

# 嘉实主题新动力混合型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

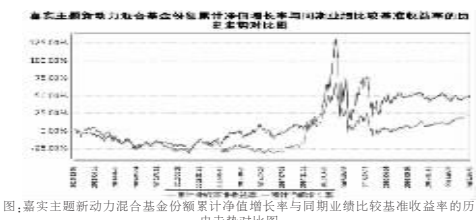


图:嘉实主题新动力混合型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同和招募说明书约定,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“第十四条、投资范围”和“五、投资限制(二)投资组合限制”的有关约定。

### 4基金管理人报告

#### 4.1基金基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名   | 职务                 | 任本基金基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明   |
|------|--------------------|------------|--------|--|
| 任职日期 | 离任日期               |            |        |  |
| 李海阳  | 本基金、嘉实主题新动力混合型基金经理 | 2012年7月18日 | 14年    | 曾任长城基金有限责任公司研究员、任华夏基金有限责任公司研究员、天津证券投资有限公司、银河内资股基金部基金经理兼基金管理部副经理。2011年4月加入嘉实基金管理有限公司任研究员、基金经理助理、基金经理,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:(1)任职日期指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业年限遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 投资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》及其他相关法律法规、《嘉实主题新动力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有关规定,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,各投资组合按照投资管理流程和独立决策,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要求,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年12月7日  |
| 报告期末基金份额总额 | 382,230,187.42份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

|                  |                |
|------------------|----------------|
| 2.本期利润           | 8,311,126.75   |
| 3. 加:本期计提基金销售服务费 | 0.0209         |
| 4.期末基金资产净值       | 580,078,937.49 |
| 5.期末基金份额净值       | 1.518          |

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(不含公允价值变动损益)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,计入费用后将实际收益水平更低于所列数字。

**32.基金净值表现**

**32.1 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 | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④    |       |
|-------|--------|----------|------------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.61%  | 0.67%    | 0.44%      | 0.56% | -2.80% | 0.11% |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年12月7日  |
| 报告期末基金份额总额 | 89,906,143.00份  |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

|                |                |
|----------------|----------------|
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0037         |
| 4.期末基金资产净值     | 154,015,699.80 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.7131         |

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,计入费用后将实际收益水平略有下降,以下所列数字。

**3.2 基金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 | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④   |
|-------|--------|----------|------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 5.73%  | 0.81%    | 4.85%      | 0.81% | 0.78% |

**3.2.1 基金合同生效以来的基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日   |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金力争在严格控制风险的前提下,通过精选个股和资产配置,力争实现基金资产的长期增值目标。  |
| 投资策略   | <p>本基金采取主动管理策略,通过基本面和资金面等两个维度进行个股分析,在控制风险的前提下,合理配置行业及在股票、债券、现金等各类资产类别之间进行配比,并根据宏观经济形势和个股的基本面进行适时动态调整。</p> <p>在股票资产方面,本基金采取自下而上的策略,以基本面分析作为基础,将基本面一定程度的成长性作为核心,价值投资作为辅助配置。在债券资产方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同期限债券的收益率水平,通过久期配置和个券选择策略,并适当调整投资组合的期限结构,力求在基金资产中实现收益和风险的最佳平衡,并通过调整投资组合的久期结构,来优化基金资产的风险收益特征。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中证金融债指数收益率*50%  |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。  |
| 基金管理人  | 国泰基金管理有限公司   |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日   |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 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                      | 21,542,066.23             |          |            |       |        |        |
| 2.本期利润                         | 15,368,174.91             |          |            |       |        |        |
| 3.本期利润扣除基金管理费、托管费后的净额          | 0.0182                    |          |            |       |        |        |
| 4.期末基金资产净值                     | 960,799,552.16            |          |            |       |        |        |
| 5.期末基金份额净值                     | 1.066                     |          |            |       |        |        |
| § 3.2 基金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                    | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④    |        |
| 过去三个月                          | 1.72%                     | 0.11%    | 2.64%      | 0.29% | -0.92% | -0.18% |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日   |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 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                      | 21,542,066.23             |          |            |       |        |        |
| 2.本期利润                         | 15,368,174.91             |          |            |       |        |        |
| 3.本期利润扣除基金管理费、托管费后的净额          | 0.0182                    |          |            |       |        |        |
| 4.期末基金资产净值                     | 960,799,552.16            |          |            |       |        |        |
| 5.期末基金份额净值                     | 1.066                     |          |            |       |        |        |
| § 3.2 基金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                    | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④    |        |
| 过去三个月                          | 1.72%                     | 0.11%    | 2.64%      | 0.29% | -0.92% | -0.18% |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日   |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 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                      | 21,542,066.23             |          |            |       |        |        |
| 2.本期利润                         | 15,368,174.91             |          |            |       |        |        |
| 3.本期利润扣除基金管理费、托管费后的净额          | 0.0182                    |          |            |       |        |        |
| 4.期末基金资产净值                     | 960,799,552.16            |          |            |       |        |        |
| 5.期末基金份额净值                     | 1.066                     |          |            |       |        |        |
| § 3.2 基金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                    | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④    |        |
| 过去三个月                          | 1.72%                     | 0.11%    | 2.64%      | 0.29% | -0.92% | -0.18% |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合   |
|------------|---|
| 基金代码       | 070021  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日   |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份   |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和新兴产业的投资机会;(2)根据经济主题(7)的发展状况,从经济周期和与市场预期差出发进行资产配置,优先选择能够受益于主题(7)配置;(3)深入挖掘符合基金主题(7)的上市公司股票;(4)在符合基金资产配置比例的前提下,适度参与非流动性资产,完成基金投资增值目标。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数*95%+上证国债指数*5%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。  |
| 基金管理人      | 嘉实基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 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                      | 21,542,066.23             |          |            |       |        |        |
| 2.本期利润                         | 15,368,174.91             |          |            |       |        |        |
| 3.本期利润扣除基金管理费、托管费后的净额          | 0.0182                    |          |            |       |        |        |
| 4.期末基金资产净值                     | 960,799,552.16            |          |            |       |        |        |
| 5.期末基金份额净值                     | 1.066                     |          |            |       |        |        |
| § 3.2 基金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                    | 净值增长率基准② | 净值增长率超越基准③ | ①-②   | ③-④    |        |
| 过去三个月                          | 1.72%                     | 0.11%    | 2.64%      | 0.29% | -0.92% | -0.18% |

§ 3.2.1 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:嘉实主题新动力混合型证券投资基金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0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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
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       | 嘉实主题新动力混合  |
|------------|--|
| 基金代码       | 070021   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2010年11月23日  |
| 报告期末基金份额总额 | 901,189,975.61份  |
| 投资目标       | 通过发掘驱动中国经济增长及结构转型升级的长期增长动力,并以长期增长动力所引致的主题性投资机会作为主要的投资逻辑,将主题投资逻辑融入本基金自上而下的资产配置过程中:(1)为长期增长动力判断提供政策及支持的新兴科技和 |