

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金联接基金（LOF）
2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半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 8 月 23 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，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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	66
7.10 期末投资目标基金明细.....	66
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.13 投资组合报告附注.....	67
§8 基金份额持有人信息.....	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示.....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	78

§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	79
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)
基金简称	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)
场内简称	嘉实 300
基金主代码	160706
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 8 月 29 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
报告期末基金份额总额	15,777,922,973.36 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 10 月 17 日

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净
------	--

	值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现对沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%。
业绩比较基准	沪深 300 指数增长率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	风险中等，获得证券市场平均收益率

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
		王永民

	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		邓红国	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	188,856,607.11
本期利润	1,682,437,602.86
加权平均基金份额本期利润	0.1030
本期加权平均净值利润率	10.49%
本期基金份额净值增长率	11.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	744,948,602.69
期末可供分配基金份额利润	0.0472
期末基金资产净值	16,522,871,576.05
期末基金份额净值	1.0472
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	292.61%

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) 所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.27%	0.62%	4.73%	0.64%	0.54%	-0.02%
过去三个月	6.53%	0.58%	5.79%	0.59%	0.74%	-0.01%
过去六个月	11.00%	0.53%	10.23%	0.54%	0.77%	-0.01%
过去一年	17.78%	0.63%	15.44%	0.63%	2.34%	0.00%

过去三年	73.72%	1.65%	65.95%	1.66%	7.77%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	292.61%	1.72%	278.80%	1.73%	13.81%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×95% + 银行同业存款收益率×5%。

本基金原则上将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股，选用以上业绩衡量基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

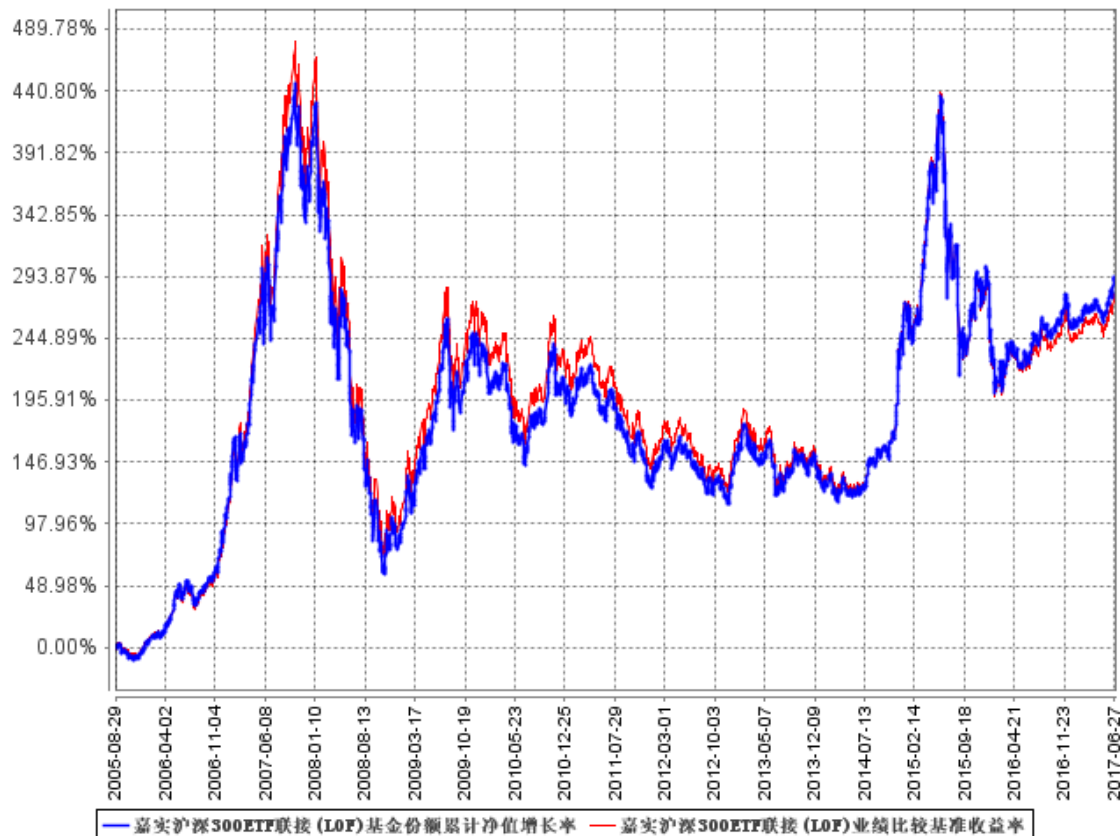
$$\text{Return}(t)=95\% \times (\text{沪深 300 指数}(t)/\text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times \text{同业存款日收益率}$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实沪深300ETF联接 (LOF) 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



图：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) 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

(2005 年 8 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日)

注：根据 2012 年 8 月 21 日中国证监会《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2012]1146 号)，变更了投资范围并更名为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。本基金自 2012 年 8 月 21 日起 3 个月内为建仓期 (原持有的沪深 300 指数成份股、备选成份股调整为嘉实沪深 300ETF)，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条 ((二) 投资范围和 (七) 投资禁止行为与限制) 的规定：(1) 基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；(2) 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90% (已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内)，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，

从其规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 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)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、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、嘉实中证金边中期国债 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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思

路灵活配置混合、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、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、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 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金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。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、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	2016 年 1 月 5 日	-	11 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-ClaringtonInvestmentsInc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (FranklinTempletonInvestments Corp.)。2007 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,现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

	实中证金融地产 ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理				
陈正宪	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	12 年	曾任职于中国台湾台育证券、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, 现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 中国台湾籍。

注: (1) 任职日期、离职日期是指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《证券业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》及其各项配套法规、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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规定和约定, 无损害

基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，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 6 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年化跟踪误差为 0.37%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3% 的限制。

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0472 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.00%，业绩比较基准收益率为 10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将继续秉承指数化投资管理策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（二十二（三）收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	700,382,463.99	665,300,323.15
结算备付金		10,825,148.82	5,336,018.56
存出保证金		6,333,364.39	1,291,751.15
交易性金融资产	6.4.7.2	15,778,755,448.36	14,870,447,837.38
其中：股票投资		301,149,437.55	10,835,991.57
基金投资		15,347,864,010.81	14,729,671,845.81
债券投资		129,742,000.00	129,940,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	35,000,000.00	-
应收证券清算款		12,929,509.85	239,501.90
应收利息	6.4.7.5	2,196,451.70	2,966,864.23
应收股利		-	-
应收申购款		2,110,078.70	3,128,404.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1,306,523.50
资产总计		16,548,532,465.81	15,550,017,224.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		23,699,831.93	8,556,757.60
应付管理人报酬		439,520.18	522,813.69
应付托管费		87,904.06	104,562.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	548,349.26	625,009.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	885,284.33	953,191.90
负债合计		25,660,889.76	10,762,335.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,777,922,973.36	16,471,718,122.06
未分配利润	6.4.7.10	744,948,602.69	-932,463,233.35
所有者权益合计		16,522,871,576.05	15,539,254,888.71
负债和所有者权益总计		16,548,532,465.81	15,550,017,224.30

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0472 元，基金份额总额 15,777,922,973.36 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2017年6月30日	2016年6月30日
一、收入		1,688,029,151.89	-2,524,012,456.92
1.利息收入		5,649,620.78	4,849,023.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,626,283.02	2,889,874.55
债券利息收入		2,103,478.35	1,959,148.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		919,859.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		187,903,403.71	-93,652,446.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,330,623.51	-90,928,477.62
基金投资收益	6.4.7.13	159,868,334.36	-9,688,736.54
债券投资收益	6.4.7.14	20,723.39	-59,904.43
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	9,182,760.00	2,646,960.00
股利收益	6.4.7.16	1,500,962.45	4,377,712.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,493,580,995.75	-2,436,750,573.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	895,131.65	1,541,539.28
减：二、费用		5,591,549.03	7,291,799.37
1. 管理人报酬		2,638,064.62	3,520,382.20
2. 托管费		527,613.00	704,076.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,155,387.22	2,799,287.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	270,484.19	268,053.53

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,682,437,602.86	-2,531,304,256.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,682,437,602.86	-2,531,304,256.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,471,718,122.06	-932,463,233.35	15,539,254,888.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,682,437,602.86	1,682,437,602.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-693,795,148.70	-5,025,766.82	-698,820,915.52
其中：1. 基金申购款	865,993,511.91	-16,847,345.75	849,146,166.16
2. 基金赎回款	-1,559,788,660.61	11,821,578.93	-1,547,967,081.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	15,777,922,973.36	744,948,602.69	16,522,871,576.05

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	17,601,221,977.94	590,477,957.62	18,191,699,935.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,531,304,256.29	-2,531,304,256.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	597,963,085.41	-78,164,929.24	519,798,156.17
其中：1. 基金申购款	2,395,058,107.95	-308,172,950.22	2,086,885,157.73
2. 基金赎回款	-1,797,095,022.54	230,008,020.98	-1,567,087,001.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	18,199,185,063.35	-2,018,991,227.91	16,180,193,835.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军

基金管理人负责人

王红

主管会计工作负责人

张公允

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是根据原嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“原基金”)基金份额持有人大会 2012 年 8 月 6 日决议通过的《关于嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 变更投资范围及其相关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1146 号《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议的批复》，由原基金变更而来。自 2012 年 8 月 21 日起，由《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》生效，原《嘉实沪深 300 指数证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.30%。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 93 号文审核同意，原基金 344,534,887.00 份基金份额于 2005 年 10 月 17 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

变更前，根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，原基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股，一级市场初次发行或增发的新股，以及不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。原基金原则上将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股。原基金力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现有效跟踪。原基金的业绩比较基准为沪深 300 指数增长率 $\times 95\% +$ 银行同业存款收益率 $\times 5\%$ 。

变更后，根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，为更好地实现投

资目标, 本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数增长率 X 95%+银行活期存款税后利率 X5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,

金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	700,382,463.99
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计	700,382,463.99

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	293,048,331.18	301,149,437.55	8,101,106.37

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	130,166,170.00	129,742,000.00	-424,170.00
	合计	130,166,170.00	129,742,000.00	-424,170.00
资产支持证券		-	-	-
基金		12,293,174,610.19	15,347,864,010.81	3,054,689,400.62
其他		-	-	-
合计		12,716,389,111.37	15,778,755,448.36	3,062,366,336.99

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	28,174,380.00	-	-	
其中：股指期货投资	28,174,380.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	28,174,380.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IF1709	沪深 300 股指期货	27	29,409,480.00	1,235,100.00

	IF1709 合约			
总额合计				1,235,100.00
减：可抵销期货暂收款				1,235,100.00
股指期货投资净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产款	-	-
交易所市场买入返售金融资产款	35,000,000.00	-
合计	35,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	126,404.68
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,913.18
应收债券利息	2,076,986.30

应收买入返售证券利息	-12,328.77
应收申购款利息	134.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3,342.31
合计	2,196,451.70

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	548,349.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	548,349.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	37,341.48
预提费用	347,942.85
应付指数使用费	-
其他	-
合计	885,284.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	16,471,718,122.06	16,471,718,122.06
本期申购	865,993,511.91	865,993,511.91
本期赎回(以“-”号填列)	-1,559,788,660.61	-1,559,788,660.61
本期末	15,777,922,973.36	15,777,922,973.36

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,107,137,819.38	-2,039,601,052.73	-932,463,233.35
本期利润	188,856,607.11	1,493,580,995.75	1,682,437,602.86
本期基金份额交易产生的变动数	-50,503,403.16	45,477,636.34	-5,025,766.82
其中：基金申购款	61,293,038.23	-78,140,383.98	-16,847,345.75
基金赎回款	-111,796,441.39	123,618,020.32	11,821,578.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,245,491,023.33	-500,542,420.64	744,948,602.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	57,695.21
其他	81,606.37
合计	2,626,283.02

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,330,623.51
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	17,330,623.51

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,004,287,161.81
减：卖出股票成本总额	986,956,538.30
买卖股票差价收入	17,330,623.51

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,027,244,408.74
减：卖出/赎回基金成本总额	867,376,074.38

基金投资收益	159,868,334.36
--------	----------------

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	206,078,446.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	200,245,700.00
减：应收利息总额	5,812,022.71
买卖债券差价收入	20,723.39

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本期（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	9,182,760.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,500,962.45
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,500,962.45
----	--------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,492,345,895.75
——股票投资	7,370,979.83
——债券投资	-465,530.00
——基金投资	1,485,440,445.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,235,100.00
——权证投资	-
——股指期货	1,235,100.00
3. 其他	-
合计	1,493,580,995.75

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	858,030.61
基金转出费收入	37,101.04
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-

合计	895,131.65
----	------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,154,287.22
银行间市场交易费用	1,100.00
合计	2,155,387.22

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	69,424.36
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	13,541.34
指数使用费	-
上市年费	29,752.78
红利手续费	-
其他	-
合计	270,484.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,638,064.62	3,520,382.20
其中：支付销售机构的客户维护费	5,947,510.35	5,628,610.30

注 1：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人嘉实基金管理有

限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬 = （前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值）（若为负数，则取 0） × 0.5% / 当年天数。

注 2：根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。”

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	527,613.00	704,076.47

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = （前一日的基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值）（若为负数，则取 0） × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	72,463,986.23	-	-	-	-	-

注：上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	9,163,306.45	9,163,306.45
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,163,306.45	9,163,306.45
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.06%	0.05%

注：本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2017 年 6 月 30 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	700,382,463.99	2,486,981.44	720,016,703.44	2,614,920.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2017 年 6 月 30 日），本基金持有 3,854,891,247.00 份目标 ETF 基金份额（2016 年 12 月 31 日：4,126,883,292.00 份），占其总份额的比例为 86.95%（2016 年 12 月 31 日 84.80%）。

6.4.11 利润分配情况

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

		日	5 日							
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	623,500	2,170,062.69	2,138,605.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事项停牌	24.93	-	-	53,500	1,609,398.61	1,333,755.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项停牌	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	19,000	587,912.38	585,580.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.27	-	-	209,000	1,747,788.61	1,728,430.00	-
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	20.24	-	-	76,840	1,559,304.20	1,555,241.60	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事项停牌	8.03	-	-	155,700	1,222,648.08	1,250,271.00	-

300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项停牌	28.63	-	-	97,000	2,907,282.59	2,777,110.00	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	685,200	4,766,505.40	4,693,620.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	14.12	-	-	150,100	2,114,596.76	2,119,412.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	14.59	-	-	147,500	2,154,577.88	2,152,025.00	-
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大事项停牌	13.48	-	-	27,000	470,610.00	363,960.00	-
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大事项停牌	17.40	-	-	19,360	338,626.19	336,864.00	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	3.60	-	-	923,500	3,253,773.90	3,324,600.00	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事项停牌	10.57	-	-	98,690	1,046,407.60	1,043,153.30	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	23.48	-	-	38,349	686,094.70	900,434.52	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项停牌	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	135,400	756,524.87	750,116.00	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事项停牌	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	119,300	876,059.12	903,101.00	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事项停牌	5.16	-	-	174,800	910,548.01	901,968.00	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事项停牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	316,800	1,753,653.27	1,694,880.00	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项停牌	6.21	-	-	201,700	1,504,282.26	1,252,557.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为嘉实沪深 300ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实沪深 300ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数及嘉实沪深 300ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，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。董事会下设风险控制与内审委员会，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。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，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。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及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。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。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。业务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。员工在

其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但投资目标 ETF 基金和标的指数成份股不受此限。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	700,382,463.99	-	-	-	700,382,463.99
结算备付金	10,825,148.82	-	-	-	10,825,148.82

存出保证金	451,468.39	-	-	5,881,896.00	6,333,364.39
交易性金融资产	129,742,000.00	-	-	15,649,013,448.36	15,778,755,448.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	35,000,000.00	-	-	-	35,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	12,929,509.85	12,929,509.85
应收利息	-	-	-	2,196,451.70	2,196,451.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	475,063.44	-	-	1,635,015.26	2,110,078.70
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	876,876,144.64	-	-	15,671,656,321.17	16,548,532,465.81
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	23,699,831.93	23,699,831.93
应付管理人报酬	-	-	-	439,520.18	439,520.18
应付托管费	-	-	-	87,904.06	87,904.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	548,349.26	548,349.26
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	885,284.33	885,284.33
负债总计	-	-	-	25,660,889.76	25,660,889.76

利率敏感度缺口	876,876,144.64	-	-	15,645,995,431.41	16,522,871,576.05
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	665,300,323.15	-	-	-	665,300,323.15
结算备付金	5,336,018.56	-	-	-	5,336,018.56
存出保证金	1,291,751.15	-	-	-	1,291,751.15
交易性金融资产	129,940,000.00	-	-	14,740,507,837.38	14,870,447,837.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	239,501.90	239,501.90
应收利息	-	-	-	2,966,864.23	2,966,864.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	755,306.86	-	-	2,373,097.57	3,128,404.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,306,523.50	1,306,523.50
资产总计	802,623,399.72	-	-	14,747,393,824.58	15,550,017,224.30
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,556,757.60	8,556,757.60
应付管理人报酬	-	-	-	522,813.69	522,813.69
应付托管费	-	-	-	104,562.74	104,562.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	625,009.66	625,009.66

应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	953,191.90	953,191.90
负债总计	-	-	-	10,762,335.59	10,762,335.59
利率敏感度缺口	802,623,399.72	-	-	14,736,631,488.99	15,539,254,888.71

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.79% (2016 年 12 月 31 日：0.80%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	301,149,437.55	1.82	10,835,991.57	0.07
交易性金融资产-基金投资	15,347,864,010.81	92.89	14,729,671,845.81	94.79
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,649,013,448.36	94.71	14,740,507,837.38	94.86

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	819,916,741.77	773,497,893.63
	业绩比较基准下降 5%	-819,916,741.77	-773,497,893.63

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 15,629,930,845.02 元，属于第二层次的余额为 148,824,603.34 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 14,738,610,815.55 元，第二层次 131,837,021.83 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运

营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	301,149,437.55	1.82
	其中：股票	301,149,437.55	1.82
2	基金投资	15,347,864,010.81	92.74
3	固定收益投资	129,742,000.00	0.78
	其中：债券	129,742,000.00	0.78
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	35,000,000.00	0.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	711,207,612.81	4.30
8	其他各项资产	23,569,404.64	0.14
9	合计	16,548,532,465.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	681,053.00	0.00
B	采矿业	8,420,808.52	0.05
C	制造业	110,087,835.56	0.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,796,416.00	0.06
E	建筑业	13,109,586.00	0.08
F	批发和零售业	6,104,780.64	0.04

G	交通运输、仓储和邮政业	9,998,197.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,041,776.92	0.13
J	金融业	97,032,604.39	0.59
K	房地产业	15,063,310.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,475,841.52	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,338,388.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	559,300.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,261,927.00	0.02
S	综合	1,177,613.00	0.01
	合计	301,149,437.55	1.82

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	293,800	14,575,418.00	0.09
2	600036	招商银行	280,100	6,697,191.00	0.04
3	600519	贵州茅台	13,690	6,459,626.50	0.04
4	601166	兴业银行	338,000	5,698,680.00	0.03
5	000651	格力电器	130,600	5,376,802.00	0.03
6	000333	美的集团	122,800	5,285,312.00	0.03
7	600016	民生银行	641,100	5,269,842.00	0.03
8	600050	中国联通	685,200	4,693,620.00	0.03

9	000002	万 科 A	184,700	4,611,959.00	0.03
10	601328	交通银行	745,100	4,589,816.00	0.03
11	601668	中国建筑	407,400	3,943,632.00	0.02
12	600000	浦发银行	304,900	3,856,985.00	0.02
13	601288	农业银行	1,038,100	3,654,112.00	0.02
14	600030	中信证券	213,500	3,633,770.00	0.02
15	600887	伊利股份	164,900	3,560,191.00	0.02
16	600795	国电电力	923,500	3,324,600.00	0.02
17	600837	海通证券	219,500	3,259,575.00	0.02
18	002415	海康威视	100,200	3,236,460.00	0.02
19	601398	工商银行	584,900	3,070,725.00	0.02
20	601169	北京银行	329,900	3,025,183.00	0.02
21	600104	上汽集团	95,400	2,962,170.00	0.02
22	601601	中国太保	85,427	2,893,412.49	0.02
23	000858	五 粮 液	51,500	2,866,490.00	0.02
24	300104	乐视网	97,000	2,777,110.00	0.02
25	600900	长江电力	179,600	2,762,248.00	0.02
26	000725	京东方 A	644,800	2,682,368.00	0.02
27	601766	中国中车	263,900	2,670,668.00	0.02
28	601211	国泰君安	122,300	2,508,373.00	0.02
29	600276	恒瑞医药	45,888	2,321,473.92	0.01
30	000001	平安银行	232,900	2,186,931.00	0.01
31	600485	信威集团	147,500	2,152,025.00	0.01
32	000100	TCL 集团	623,500	2,138,605.00	0.01
33	600100	同方股份	150,100	2,119,412.00	0.01
34	601988	中国银行	571,600	2,114,920.00	0.01
35	600048	保利地产	193,000	1,924,210.00	0.01
36	601390	中国中铁	203,300	1,762,611.00	0.01

37	600518	康美药业	80,600	1,752,244.00	0.01
38	601818	光大银行	431,800	1,748,790.00	0.01
39	002129	中环股份	209,000	1,728,430.00	0.01
40	601919	中远海控	316,800	1,694,880.00	0.01
41	600028	中国石化	285,000	1,690,050.00	0.01
42	600019	宝钢股份	239,800	1,609,058.00	0.01
43	600015	华夏银行	173,940	1,603,726.80	0.01
44	601688	华泰证券	88,500	1,584,150.00	0.01
45	002252	上海莱士	76,840	1,555,241.60	0.01
46	000063	中兴通讯	64,500	1,531,230.00	0.01
47	002450	康得新	67,200	1,513,344.00	0.01
48	601186	中国铁建	124,900	1,502,547.00	0.01
49	002304	洋河股份	16,400	1,423,684.00	0.01
50	000776	广发证券	80,300	1,385,175.00	0.01
51	001979	招商蛇口	64,500	1,377,720.00	0.01
52	601006	大秦铁路	161,700	1,356,663.00	0.01
53	000503	海虹控股	53,500	1,333,755.00	0.01
54	000538	云南白药	14,200	1,332,670.00	0.01
55	600703	三安光电	66,500	1,310,050.00	0.01
56	601989	中国重工	201,700	1,252,557.00	0.01
57	002426	胜利精密	155,700	1,250,271.00	0.01
58	600690	青岛海尔	82,800	1,246,140.00	0.01
59	601628	中国人寿	45,200	1,219,496.00	0.01
60	601336	新华保险	22,900	1,177,060.00	0.01
61	600958	东方证券	84,400	1,174,004.00	0.01
62	002024	苏宁云商	101,000	1,136,250.00	0.01
63	601939	建设银行	182,500	1,122,375.00	0.01
64	601901	方正证券	111,700	1,109,181.00	0.01

65	601009	南京银行	98,600	1,105,306.00	0.01
66	600340	华夏幸福	32,100	1,077,918.00	0.01
67	600999	招商证券	62,000	1,067,640.00	0.01
68	600309	万华化学	37,100	1,062,544.00	0.01
69	002230	科大讯飞	26,400	1,053,360.00	0.01
70	600089	特变电工	101,883	1,052,451.39	0.01
71	600959	江苏有线	98,690	1,043,153.30	0.01
72	600741	华域汽车	42,800	1,037,472.00	0.01
73	000423	东阿阿胶	14,200	1,020,838.00	0.01
74	002142	宁波银行	52,867	1,020,333.10	0.01
75	601857	中国石油	131,900	1,014,311.00	0.01
76	600660	福耀玻璃	38,100	992,124.00	0.01
77	601985	中国核电	126,700	989,527.00	0.01
78	601669	中国电建	124,600	986,832.00	0.01
79	600009	上海机场	26,200	977,522.00	0.01
80	601899	紫金矿业	281,400	965,202.00	0.01
81	002241	歌尔股份	50,000	964,000.00	0.01
82	000568	泸州老窖	19,000	961,020.00	0.01
83	300070	碧水源	51,200	954,880.00	0.01
84	601377	兴业证券	127,200	945,096.00	0.01
85	002456	欧菲光	51,600	937,572.00	0.01
86	600585	海螺水泥	40,900	929,657.00	0.01
87	000166	申万宏源	163,200	913,920.00	0.01
88	601607	上海医药	31,303	904,030.64	0.01
89	601727	上海电气	119,300	903,101.00	0.01
90	601872	招商轮船	174,800	901,968.00	0.01
91	601088	中国神华	38,349	900,434.52	0.01
92	300072	三聚环保	24,300	900,315.00	0.01

93	002236	大华股份	39,300	896,433.00	0.01
94	000069	华侨城 A	89,000	895,340.00	0.01
95	002736	国信证券	66,700	883,775.00	0.01
96	002466	天齐锂业	16,200	880,470.00	0.01
97	600886	国投电力	110,500	872,950.00	0.01
98	000338	潍柴动力	65,700	867,240.00	0.01
99	000783	长江证券	89,900	851,353.00	0.01
100	600196	复星医药	27,300	846,027.00	0.01
101	600068	葛洲坝	75,200	845,248.00	0.01
102	600031	三一重工	103,900	844,707.00	0.01
103	300059	东方财富	69,800	838,996.00	0.01
104	600029	南方航空	95,300	829,110.00	0.01
105	600010	包钢股份	370,840	812,139.60	0.00
106	601600	中国铝业	178,600	807,272.00	0.00
107	002008	大族激光	23,200	803,648.00	0.00
108	601888	中国国旅	26,518	799,252.52	0.00
109	600066	宇通客车	36,079	792,655.63	0.00
110	601788	光大证券	53,000	791,290.00	0.00
111	600637	东方明珠	35,800	775,786.00	0.00
112	600606	绿地控股	99,100	774,962.00	0.00
113	000625	长安汽车	52,900	762,818.00	0.00
114	601608	中信重工	135,400	750,116.00	0.00
115	000839	中信国安	74,600	745,254.00	0.00
116	601099	太平洋	184,900	743,298.00	0.00
117	002594	比亚迪	14,800	739,260.00	0.00
118	601933	永辉超市	104,000	736,320.00	0.00
119	600535	天士力	17,600	731,104.00	0.00
120	601555	东吴证券	65,100	731,073.00	0.00

121	601618	中国中冶	145,300	727,953.00	0.00
122	600893	航发动力	26,400	720,720.00	0.00
123	000413	东旭光电	63,600	713,592.00	0.00
124	600383	金地集团	61,200	701,964.00	0.00
125	600522	中天科技	58,200	701,310.00	0.00
126	600406	国电南瑞	39,500	697,175.00	0.00
127	000768	中航飞机	37,600	693,344.00	0.00
128	300124	汇川技术	27,100	692,134.00	0.00
129	600705	中航资本	121,800	688,170.00	0.00
130	002673	西部证券	47,500	675,450.00	0.00
131	600109	国金证券	57,400	672,728.00	0.00
132	002475	立讯精密	23,000	672,520.00	0.00
133	600816	安信信托	49,400	671,346.00	0.00
134	600111	北方稀土	59,100	669,603.00	0.00
135	601800	中国交建	41,500	659,435.00	0.00
136	000963	华东医药	13,200	656,040.00	0.00
137	002202	金风科技	42,400	655,928.00	0.00
138	002739	万达电影	12,800	652,416.00	0.00
139	000895	双汇发展	26,824	637,070.00	0.00
140	600570	恒生电子	13,400	625,512.00	0.00
141	600271	航天信息	30,300	625,392.00	0.00
142	601018	宁波港	107,200	605,680.00	0.00
143	600023	浙能电力	110,700	604,422.00	0.00
144	600739	辽宁成大	33,200	598,596.00	0.00
145	600177	雅戈尔	58,300	589,996.00	0.00
146	600352	浙江龙盛	61,900	589,907.00	0.00
147	601992	金隅股份	90,900	588,123.00	0.00
148	600674	川投能源	59,700	586,254.00	0.00

149	002049	紫光国芯	19,000	585,580.00	0.00
150	000728	国元证券	47,900	585,338.00	0.00
151	600547	山东黄金	20,200	584,386.00	0.00
152	000623	吉林敖东	25,250	577,972.50	0.00
153	300024	机器人	29,600	577,200.00	0.00
154	601225	陕西煤业	81,400	575,498.00	0.00
155	600221	海航控股	178,400	574,448.00	0.00
156	002508	老板电器	12,900	560,892.00	0.00
157	002044	美年健康	32,900	559,300.00	0.00
158	600018	上港集团	88,000	557,920.00	0.00
159	002065	东华软件	25,600	557,824.00	0.00
160	002007	华兰生物	15,200	554,800.00	0.00
161	000793	华闻传媒	54,700	553,564.00	0.00
162	600804	鹏博士	30,700	544,925.00	0.00
163	600115	东方航空	79,900	543,320.00	0.00
164	000157	中联重科	119,200	535,208.00	0.00
165	603993	洛阳钼业	105,600	534,336.00	0.00
166	600415	小商品城	73,800	534,312.00	0.00
167	000540	中天金融	76,400	530,980.00	0.00
168	601111	中国国航	54,000	526,500.00	0.00
169	600208	新湖中宝	116,800	525,600.00	0.00
170	601998	中信银行	83,200	523,328.00	0.00
171	600085	同仁堂	14,900	520,904.00	0.00
172	600820	隧道股份	51,400	519,140.00	0.00
173	601198	东兴证券	29,900	515,476.00	0.00
174	600436	片仔癀	8,200	500,528.00	0.00
175	002465	海格通信	46,600	500,484.00	0.00
176	600153	建发股份	38,500	497,805.00	0.00

177	000826	启迪桑德	13,900	488,168.00	0.00
178	000630	铜陵有色	171,400	486,776.00	0.00
179	002310	东方园林	29,100	486,552.00	0.00
180	600157	永泰能源	134,800	481,236.00	0.00
181	600362	江西铜业	28,200	475,452.00	0.00
182	300017	网宿科技	39,200	473,144.00	0.00
183	002081	金螳螂	43,000	472,140.00	0.00
184	000009	中国宝安	58,300	471,647.00	0.00
185	600663	陆家嘴	19,900	470,436.00	0.00
186	000060	中金岭南	42,000	470,400.00	0.00
187	000876	新希望	57,200	470,184.00	0.00
188	600489	中金黄金	46,800	469,404.00	0.00
189	600061	国投安信	30,100	468,055.00	0.00
190	002146	荣盛发展	47,200	465,864.00	0.00
191	600170	上海建工	120,800	461,456.00	0.00
192	601229	上海银行	17,900	457,166.00	0.00
193	002027	分众传媒	33,200	456,832.00	0.00
194	601155	新城控股	24,500	454,230.00	0.00
195	002074	国轩高科	14,300	451,165.00	0.00
196	600118	中国卫星	16,100	448,224.00	0.00
197	601216	君正集团	91,500	447,435.00	0.00
198	600332	白云山	15,300	444,312.00	0.00
199	600682	南京新百	12,000	442,800.00	0.00
200	002500	山西证券	46,000	440,680.00	0.00
201	000750	国海证券	80,100	440,550.00	0.00
202	600297	广汇汽车	58,200	438,246.00	0.00
203	601633	长城汽车	32,900	437,241.00	0.00
204	600008	首创股份	65,400	430,332.00	0.00

205	300315	掌趣科技	52,600	429,216.00	0.00
206	600369	西南证券	76,500	429,165.00	0.00
207	000425	徐工机械	114,100	427,875.00	0.00
208	600150	中国船舶	18,700	427,669.00	0.00
209	601333	广深铁路	91,900	415,388.00	0.00
210	300144	宋城演艺	19,700	411,139.00	0.00
211	000559	万向钱潮	37,300	396,126.00	0.00
212	000792	盐湖股份	37,800	395,010.00	0.00
213	600688	上海石化	59,400	392,634.00	0.00
214	000686	东北证券	38,100	382,905.00	0.00
215	002195	二三四五	53,500	382,525.00	0.00
216	000402	金融街	32,400	379,728.00	0.00
217	600583	海油工程	60,000	374,400.00	0.00
218	601117	中国化学	53,500	373,965.00	0.00
219	300033	同花顺	5,900	367,039.00	0.00
220	600718	东软集团	23,600	366,980.00	0.00
221	300027	华谊兄弟	45,300	366,477.00	0.00
222	000709	河钢股份	87,300	365,787.00	0.00
223	600654	*ST 中安	27,000	363,960.00	0.00
224	002411	必康股份	12,500	361,500.00	0.00
225	600649	城投控股	34,300	360,493.00	0.00
226	600498	烽火通信	14,200	359,970.00	0.00
227	600895	张江高科	21,000	354,480.00	0.00
228	600827	百联股份	21,800	354,250.00	0.00
229	600373	中文传媒	15,000	352,650.00	0.00
230	600256	广汇能源	84,900	351,486.00	0.00
231	000983	西山煤电	40,000	350,800.00	0.00
232	002385	大北农	55,600	349,724.00	0.00

233	000917	电广传媒	30,800	348,040.00	0.00
234	002183	怡亚通	40,200	346,926.00	0.00
235	600588	用友网络	19,900	340,688.00	0.00
236	600704	物产中大	46,700	340,443.00	0.00
237	600074	保千里	26,500	339,465.00	0.00
238	000415	渤海金控	50,300	338,519.00	0.00
239	600666	奥瑞德	19,360	336,864.00	0.00
240	000008	神州高铁	45,700	332,696.00	0.00
241	600060	海信电器	21,300	323,121.00	0.00
242	002470	金正大	42,600	320,778.00	0.00
243	600919	江苏银行	34,500	320,505.00	0.00
244	600376	首开股份	28,000	320,320.00	0.00
245	601718	际华集团	35,800	314,682.00	0.00
246	601866	中远海发	86,000	309,600.00	0.00
247	002558	巨人网络	6,600	305,052.00	0.00
248	002602	世纪华通	8,400	304,584.00	0.00
249	002352	顺丰控股	5,700	303,012.00	0.00
250	000959	首钢股份	43,000	300,570.00	0.00
251	002174	游族网络	9,400	298,544.00	0.00
252	600909	华安证券	29,500	297,655.00	0.00
253	601997	贵阳银行	18,700	295,647.00	0.00
254	600038	中直股份	6,400	292,928.00	0.00
255	300168	万达信息	19,900	289,545.00	0.00
256	002555	三七互娱	11,300	288,941.00	0.00
257	600977	中国电影	15,200	284,544.00	0.00
258	000977	浪潮信息	16,300	282,316.00	0.00
259	600037	歌华有线	18,900	275,184.00	0.00
260	002152	广电运通	32,950	273,814.50	0.00

261	600737	中粮糖业	28,000	264,320.00	0.00
262	002714	牧原股份	9,500	258,590.00	0.00
263	000671	阳光城	43,900	255,498.00	0.00
264	600549	厦门钨业	11,800	253,582.00	0.00
265	002131	利欧股份	76,000	250,040.00	0.00
266	600372	中航电子	14,300	248,391.00	0.00
267	600685	中船防务	9,000	246,420.00	0.00
268	000738	航发控制	12,500	244,625.00	0.00
269	000938	紫光股份	4,000	244,480.00	0.00
270	601118	海南橡胶	42,700	242,536.00	0.00
271	000718	苏宁环球	41,200	241,432.00	0.00
272	600482	中国动力	9,500	240,255.00	0.00
273	002292	奥飞娱乐	14,200	239,980.00	0.00
274	600446	金证股份	13,600	239,088.00	0.00
275	000156	华数传媒	15,600	232,596.00	0.00
276	600021	上海电力	18,700	226,083.00	0.00
277	601021	春秋航空	6,600	221,958.00	0.00
278	601375	中原证券	21,800	219,308.00	0.00
279	002424	贵州百灵	11,500	216,890.00	0.00
280	300133	华策影视	19,000	212,800.00	0.00
281	601881	中国银河	17,500	207,550.00	0.00
282	000627	天茂集团	24,800	200,384.00	0.00
283	002153	石基信息	8,700	197,751.00	0.00
284	000961	中南建设	30,200	196,904.00	0.00
285	300251	光线传媒	23,900	195,741.00	0.00
286	601958	金钼股份	26,300	188,571.00	0.00
287	600233	圆通速递	9,200	180,228.00	0.00
288	002299	圣农发展	12,100	179,927.00	0.00

289	601163	三角轮胎	6,600	173,580.00	0.00
290	601611	中国核建	14,300	171,171.00	0.00
291	600871	石化油服	49,000	163,660.00	0.00
292	600926	杭州银行	11,000	163,350.00	0.00
293	603858	步长制药	2,100	150,444.00	0.00
294	601966	玲珑轮胎	6,600	148,038.00	0.00
295	601877	正泰电器	7,300	146,657.00	0.00
296	603160	汇顶科技	1,389	139,316.70	0.00
297	000555	神州信息	7,900	131,930.00	0.00
298	600188	兖州煤业	10,500	128,520.00	0.00
299	601127	小康股份	4,900	97,755.00	0.00
300	002797	第一创业	10,500	96,705.00	0.00
301	002841	视源股份	1,300	96,486.00	0.00
302	002831	裕同科技	1,200	90,000.00	0.00
303	002839	张家港行	4,400	69,168.00	0.00
304	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
305	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
306	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
307	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
308	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
309	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
310	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
311	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
312	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
313	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
314	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
315	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
316	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00

317	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
318	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
319	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

根据本基金基金合同的约定, 本基金为目标 ETF 的联接基金, 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90% (已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内)。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	15,909,594.64	0.10
2	601166	兴业银行	8,656,927.00	0.06
3	600016	民生银行	8,249,658.00	0.05
4	600036	招商银行	7,846,559.52	0.05
5	600519	贵州茅台	7,489,274.79	0.05
6	601328	交通银行	6,803,962.00	0.04
7	000333	美的集团	6,013,095.30	0.04
8	000651	格力电器	5,716,496.15	0.04
9	600000	浦发银行	5,589,861.00	0.04
10	000002	万科 A	5,563,908.77	0.04
11	601668	中国建筑	5,465,177.00	0.04
12	600030	中信证券	5,216,670.47	0.03
13	601288	农业银行	5,026,494.00	0.03
14	600837	海通证券	5,004,906.08	0.03
15	601169	北京银行	4,584,519.52	0.03
16	600887	伊利股份	4,502,069.35	0.03
17	601398	工商银行	4,085,757.00	0.03
18	601766	中国中车	4,043,168.00	0.03

19	600104	上汽集团	3,588,428.52	0.02
20	600900	长江电力	3,523,740.50	0.02

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	47,983,600.48	0.31
2	600519	贵州茅台	24,662,312.88	0.16
3	601166	兴业银行	20,602,864.59	0.13
4	600016	民生银行	20,507,591.80	0.13
5	600036	招商银行	20,200,846.14	0.13
6	000333	美的集团	17,470,216.33	0.11
7	601328	交通银行	17,276,420.32	0.11
8	000651	格力电器	16,869,153.91	0.11
9	000002	万科A	14,784,421.33	0.10
10	600000	浦发银行	14,562,679.62	0.09
11	601668	中国建筑	14,526,044.74	0.09
12	600030	中信证券	13,433,725.25	0.09
13	601288	农业银行	13,271,339.35	0.09
14	600837	海通证券	12,775,483.51	0.08
15	600887	伊利股份	12,150,322.49	0.08
16	601169	北京银行	11,555,265.76	0.07
17	601398	工商银行	10,877,634.99	0.07
18	601766	中国中车	10,035,093.21	0.06
19	600104	上汽集团	9,947,010.38	0.06
20	601601	中国太保	9,830,462.99	0.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	384,498,844.45
卖出股票收入（成交）总额	1,004,287,161.81

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,742,000.00	0.79
	其中：政策性金融债	129,742,000.00	0.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,742,000.00	0.79

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170203	17 国开 03	700,000	69,748,000.00	0.42
2	150201	15 国开 01	600,000	59,994,000.00	0.36

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	嘉实沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	15,347,864,010.81	92.89

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF1709	沪深 300 股指期货 IF1709 合约	27	29,409,480.00	1,235,100.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					1,235,100.00
股指期货投资本期收益 (元)					9,182,760.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					1,235,100.00

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股、备选成份股和目标 ETF。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内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。

7.13.2

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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,333,364.39
2	应收证券清算款	12,929,509.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,196,451.70
5	应收申购款	2,110,078.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,569,404.64

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600050	中国联通	4,693,620.00	0.03	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
598,258	26,373.11	5,040,640,205.63	31.95%	10,737,282,767.73	68.05%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	青岛国信金融控股有限公司	42,807,300.00	7.28%
2	邵阳市精英职业技术学校	19,109,284.00	3.25%
3	工银安盛人寿保险有限公司	9,691,189.00	1.65%
4	文竹	8,180,601.00	1.39%
5	温国伟	5,429,323.00	0.92%
6	鲁国尧	3,937,142.00	0.67%
7	华夏基金—中国银行—华夏资本管 理有限公司	3,819,408.00	0.65%
8	赵玉玲	3,720,000.00	0.63%
9	王宪	2,974,200.00	0.51%
10	崔钱德	2,900,000.00	0.49%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	943,839.14	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 8 月 29 日）基金份额总额	867,126,900.07
本报告期期初基金份额总额	16,471,718,122.06
本报告期基金总申购份额	865,993,511.91
减：本报告期基金总赎回份额	1,559,788,660.61
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	15,777,922,973.36

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
招商证券股 份有限公司	3	434,425,718.54	31.39%	304,105.58	31.41%	-
方正证券股 份有限公司	3	382,163,431.71	27.61%	267,514.63	27.63%	-
东方证券股 份有限公司	4	212,731,564.92	15.37%	148,912.12	15.38%	-
浙商证券股 份有限公司	1	192,640,212.83	13.92%	134,848.19	13.93%	-
国金证券股 份有限公司	2	90,647,967.59	6.55%	63,453.56	6.55%	-
中国国际金 融股份有限 公司	3	71,558,465.61	5.17%	49,317.35	5.09%	新增 1 个
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	新增 2 个
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
华西证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经 纪有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	新增

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：平安证券有限责任公司更名为平安证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租深圳交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	20,000,000.00	0.34%	-	-	141,238,873.01	100.00%
方正证券股份有限公司	-	-	3,203,400,000.00	55.22%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	314,000,000.00	5.41%	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	1,290,500,000.00	22.25%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	266,446.10	100.00%	715,000,000.00	12.33%	-	-	-	-

中国国 际金 融股 份 有 限 公 司			258,000,000.00	4.45%				
--	--	--	----------------	-------	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加广州农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年1月13日
2	关于嘉实旗下部分开放式基金转换业务更新的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年4月12日
3	关于增加创金启富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年4月14日
4	关于增加北京肯特瑞为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年5月31日
5	关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年6月28日
6	关于增加中民财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/01/01 至 2017/06/30	4,152,894,261.69	-	-	4,152,894,261.69	26.32%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2005]103 号）、中国证监会《关于核准嘉实沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2012]1146 号）；

(2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》；

(3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》；

(4) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金托管协议》；

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日