

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、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、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。

报告期为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	嘉实主题混合
基金代码	070700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21日
报告期末基金总资产	2,288,15,969.81亿元
投资目标	充分把握中国经济周期中的投资机会，谋取资产长期稳定增值。
投资策略	“底部挖掘”：通过深入研究，发掘真正具有投资价值的公司构建投资组合；并优先考虑股票类资产的配置，剩余资产配置于固定收益类和现金类资产大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数量化增长*95%+同业存款收益率*5%
风险收益特征	较低风险，较高收益。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

## § 3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 50,886,309.91

2.本期利润 107,178,923.04

3.期末平均基金份额净值 0.0454

4.期末基金份额净值 3,591,091,247.79

5.期末基金份额净值 1.569

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 30.2% 0.37% 4.41% 0.56% -1.39% -0.19%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 30.2% 0.37% 4.41% 0.56% -1.39% -0.19%

3.2.3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的比较

图：嘉实主题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图

对比如图

3.1主要财务指标

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 50,886,309.91

2.本期利润 107,178,923.04

3.期末平均基金份额净值 0.0454

4.期末基金份额净值 3,591,091,247.79

5.期末基金份额净值 1.569

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.2.3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的比较

阶段 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 24,236,592.81

2.本期利润 187,912,660.45

3.期末平均基金份额净值 0.0429

4.期末基金份额净值 2,444,539,244.31

5.期末基金份额净值 2.192

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.2.3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的比较

阶段 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(%)

过去三个月 74.5% 0.90% 4.41% 0.56% 3.04% 0.34%

3.3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 422,042,133

2.本期利润 883,191,477

3.期末平均基金份额净值 0.0982

4.期末基金份额净值 5,941,048.65

5.期末基金份额净值 5.941

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.3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的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 422,042,133

2.本期利润 883,191,477

3.期末平均基金份额净值 0.0982

4.期末基金份额净值 5,941,048.65

5.期末基金份额净值 5.941

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.3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的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 422,042,133

2.本期利润 883,191,477

3.期末平均基金份额净值 0.0982

4.期末基金份额净值 5,941,048.65

5.期末基金份额净值 5.941

注：①本期已实现收益指本基金本期利息收入、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上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平以所列示为准。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期内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(%) 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.2报告期内基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.2.3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的比较

阶段 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(%)

过去三个月 10.64% 0.98% 10.91% 0.99% -0.27% -0.01%

3.3主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元  
报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 422,042,133

2.本期利润 883,191,477