

## 嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

2017年年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:招商银行股份有限公司  
送出日期:2018年03月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金管理人招行银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018年3月3日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等,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及其更新。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,请阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	嘉实对冲套利定期混合
基金主代码	000568
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月10日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金销售机构	104,291,035.64
基金合同存续期	不长期

基金产品	投资目标	投资策略	投资范围	投资策略	风险收益特征
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。

风险收益特征	本基金的基金类型为契约型开放式,风险收益特征如下:通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。
	本基金将通过量化分析,通过各种金融工具为机构投资人实现稳健的投资收益。

2.3 基金管理人和基金托管人	项目	基金管理人	基金托管人
	名称	嘉实基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
	姓名	朱冉	
	联系地址	0105215588	0755919904
	电子邮箱	service@fund.jz	yzheng@cmbchina.com
	客户服务电话	400-800-8000	95555
	传真	0105215588	07559195201

2.4 信息披露方式	登载基金半年度报告的管理人住所网站	http://www.jzfund.cn
	基金年度报告登载的管理人住所网站	嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要会计数据和财务指标	基金名称	嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金		
	金额单位:人民币元			
3.1 2017年主要会计数据	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%
3.2 2017年利润分配情况	项目	2017年	2016年	2015年
	利润	9,206,741.23	11,136,786.00	38,339,891.29
	利润分配	0.0853	0.0704	0.0532
	期末可供分配基金份额总额	88%	75%	53%

3.3 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%

3.4 2017年利润分配情况	项目	2017年	2016年	2015年
	利润	9,206,741.23	11,136,786.00	38,339,891.29
	利润分配	0.0853	0.0704	0.0532
	期末可供分配基金份额总额	88%	75%	53%

3.5 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%

3.6 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%

3.7 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%

3.8 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年
	营业收入	3,436,691.75	4,889,455.81	185,814,406.15
	净利润	6,257,512.28	3,917,962.69	93,598,722.37
	加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0109	0.0404
	期末可供分配基金份额总额	23%	104%	45%
	期末基金资产净值	168%	181%	93%

3.9 2017年所有者权益变动表	项目	2017年	2016年	2015年



<tbl\_r cells="5" ix="3" maxcspan="1" maxrspan="1" used