嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
登记结算人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2017年8月23日
公告日期：2017年8月18日

一、重要声明与提示

《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2017年4月28日《证券时报》上的《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站（www.jsfund.cn）。

二、基金概览

1.基金名称：嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金
2.基金类型：股票型
3.基金运作方式：交易型开放式
4.基金场内简称：创业板E
5.基金代码：159955
6.标的指数简称：创业板指数
7.标的指数代码：399006
8.基金份额总额：
截至2017年8月16日，本基金的基金份额总额为256,634,838.00份。
9.基金份额净值：
截至2017年8月16日，本基金的基金份额净值为1.0025元。
10.本次上市交易的基金份额：256,634,838.00份
11.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
12.上市交易日期：2017年8月23日
13.基金管理人：嘉实基金管理有限公司
14.基金托管人：中国银行股份有限公司
15.登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
16.申购赎回代理券商（排序不分先后）：中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、方正证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号：经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1497号文准予注册募集，并经中国证监会机构部函[2017]906号文准予延期募集备案
2.基金合同生效日：2017年7月14日
3.运作方式：交易型开放式
4.基金合同期限：不定期
5.发售日期：2017年5月3日至2017年7月7日。其中，网上现金认购和通过基金管理人进行网下现金认购的发售日期为2017年5月3日至2017年7月7日，通过基金管理人和代销机构进行网下组合证券认购的发售日期为2017年7月3日至2017年7月7日。
6.发售价格：1.00元人民币
7.份额发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购
8.基金份额发售机构

（1）网上现金发售代理机构（排序不分先后）

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券等具有基金代销资格以及深交所会员资格的证券公司。

9.网下现金发售机构
嘉实基金管理有限公司
10.网下股票发售代理机构（排序不分先后）：
广发证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司等。

（二）基金合同生效

本基金根据经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1497号文准予注册募集，并经中国证监会机构部函[2017]906号文准予延期募集备案。自2017年5月3日起公开募集，截止2017年7月7日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为256,618,000.00元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计16,838.00元人民币。本次募集所有资金256,634,838.00元已于2017年7月12日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为2061户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计256,634,838.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2017年7月14日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）本基金上市交易的主要内容
1.基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2017】516号
2.上市交易日期：2017年8月23日
3.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4.基金场内简称：创业板E
5.基金交易代码：159955
6.本次上市交易份额：256,634,838.00份
7.末上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2017年8月16日，本基金持有人户数为2,055户（不含信用账户），平均每户持有的基金份额为124,883.13份。

截至2017年8月16日，基金份额合计为256,634,838.00份，机构投资者持有的基金份额为16,426,817.00份，占基金总份额的比例为6.40%；个人投资者持有的基金份额为240,208,021.00份，占基金总份额的比例为93.60%。

（二）基金份额前十名持有人情况

截至2017年8月16日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额比例(%)
1	叶驷	10,000,583.00	3.90
2	东兴证券投资有限公司	8,000,388.00	3.12
3	赵先宏	7,666,372.00	2.99
4	倪亚文	4,850,282.00	1.89
5	冯瑞芳	4,000,262.00	1.56
6	蔡美知	3,500,204.00	1.36
7	李美	3,000,408.00	1.17
8	程瑞芬	3,000,174.00	1.17
9	周之庭	2,500,145.00	0.97
10	钱志强	2,500,048.00	0.97
合计		49,018,866.00	19.10

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况
名称：嘉实基金管理有限公司
法定代表人：邓红国
总经理：赵学军
注册资本：1.5亿元人民币
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
设立批准文号：中国证监会证监基字[1999]5号
工商登记注册的法人营业执照文号：100000400011239
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理及中国证监会许可的其他业务
成立日期：1999年3月25日
2、股东及其出资比例：中诚信托有限责任公司40%，立信投资有限责任公司30%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%。
3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）股票投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由首席投资官（股票）、总经理、副总经理、总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及相关总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、人员情况
截至2017年6月30日，我公司共有748名员工，其中博士学位36人、硕士学位439人、学士学位255人、其他18人。

5、信息披露负责人：胡勇钦

6、基金管理人简介
截止2017年7月27日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、135只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证企边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债、嘉实稳裕债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳愉债券、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

7、本基金基金经理简介
陈正宪先生，硕士研究生，12年证券从业经历。曾任职于中国台湾合育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任公司指数投资部执行总监及基金经理。2016年1月5日至今担任嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实H股指数（QDII-LOF）基金经理，2016年3月24日至今担任嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实中创400ETF联接及嘉实中创400ETF,2017年6月7日至今担任嘉实中关村A股ETF基金经理,2017年6月29日至今担任嘉实富时中国A50ETF联接基金经理,2017年7月3日至今担任嘉实富时中国A50ETF基金经理,2017年7月14日至今担任嘉实创业板ETF基金经理。

何如女士，硕士研究生，11年证券从业经历。曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司（IA-Clarington Investments Inc）、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司，任产品管理部高级产品经理职位，负责指数产品及ETF创新产品的设计与开发、指数研究及产品管理工作；2012年9月加入指数投资部，先后担任基金经理助理、基金经理职位。2014年5月9日至2016年3月24日任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接基金经理,2014年6月13日至今任嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF基金经理、2014年6月20日至今任嘉实中证金融地产ETF基金经理。2015年8月6日至今任嘉实中证金融地产ETF联接基金经理。2016年1月5日至今任嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF联接、嘉实基本面50、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理。2017年6月29日至今担任嘉实富时中国A50ETF联接基金经理,2017年7月3日至今担任嘉实富时中国A50ETF基金经理，2017年7月14日至今担任嘉实创业板ETF基金经理。

（二）基金托管人

1、公司概况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管业务部总经理：郭德秋
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：(010)66594942

2、基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、基金托管业务经营情况
截至2017年03月31日，中国银行已托管576只证券投资基金，其中境内基金541只，QDII基金35只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）基金上市推荐人的信息
无

（四）基金验资机构
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人：李丹
电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
联系人：张勇
经办注册会计师：单峰、张勇

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金2017年8月16日资产负债表（未经审计，除特别注明外，金额单位为人民币元）如下：

项目	2017年8月16日
	资产
银行存款	101,879,602.64
结算备付金	1,228,571.43
存出保证金	
交易性金融资产	12,971,607.00
其中：股票投资	12,971,607.00
债券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	203,000,000.00
应收证券清算款	
应收利息	58,277.09
其他资产	16,838.00
资产总计	319,154,896.16
	负债和所有者权益
负债	
应付证券清算款	61,780,986.34
应付管理人报酬	56,346.24
应付托管费	11,269.25
应付交易费用	9,045.3
其他负债	18,898.11
负债合计	61,876,545.24
所有者权益	
实收基金	256,634,838.00
未分配利润	643,512.92
所有者权益合计	257,278,350.92
负债和所有者权益总计	319,154,896.16
基金份额总额(份)	256,634,838.00
基金份额净值	1.0025

八、基金投资组合

截至2017年8月16日，嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下：

(一)期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,971,607.00	4.06
	其中：股票	12,971,607.00	4.06
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产	203,000,000.00	63.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	103,108,174.07	32.31
6	其他资产	75,115.09	0.02
	合计	319,154,896.16	100

(二)期末按行业分类的股票投资组合

1.期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,068,880.00	0.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,324,285.00	2.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	142,974.00	0.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,555,166.00	1.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	142,120.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	757,836.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	375,219.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	605,127.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	12,971,607.00	5.04

2.期末积极投资按行业分类的股票投资组合
2017年8月16日，本基金未持有积极投资股票。

(三)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

1.期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	49,600.00	1,068,880.00	0.42
2	300059	东方财富	38,900.00	549,268.00	0.21
3	300136	信维通信	10,100.00	391,880.00	0.15
4	300070	碧水源	19,900.00	382,478.00	0.15
5	300072	三聚环保	11,600.00	370,388.00	0.14
6	300124	汇川技术	13,700.00	355,515.00	0.14
7	300024	机器人	16,200.00	341,172.00	0.13
8	300408	三环集团	14,100.00	294,690.00	0.11
9	300003	乐普医疗	11,900.00	264,656.00	0.10
10	300088	长信科技	12,700.00	241,300.00	0.09

2.期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
2017年8月16日，本基金未持有积极投资股票。

(四)期末按债券品种分类的债券投资组合
2017年8月16日，本基金未持有债券。

(五)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
2017年8月16日，本基金未持有债券。

(六)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
2017年8月16日，本基金未持有资产支持证券。

(七)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
2017年8月16日，本基金未持有权证。

(八)投资组合报告附注
1、2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年8月16日本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
2、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。
3、2017年8月16日其他资产构成：

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58,277.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	16,838.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,115.09

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细
2017年8月16日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
1)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
2017年8月16日，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

2)期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
2017年8月16日，本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同已于2017年7月14日正式生效，基金管理人于2017年7月15日在《证券时报》和公司网站刊登《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》。

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会准予本基金注册的文件；
（二）《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
（四）《嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

风险提示：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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

嘉实基金管理有限公司
2017年8月18日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定基金合同约定或或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换为本基金提供销售、销售支付、份额登记、估值、投资顾问、法律、会计等服务的基金服务机构并决定相关费率，对基金服务机构的相关行为进行监督和处理。
（9）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（10）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（11）依照法律法规和《基金合同》为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（12）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（13）选择、更换证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
（14）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整《业务规则》；
（15）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、基金管理人的义务
（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价和注销的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人应将投资人已缴纳的认购款项、股票及其孳息在基金募集期结束后30日内返还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利
（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
（2）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户及其他投资所需账户、为基金办理证券交易资金结算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、基金托管人的义务
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产保管事宜；
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户及基金投资所需其他账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；
（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
（12）建立并保存基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；
（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
（19）因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履