,253,801.11	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	792,157.20	1.37
C	制造业	28,208,086.80	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	439,299.00	0.76
E	建筑业	5,467,810.00	9.47
F	批发和零售业	642,695.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	151,794.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,924,774.14	25.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	87,216.00	0.15
L	租赁和商务服务业	1,564,159.00	2.71
M	科学研究和技术服务业	554,958.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	1,885,343.00	3.26
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	1,024,092.70	1.77
S	综合	149,490.00	0.26
	合计	55,891,874.84	96.77

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	22,610.00	0.04
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,610.00	0.04

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

5.3.1报告期末指数投资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	000725	京东方A	906,700	3,989,480.00	6.91
2	601390	中国中铁	252,900	2,187,585.00	3.79
3	600031	三一重工	144,300	1,103,895.00	1.91
4	000839	中信国安	96,700	1,083,040.00	1.88
5	300070	碧水源	55,400	997,754.00	1.73
6	300072	三聚环保	32,000	975,360.00	1.69
7	601800	中国交建	56,600	866,546.00	1.50
8	002310	东方园林	39,800	836,198.00	1.45
9	600085	同仁堂	25,700	832,937.00	1.44
10	600100	同方股份	66,900	816,180.00	1.41

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603619	中曼石油	1,000	22,610.00	0.04

注报告期末,本基金仅持有上述1只积极投资股票。

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	50,900.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,900.00	0.09

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	128016	雨虹转债	509	50,900.00	0.09

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

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

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	中证500股指期货IC1710合约	9	11,838,960.00	66,240.00	-
公允价值变动总额合计(元)					66,240.00
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)					66,240.00

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃、超额收益显著的股指期货合约进行投资。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

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	71,892.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	657.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,011.12
8	其他	-
9	合计	103,561.43

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报告期末十名股票中在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资前十名股票中在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不在流通受限情况。

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603619	中曼石油	22,610.00	0.04	未上市

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	346,822,910.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	291,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	55,822,910.00

§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)中国证监会批准嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金注册的批复文件;

(2)《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实中关村A股交易型开放式指数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

嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1基金产品情况

基金简称	嘉实中创400ETF联接
基金主代码	070030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月22日
报告期末基金份额总额	106,527,066.17份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪;将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。
业绩比较基准	中创400指数收益率*95%+银行活期存款税后利率*5%
风险收益特征	本基金为中创400ETF的联接基金,主要通过投资于中创400ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金的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。
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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	中创400交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年3月22日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年5月11日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品