

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金

[illegible]

| 5.3.3 其他资产构成 | | |
|--------------|---------|-----------|
| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| 1 | 存出保证金 | 97.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,453.46 |
| 5 | 应收申购款 | 21,973.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 24,524.08 |

| | | |
|--|-------------|-------------|
| 报告期末基金份额净值 | 9.352,334/8 | 1,404,352/4 |
| <p>§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况</p> <p>7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况</p> <p>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。</p> <p>7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细</p> <p>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。</p> | | |
| <p>§ 8 备查文件目录</p> <p>1. 中国证监会核准嘉实中证金边中期国债交易开放式指数证券投资基金联接基金募集说明书</p> <p>2. 《嘉实中证金边中期国债交易开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》</p> | | |

(2) 嘉实中证金中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书；

(3) 嘉实中证金中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书；

(4) 嘉实中证金中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议；

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内嘉实中证金中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

82 存放地点
北京市建国门内大街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、14:00-17:30, 投资者可免费阅读,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.sjfund.com>

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:Emailservice@sjfund.com。

嘉实基金管理有限公司
2017 年 10 月 25 日

嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,中证证券为标的指数的成份股,本基金不参与该成份股“投票”的表决流程,符合公司证券管理制度相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|--------|----------|
| 1 | 卖出期权资金 | 1,628.76 |
| 2 | 应收证券利息 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 220.96 |

| | | |
|---|-------|----------|
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,849.71 |

5.14 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。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.15.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| § 6 开放式基金份额变动 | | 单位:份 |
|--------------------------|--|---------------|
| 报告期初基金份额总额 | | 27,240,886.00 |
| 报告期内基金总申购份额 | | 11,500,000.00 |
| 减:报告期内基金总赎回份额 | | 11,500,000.00 |
| 报告期间基金份额变动情况 份额减少** (填列) | | - |

| | | |
|--|----------------|---------------|
| 报告期末基金资产总额 | | 27,240,886.00 |
| <p>7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况</p> <p>7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况</p> <p>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。</p> <p>7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细</p> <p>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。</p> | | |
| <p>8 报告期内单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情况</p> | | |
| 投资者 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金份额情况 |
| | 持有基金份额 | |

| 主体类别 | 序号 | 达到或者超过 20%的时间区间 | 期初 份额 | 申购 份额 | 赎回 份额 | 持有份额 | 份额占 比(%) |
|--------|----|-------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-------------|
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 披露披露基金 | 1 | 2017/07/01 至 2017/09/30 | 24, 500, 100.00 | 28, 500, 000.00 | 28, 500, 000.00 | 24, 500, 100.00 | 89.94 |

| | |
|---|--|
| <p>产品特有风险</p> | |
| <p>报告期内本基金出现单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况。</p> <p>本基金基金如出现巨额赎回且其中赎回份额,基金管理人无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值带来一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;个别机构投资者赎回基金份额造成大额工作日基金资产净值低于 5000 万元,还可能面临转换运作方式,与其他基金合并或终止基金合同等情形。</p> | |
| <p>§ 9 备查文件目录</p> | |
| <p>9.1 备查文件目录</p> | |
| <p>(1) 中国证监会核准基金中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文</p> | |

(2)《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
(3)《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
(4)《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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)报告期内嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

92 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

9.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-15:00、8:30-17:00, 投资者可免费查阅, 也可按工本费购买打印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.com>

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 400-600-8880, 或发电子邮件, Emailservice@jsfund.com。

嘉实基金管理有限公司
2017 年 10 月 25 日

本基金投资于“中信证券(600000)”的决策程序如下:本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,中信证券为标的指数的成份股,本基金投资于“中信证券”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.22 本基金投资于资产支持证券,没有超出基金合同规定的各项投资限制,没有投资于

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 12,368.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,381.46 |
| 5 | 应收申购款 | 1,533,629.86 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,547,379.82 |

5.24 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。

5.25 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 | 41,181,890.43 |
| 报告期期末基金总申购份额 | 22,561,074.54 |
| 报告期末基金份额总额 | 21,913,372.95 |
| 报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 41,829,562.02 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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。

72 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 影响投资者决策的其他重要信息

8 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|------|---------------|------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| 机构 | 1 | 2017/09/27 至 2017/12/31 | - | 13,312,838.46 | - | 13,312,838.46 | 31.83 |

[illegible]

91. 请说明文件编号：
(1) 中国证监会核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立文件；
(2) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》；
(3) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
(4) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议》；
(5) 基金管理人业务资格证件、营业执照；
(6) 报告期内嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。
92. 报告地点：

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
93 查阅方式
(1)书面查询:查阅时间为每工作日 8:30-13:00、15:00-17:30, 投资者可免费阅读,也可按工本费购买复印件。
(2)网站查询:嘉实基金管理人网址:<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
