

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

§ 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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金投资人通过中国银监会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。

§ 2 基金产品概况

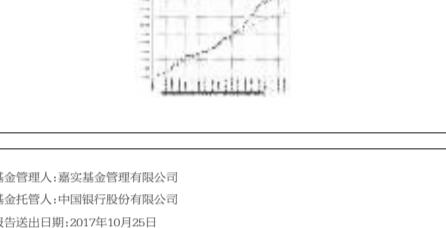
基金简称	嘉实超短债
基金代码	070009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月6日
报告期末基金份额总额	252,118,772.64份
投资目标	
通过控制投资组合的久期不超过一年，力求本金稳定，保持资产较高的流动性，降低现金净值波动风险，取得超过比较基准的确定回报。	
将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具，为基金资产提供超额收益。	
业绩比较基准	
一年期定期存款利率加上0.2%的业绩报酬。	
风险收益特征	
本基金的风格偏向于货币市场基金，低于中长期债券基金，风险较低，属于股票基金。	
基金管理人	
嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	
中国银行股份有限公司	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	1,962,584.47			
2.本期利润	1,874,096.11			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0069			
4.期末基金份额净值	263,464.9613			
5.期末基金份额净值	1.0442			

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)本期基金份额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要低于所列数字。

§ 2 基金产品概况



注：(1)任职日期、离职日期是公司作出决定后公告之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券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合规性情况的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实超短债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并运用基金资产，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，各投资组合参与交易所公开竞价交易时，同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，合计1次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金管理人公平交易制度的执行分析

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合参与交易所公开竞价交易时，同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，合计1次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.5 报告期内基金的业绩表现

4.5.1 报告期内基金的业绩表现

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

4.5.3 报告期内基金的业绩表现

4.5.4 报告期内基金的业绩表现

4.5.5 报告期内基金的业绩表现

4.5.6 报告期内基金的业绩表现

4.5.7 报告期内基金的业绩表现

4.5.8 报告期内基金的业绩表现

4.5.9 报告期内基金的业绩表现

4.5.10 报告期内基金的业绩表现

4.5.11 报告期内基金的业绩表现

4.5.12 报告期内基金的业绩表现

4.5.13 报告期内基金的业绩表现

4.5.14 报告期内基金的业绩表现

4.5.15 报告期内基金的业绩表现

4.5.16 报告期内基金的业绩表现

4.5.17 报告期内基金的业绩表现

4.5.18 报告期内基金的业绩表现

4.5.19 报告期内基金的业绩表现

4.5.20 报告期内基金的业绩表现

4.5.21 报告期内基金的业绩表现

4.5.22 报告期内基金的业绩表现

4.5.23 报告期内基金的业绩表现

4.5.24 报告期内基金的业绩表现

4.5.25 报告期内基金的业绩表现

4.5.26 报告期内基金的业绩表现

4.5.27 报告期内基金的业绩表现

4.5.28 报告期内基金的业绩表现

4.5.29 报告期内基金的业绩表现

4.5.30 报告期内基金的业绩表现

4.5.31 报告期内基金的业绩表现

4.5.32 报告期内基金的业绩表现

4.5.33 报告期内基金的业绩表现

4.5.34 报告期内基金的业绩表现

4.5.35 报告期内基金的业绩表现

4.5.36 报告期内基金的业绩表现

4.5.37 报告期内基金的业绩表现

4.5.38 报告期内基金的业绩表现

4.5.39 报告期内基金的业绩表现

4.5.40 报告期内基金的业绩表现

4.5.41 报告期内基金的业绩表现

4.5.42 报告期内基金的业绩表现

4.5.43 报告期内基金的业绩表现

4.5.44 报告期内基金的业绩表现

4.5.45 报告期内基金的业绩表现

4.5.46 报告期内基金的业绩表现

4.5.47 报告期内基金的业绩表现

4.5.48 报告期内基金的业绩表现

4.5.49 报告期内基金的业绩表现

4.5.50 报告期内基金的业绩表现

4.5.51 报告期内基金的业绩表现

4.5.52 报告期内基金的业绩表现

4.5.53 报告期内基金的业绩表现

4.5.54 报告期内基金的业绩表现

4.5.55 报告期内基金的业绩表现

4.5.56 报告期内基金的业绩表现

4.5.57 报告期内基金的业绩表现

4.5.58 报告期内基金的业绩表现

4.5.59 报告期内基金的业绩表现

4.5.60 报告期内基金的业绩表现

4.5.61 报告期内基金的业绩表现

4.5.62 报告期内基金的业绩表现

4.5.63 报告期内基金的业绩表现

4.5.64 报告期内基金的业绩表现

4.5.65 报告期内基金的业绩表现

4.5.66 报告期内基金的业绩表现

4.5.67 报告期内基金的业绩表现

4.5.68 报告期内基金的业绩表现

4.5.69 报告期内基金的业绩表现

4.5.70 报告期内基金的业绩表现

4.5.71 报告期内基金的业绩表现

4.5.72 报告期内基金的业绩表现

4.5.73 报告期内基金的业绩表现

4.5.74 报告期内基金的业绩表现

4.5.75 报告期内基金的业绩表现

4.5.76 报告期内基金的业绩表现

4.5.77 报告期内基金的业绩表现

4.5.78 报告期内基金的业绩表现

4.5.79 报告期内基金的业绩表现

4.5.80 报告期内基金的业绩表现

4.5.81 报告期内基金的业绩表现

4.5.82 报告期内基金的业绩表现

4.5.83 报告期内基金的业绩表现

4.5.84 报告期内基金的业绩表现

4.5.85 报告期内基金的业绩表现

4.5.86 报告期内基金的业绩表现

4.5.87 报告期内基金的业绩表现

4.5.88 报告期内基金的业绩表现

4.5.89 报告期内基金的业绩表现

4.5.90 报告期内基金的业绩表现

4.5.91 报告期内基金的业绩表现

4.5.92 报告期内基金的业绩表现

4.5.93 报告期内基金的业绩表现

4.5.94 报告期内基金的业绩表现

4.5.95 报告期内基金的业绩表现

4.5.96 报告期内基金的业绩表现

4.5.97 报告期内基金的业绩表现

4.5.98 报告期内基金的业绩表现

4.5.99 报告期内基金的业绩表现

4.5.100 报告期内基金的业绩表现

4.5.101 报告期内基金的业绩表现