

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 26 日

§ 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 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	300ETF
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	5,603,506,477.00 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	2012 年 5 月 28 日

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，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	王永民
	联系电话	(010)66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010)65215588	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-6,548,248.53	735,023,006.08	220,321,190.03
本期利润	-4,684,725,114.57	3,766,516,136.91	-1,913,308,668.91
加权平均基金份额本期利润	-1.0366	0.8396	-0.3737
本期加权平均净值利润率	-26.38%	21.10%	-10.87%
本期基金份额净值增长率	-24.03%	23.36%	-9.39%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	4,083,151,385.90	7,442,246,508.76	4,637,105,373.83
期末可供分配基金份额利润	0.7287	1.7867	0.9529
期末基金资产净值	18,743,619,783.58	18,339,948,550.23	17,369,097,146.87
期末基金份额净值	3.3450	4.4030	3.5692
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	27.85%	68.29%	36.42%

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

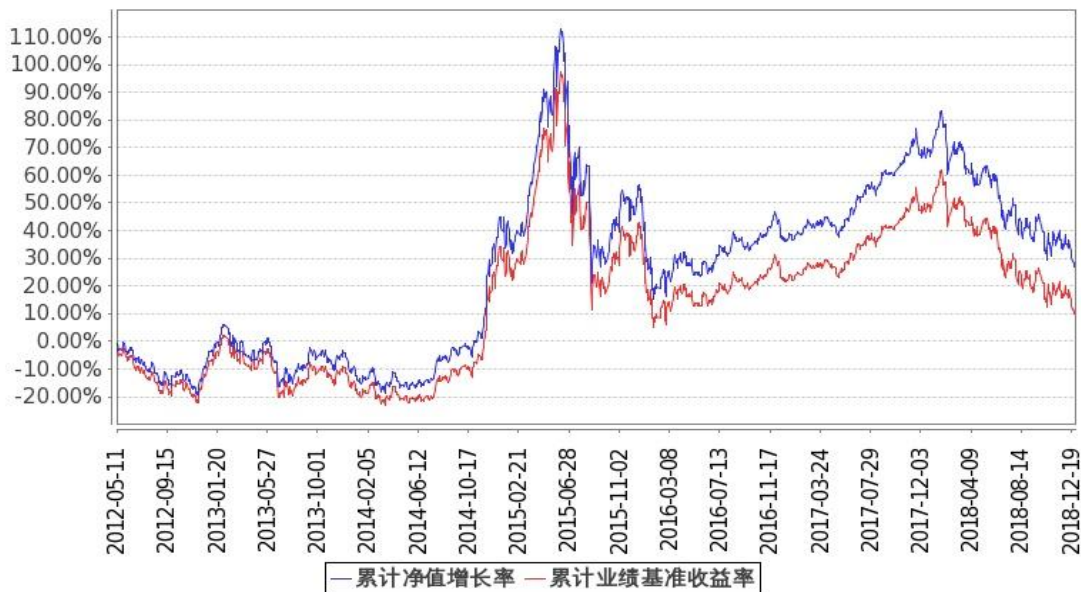
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-12.45%	1.64%	-12.45%	1.64%	0.00%	0.00%

过去六个月	-13.34%	1.50%	-14.25%	1.50%	0.91%	0.00%
过去一年	-24.03%	1.34%	-25.31%	1.34%	1.28%	0.00%
过去三年	-15.08%	1.17%	-19.31%	1.18%	4.23%	-0.01%
过去五年	40.44%	1.53%	29.21%	1.53%	11.23%	0.00%
自基金合同 生效起至今	27.85%	1.48%	10.85%	1.49%	17.00%	-0.01%

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

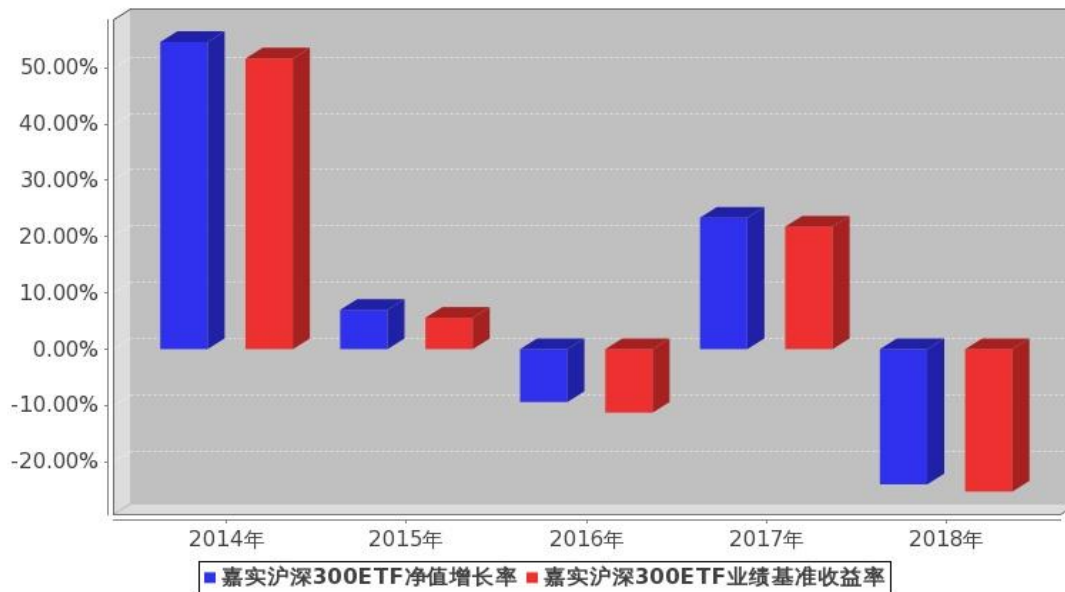


图：嘉实沪深 300ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 5 月 7 日至 2018 年 12 月 31 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 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“十五（二）投资范围和（八）2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 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、北京怀柔、武汉设有分公司。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2018年12月31日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、144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（QDII）混合、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）、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 A/E、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、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实惠泽混合 (LOF)、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、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、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、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、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。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，基金管理人还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	离任日期		

		期			
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、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	-	13 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。
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、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	2016 年 1 月 5 日	-	12 年	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，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。

注：(1) 任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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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 12 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

2018 年，A 股市场在 1 月上涨后，在中美贸易战和国内经济增长等因素的影响下，市场持续

呈阶梯式下跌，全年的关键词是中美贸易争端和宏观经济政策。

中美贸易争端始于 4 月，美国依据 301 调查结果对从中国进口的 500 亿美元商品征收额外 25% 关税，中国也发布反制征税清单，此后事态不断恶化；9 月，美国对约 2000 亿美元中国商品加征 10% 关税；2019 年 3 月底是中美贸易争端的关键节点，目前磋商仍在持续进行。货币政策方面，中国央行有多次降准措施，包括普惠金融定向降准、直接下调存款准备金率等举措，在稳健中性的基调上边际放松；财政政策方面较为积极，开始推进减税降费，包括个人所得税、企业所得税和关税等；地产政策方面，中央继续坚持“房住不炒”的基调，地方政府继续市场调控，调整棚改货币化、房产税立法推进等；金融监管方面，防范和化解系统性风险，上半年围绕资管新规，银行、证券、保险等监管细则相继落地，下半年在国内经济承压的情况下，金融监管政策出现调整，包括纾困民营和小微企业等，寻求防风险和稳增长的平衡。沪深 300 指数于年末收于 3010.65 点，报告期内沪深 300 指数下跌 25.31%。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回以及成份股调整等工作。报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.42%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2% 的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于本基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红、样本股调整的冲击以及股指期货与现货间的基差波动。

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 3.3450 元；本报告期基金份额净值增长率为-24.03%，业绩比较基准收益率为-25.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。展望 2019 年，目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置，具有中长期投资价值。

本基金主要采用组合复制策略实现基金的投资目标。作为一只投资于沪深 300 指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将继续积极推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 工具性的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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”）在嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（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 审计报告

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计、注册会计师薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2019)第 22764 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,854,841.01	11,994,527.27
结算备付金		2,949,257.00	8,180,611.51
存出保证金		2,577,992.63	1,156,919.86
交易性金融资产	7.4.7.2	18,718,783,312.15	18,319,014,118.21
其中：股票投资		18,715,314,312.15	18,317,921,118.21
基金投资		-	-
债券投资		3,469,000.00	1,093,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	19,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		4,142,066.83	4,196,297.44
应收利息	7.4.7.5	437.58	1,356.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		18,759,307,907.20	18,354,543,830.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,659,078.05	1,990,613.04
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,044,905.93	7,611,120.91
应付托管费		1,608,981.15	1,522,224.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,477,244.50	1,623,542.60
应交税费		13.30	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,897,900.69	1,847,779.46
负债合计		15,688,123.62	14,595,280.19
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	14,660,468,397.68	10,897,702,041.47
未分配利润	7.4.7.10	4,083,151,385.90	7,442,246,508.76
所有者权益合计		18,743,619,783.58	18,339,948,550.23
负债和所有者权益总计		18,759,307,907.20	18,354,543,830.42

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.3450 元，基金份额总额 5,603,506,477.00 份。

7.2 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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-4,565,864,108.23	3,887,628,838.28
1. 利息收入		1,230,310.97	3,017,624.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	299,105.17	726,199.21
债券利息收入		2,603.49	2,936.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		928,602.31	2,288,488.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		113,028,286.24	853,032,215.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-256,727,942.10	461,130,575.52

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,144,298.99	1,896,914.56
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-3,870,417.95	36,548,400.00
股利收益	7.4.7.15	372,482,347.30	353,456,325.07
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-4,678,176,866.04	3,031,493,130.83
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-1,945,839.40	85,867.79
减：二、费用		118,861,006.34	121,112,701.37
1. 管理人报酬		88,852,770.58	89,186,264.93
2. 托管费		17,770,554.10	17,837,252.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,364,091.01	8,190,815.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		991.67	-
7. 其他费用	7.4.7.19	5,872,598.98	5,898,368.46
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-4,684,725,114.57	3,766,516,136.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-4,684,725,114.57	3,766,516,136.91

7.3 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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	10,897,702,041.47	7,442,246,508.76	18,339,948,550.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,684,725,114.57	-4,684,725,114.57
三、本期基金份	3,762,766,356.21	1,325,629,991.71	5,088,396,347.92

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	4,798,822,174.17	1,953,563,765.78	6,752,385,939.95
2. 基金赎回款	-1,036,055,817.96	-627,933,774.07	-1,663,989,592.03
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)	14,660,468,397.68	4,083,151,385.90	18,743,619,783.58
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	12,731,991,773.04	4,637,105,373.83	17,369,097,146.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,766,516,136.91	3,766,516,136.91
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)	-1,834,289,731.57	-961,375,001.98	-2,795,664,733.55
其中: 1. 基金申购款	520,382,581.15	343,701,099.18	864,083,680.33
2. 基金赎回款	-2,354,672,312.72	-1,305,076,101.16	-3,659,748,413.88
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)	10,897,702,041.47	7,442,246,508.76	18,339,948,550.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>王红</u>	<u>张公允</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)（“嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)”）	本基金的联接基金

7.4.4 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。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,852,770.58	89,186,264.93
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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 0.5% 的年费率计提，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 × 0.5% /

当年天数。

7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,770,554.10	17,837,252.90

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本期（2018年1月1日至2018年12月31日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017年12月31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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内（2018年1月1日至2018年12月31日）及上年度可比期间（2017年1月1日至2017年12月31日），基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.4.4.4.2 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

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)	4,723,837,402.00	84.30	3,638,972,136.00	87.36

7.4.4.5 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	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	11,854,841.01	115,377.92	11,994,527.27	263,967.36

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	网下申购
7.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018年12月21日	2019年1月18日	未上市	100.00	100.00	34,690	3,469,000.00	3,469,000.00	网上申购

注:以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上市公司公告为准。

7.4.5.2 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
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	4.87	2019年1月2日	4.38	6,796,800	37,680,634.93	33,100,416.00	-
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项停牌	16.01	2019年1月10日	17.15	15,545,928	274,455,264.42	248,890,307.28	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	-	-	2,708,581	50,565,959.01	39,518,196.79	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2018 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2018 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	18,715,314,312.15	99.77
	其中：股票	18,715,314,312.15	99.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,469,000.00	0.02
	其中：债券	3,469,000.00	0.02
	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	19,000,000.00	0.10
	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	14,804,098.01	0.08
8	其他各项资产	6,720,497.04	0.04
9	合计	18,759,307,907.20	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	35,694,275.00	0.19
B	采矿业	686,486,853.31	3.66
C	制造业	7,293,070,553.57	38.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	572,264,590.65	3.05
E	建筑业	732,384,454.02	3.91
F	批发和零售业	310,840,378.46	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	594,743,260.63	3.17

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	650,532,835.06	3.47
J	金融业	6,412,910,794.59	34.21
K	房地产业	891,502,760.90	4.76
L	租赁和商务服务业	231,979,418.96	1.24
M	科学研究和技术服务业	15,570,880.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	44,008,420.65	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	105,324,247.10	0.56
R	文化、体育和娱乐业	65,267,162.60	0.35
S	综合	-	-
	合计	18,642,580,885.50	99.46

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,584,236.29	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	33,100,416.00	0.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,734,798.09	0.39

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	21,497,541	1,206,012,050.10	6.43
2	600519	贵州茅台	997,270	588,399,272.70	3.14
3	600036	招商银行	20,469,200	515,823,840.00	2.75
4	601166	兴业银行	24,736,032	369,556,318.08	1.97
5	000651	格力电器	9,550,608	340,861,199.52	1.82
6	000333	美的集团	9,205,851	339,327,667.86	1.81
7	601328	交通银行	54,525,726	315,703,953.54	1.68
8	600016	民生银行	49,262,578	282,274,571.94	1.51
9	600887	伊利股份	12,062,050	275,979,704.00	1.47
10	601288	农业银行	76,025,297	273,691,069.20	1.46

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	2,708,581	39,518,196.79	0.21
2	000540	中天金融	6,796,800	33,100,416.00	0.18
3	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
4	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00

注：（1）信威集团、中天金融 2 只股票已被调出指数成分股，因停牌等原因暂无法卖出；（2）报告期末，本基金仅持有上述 4 支积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603288	海天味业	101,315,503.25	0.55

2	601229	上海银行	74,403,948.59	0.41
3	000333	美的集团	65,589,492.09	0.36
4	600867	通化东宝	57,331,415.44	0.31
5	600487	亨通光电	52,148,689.60	0.28
6	000661	长春高新	51,316,087.43	0.28
7	300142	沃森生物	46,333,478.92	0.25
8	600516	方大炭素	45,328,907.25	0.25
9	601766	中国中车	44,011,215.99	0.24
10	300408	三环集团	41,427,562.55	0.23
11	601318	中国平安	40,289,951.76	0.22
12	600176	中国巨石	39,289,644.38	0.21
13	600398	海澜之家	37,995,450.26	0.21
14	603993	洛阳钼业	37,982,237.00	0.21
15	002422	科伦药业	37,219,213.31	0.20
16	002311	海大集团	36,991,569.70	0.20
17	600340	华夏幸福	33,167,485.72	0.18
18	000703	恒逸石化	31,609,742.53	0.17
19	600027	华电国际	30,162,246.58	0.16
20	000786	北新建材	30,090,883.44	0.16

8.4.2 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	100,735,626.65	0.55
2	600519	贵州茅台	90,285,493.14	0.49
3	600016	民生银行	66,416,059.49	0.36
4	600036	招商银行	42,998,625.31	0.23
5	601099	太平洋	37,087,318.98	0.20
6	000651	格力电器	30,696,973.22	0.17
7	000623	吉林敖东	29,344,825.77	0.16
8	601166	兴业银行	28,984,888.53	0.16
9	002739	万达电影	26,522,364.71	0.14
10	600804	鹏博士	24,516,577.82	0.13
11	600887	伊利股份	24,357,434.96	0.13
12	000333	美的集团	24,205,849.31	0.13
13	601328	交通银行	23,668,348.85	0.13
14	600820	隧道股份	23,145,806.65	0.13
15	002465	海格通信	23,113,057.06	0.13
16	002500	山西证券	22,546,326.23	0.12
17	000060	中金岭南	21,881,009.56	0.12
18	600276	恒瑞医药	21,714,193.07	0.12
19	600663	陆家嘴	21,563,796.28	0.12

20	002470	金正大	20,992,623.34	0.11
----	--------	-----	---------------	------

8.4.3 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	2,841,400,692.08
卖出股票收入（成交）总额	2,398,740,959.75

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	3,469,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,469,000.00	0.02

8.6 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	110049	海尔转债	34,690	3,469,000.00	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
----	----	----------	---------	-----------	------

IF1901	IF1901	24	21,625,920.00	-972,230.40	-
公允价值变动总额合计（元）					-972,230.40
股指期货投资本期收益（元）					-3,870,417.95
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,069,130.40

8.10.2 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和备选成份股。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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2018年3月16日，中国人民银行发布银支付罚决字【2018】1号，对中国民生银行股份有限公司厦门分行（新兴支付清算中心），违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，于2018年3月14日作出行政处罚决定，给予警告，没收违法所得48,418,193.27元，并处罚款114,639,752.47元，合计处罚金额163,057,945.74元。2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）8号），对中国民生银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，同业投资违规接受担保等违规事实，于2018年11月9日作出行政处罚决定，罚款3160万元。2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）5号），对中国民生银行股份有限公司贷款业务严重违反审慎经营规则的违规事实，于2018年11月9日作出行政处罚决定，罚款200万元。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）1号），对兴业银行股份有限公司重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告，非真实转让信贷资产等违规事实，于2018年4月19日作出行政处罚决定，罚款5870万元。

2018年8月1日，中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号，于2018年7月26日作出行政处罚决定，对交通银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以50万元罚款；未按照规定报送大额交易

报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 40 万元罚款；存在与身份不明的客户进行交易的行为，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（四）项规定，处以 40 万元罚款；对交通银行合计处以 130 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 8 万元罚款。2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）12 号），对交通银行股份有限公司不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权、未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产等违规事实，于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定，罚款 690 万元。2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）13 号），对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违规事实，于 2018 年 11 月 9 日作出行政处罚决定，罚款 50 万元。

2018 年 5 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银监罚决字（2018）1 号），对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实，于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金投资于“民生银行（600016）”、“兴业银行（601166）”、“交通银行（601328）”、“招商银行（600036）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，民生银行、兴业银行、交通银行、招商银行为标的指数的成份股，本基金投资于“浦发银行”、“民生银行”、“兴业银行”、“交通银行”、“招商银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他六名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,577,992.63
2	应收证券清算款	4,142,066.83
3	应收股利	-
4	应收利息	437.58
5	应收申购款	-

6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	6,720,497.04

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五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	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	39,518,196.79	0.21	重大事项停牌
2	000540	中天金融	33,100,416.00	0.18	重大事项停牌
3	601860	紫金银行	50,145.80	0.00	未上市

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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（%）
22,597	247,975.68	5,169,197,555.00	92.25	434,308,922.00	7.75

9.1.2 ETF 联接基金期末持有份额及占比

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)	4,723,837,402.00	84.30

9.2 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	中央汇金投资有限责任公司	75,000,000.00	1.34
2	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	53,845,187.00	0.96
3	中央汇金资产管理有限责任公司	30,483,400.00	0.54
4	中国人寿保险股份有限公司	27,869,524.00	0.50

5	国开金融有限责任公司	27,098,983.00	0.48
6	百年人寿保险股份有限公司—分红保险产品	25,870,400.00	0.46
7	沈开成	24,463,505.00	0.44
8	百年人寿保险股份有限公司—传统保险产品	20,358,100.00	0.36
9	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001 深	14,866,751.00	0.27
10	南京紫金资产管理有限公司	10,906,132.00	0.19
11	中国银行股份有限公司—嘉实沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,723,837,402.00	84.30

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年5月7日）基金份额总额	19,333,307,392.00
本报告期期初基金份额总额	4,165,306,477.00
本报告期基金总申购份额	1,834,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	396,000,000.00
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	5,603,506,477.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2018年3月21日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

(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，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 160,000.00 元，该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中国国际金融股份有限公司	3	2,331,022,863.64	44.57%	1,471,549.30	42.13%	-
中信证券股份有限公司	5	936,587,431.31	17.91%	654,361.33	18.73%	-
长江证券股份有限公司	1	427,952,506.10	8.18%	299,578.02	8.58%	-

公司						
广发证券 股份有限 公司	4	343,903,811.70	6.58%	240,737.62	6.89%	-
海通证券 股份有限 公司	2	266,042,163.72	5.09%	186,231.96	5.33%	-
光大证券 股份有限 公司	1	234,673,442.12	4.49%	164,271.53	4.70%	-
东方证券 股份有限 公司	4	164,607,394.19	3.15%	115,229.75	3.30%	-
中信建投 证券股份 有限公司	4	162,174,802.99	3.10%	113,523.57	3.25%	-
中泰证券 股份有限 公司	4	96,083,848.58	1.84%	67,259.08	1.93%	-
天风证券 股份有限 公司	2	88,972,920.47	1.70%	56,169.20	1.61%	-
兴业证券 股份有限 公司	3	81,453,974.97	1.56%	57,018.10	1.63%	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	49,630,161.84	0.95%	34,744.89	0.99%	-
国泰君安 证券股份	4	32,752,900.46	0.63%	22,927.15	0.66%	-

有限公司						
东吴证券 股份有限 公司	3	9,534,234.59	0.18%	6,018.94	0.17%	-
西南证券 股份有限 公司	2	5,017,193.60	0.10%	3,167.29	0.09%	新增
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 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天源证券 经纪有限	1	-	-	-	-	-

公司						
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	新增1 个
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任	2	-	-	-	-	-

公司						
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
广州证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
中银国际 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

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。

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。

3：中银国际证券有限责任公司更名为中银国际证券股份有限公司。

11.7.2 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	
	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
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	1,127,000,000.00	18.46%	-	-

中信证券 股份有限 公司	3,951,717.27	24.71%	1,235,500,000.00	20.23%	-	-
长江证券 股份有限 公司	3,150,540.00	19.70%	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	284,000,000.00	4.65%	-	-
光大证券 股份有限 公司	892,587.50	5.58%	192,000,000.00	3.14%	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	1,195,000,000.00	19.57%	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	6,746,667.39	42.19%	485,000,000.00	7.94%	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1,246,774.80	7.80%	1,255,000,000.00	20.55%	-	-
天风证券 股份有限 公司	1,093.60	0.01%	315,000,000.00	5.16%	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	18,000,000.00	0.29%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2018/01/01 至 2018/12/31	3,638,972,136.00	3,609,604,521.00	2,524,739,255.00	4,723,837,402.00	84.30

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连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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

2019 年 03 月 26 日