

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

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 08 月 29 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 2019 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 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)	
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	19,524,273,534.81 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	
下属分级基金的基金简称	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	嘉实 300A	嘉实 300C
下属分级基金的交易代码	160706	160724
报告期末下属分级基金的份额总额	19,067,766,116.73 份	456,507,418.08 份

注:由于 C 类基金份额只开通场外份额,在这里“嘉实 300C”不是严格意义的“场内简称”,而是指本基金在交易所新增的场外份额简称。

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 $\times 95\%$ + 银行活期存款税后利率 $\times 5\%$
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
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
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

§ 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(2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
本期已实现收益	975,085,510.62	8,561,393.31
本期利润	4,124,651,261.65	-21,983,589.72
加权平均基金份额本期利润	0.2330	-0.1017
本期加权平均净值利润率	22.53%	-8.94%
本期基金份额净值增长率	26.24%	26.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
期末可供分配利润	1,941,703,052.69	29,984,222.32
期末可供分配基金份额利润	0.1018	0.0657
期末基金资产净值	21,009,469,169.42	529,014,913.90
期末基金份额净值	1.1018	1.1588
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	321.23%	15.88%

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）自 2018 年 8 月 8 日起对本基金增加 C 类基金份额类别；自 2018 年 8 月 8 日起开放嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）C 的申赎业务；（4）嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；（5）

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

嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A

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	5.74%	1.11%	5.13%	1.10%	0.61%	0.01%
过去三个月	-0.23%	1.46%	-1.11%	1.45%	0.88%	0.01%
过去六个月	26.24%	1.47%	25.65%	1.47%	0.59%	0.00%
过去一年	10.31%	1.45%	8.66%	1.45%	1.65%	0.00%
过去三年	26.37%	1.05%	20.45%	1.05%	5.92%	0.00%
自基金合同生 效起至今	321.23%	1.66%	295.25%	1.66%	25.98%	0.00%

嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C

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	5.70%	1.11%	5.13%	1.10%	0.57%	0.01%
过去三个月	-0.31%	1.46%	-1.11%	1.45%	0.80%	0.01%
过去六个月	26.11%	1.47%	25.65%	1.47%	0.46%	0.00%
自基金合同生 效起至今	15.88%	1.46%	14.75%	1.46%	1.13%	0.00%

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)A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

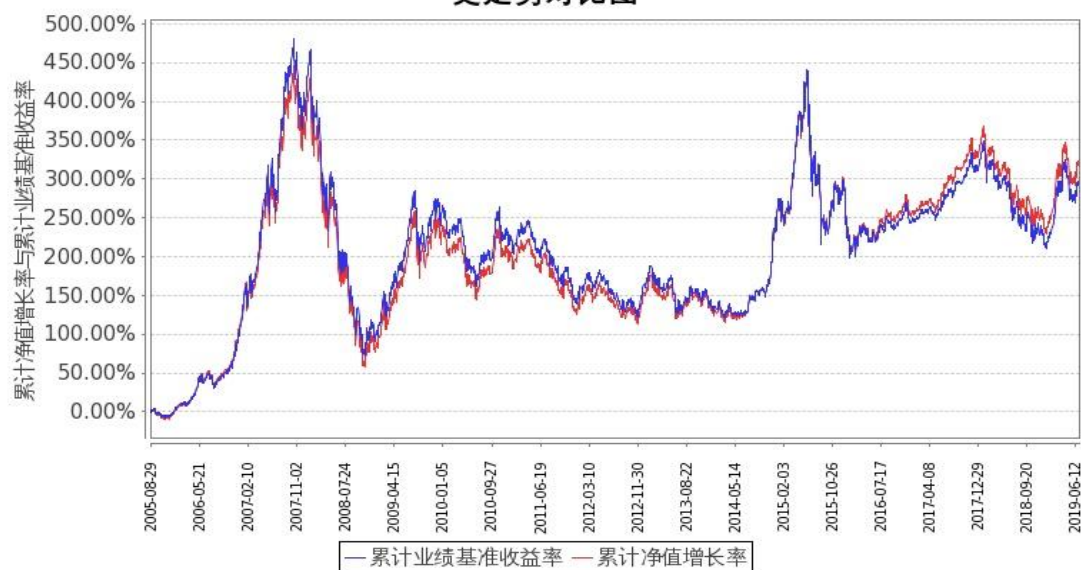


图 1：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005 年 8 月 29 日至 2019 年 6 月 30 日)

嘉实沪深300ETF联接(LOF)C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

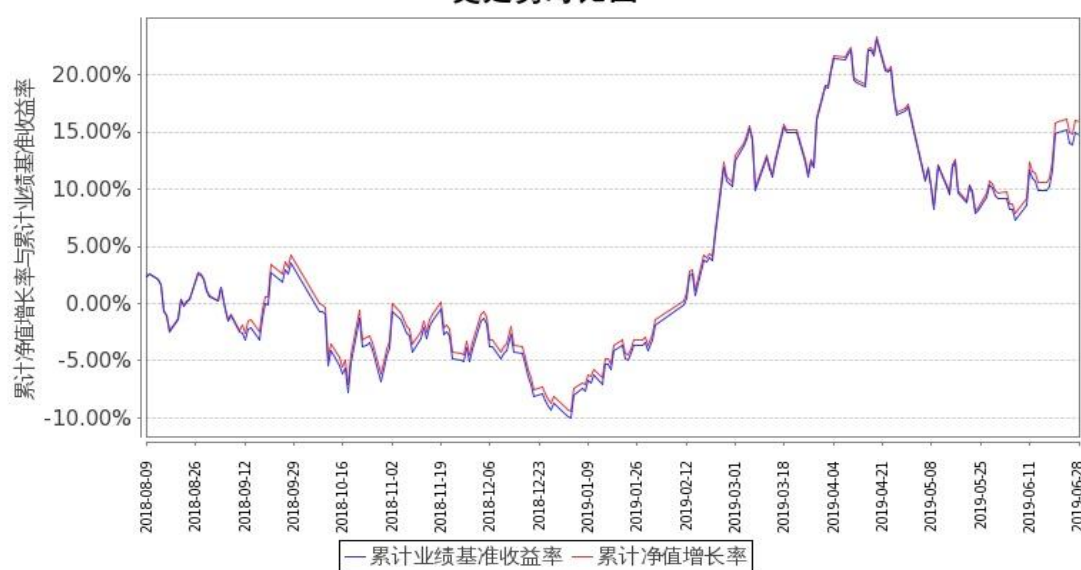


图 2：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 8 月 9 日至 2019 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、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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 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、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。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
----	----	-------------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
陈正宪	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、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、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实基本面 50ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日		14 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、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、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、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实基本面 50ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日		13 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、离职日期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 4 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 0.03%，年化跟踪误差为 0.44%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3% 的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 基金份额净值为 1.1018 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.24%；截至本报告期末嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 基金份额净值为 1.1588 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.11%；业绩比较基准收益率为 25.65%。

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。本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，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

(1) 报告期内基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告嘉实沪深 300ETF 联接 C 本报告 3.1.1 “本期利润”为-21,983,589.72 元，以及本基金基金合同（二十二（三）基金收益分配的原则）约定，因此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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	755,633,195.67	677,241,053.05
结算备付金		130,485,531.06	28,870,504.37
存出保证金		9,489,700.00	12,461,519.85
交易性金融资产	6.4.7.2	20,679,386,460.01	16,114,948,250.57
其中: 股票投资		66,494,430.50	113,089,140.88
基金投资		20,333,079,029.51	15,801,236,109.69
债券投资		279,813,000.00	200,623,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,060,054.96	6,310,058.45
应收股利		-	-
应收申购款		5,946,601.52	125,342,537.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,586,001,543.22	16,965,173,924.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		20,297,566.43	76,396,149.88
应付赎回款		20,884,626.34	3,210,997.68
应付管理人报酬		710,037.06	599,576.39
应付托管费		142,007.44	119,915.26
应付销售服务费		168,395.32	1,503.73
应付交易费用	6.4.7.7	4,609,307.39	1,502,847.18
应交税费		-	1.21
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	705,519.92	955,006.20
负债合计		47,517,459.90	82,785,997.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	19,524,273,534.81	19,343,221,949.69
未分配利润	6.4.7.10	2,014,210,548.51	-2,460,834,023.04

所有者权益合计		21,538,484,083.32	16,882,387,926.65
负债和所有者权益总计		21,586,001,543.22	16,965,173,924.18

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 基金份额净值 1.1018 元，基金份额总额 19,067,766,116.73 份；嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 基金份额净值 1.1588 元，基金份额总额 456,507,418.08 份。基金份额总额合计为 19,524,273,534.81 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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		4,118,055,184.23	-1,951,954,283.21
1. 利息收入		6,953,011.62	6,519,427.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,514,056.98	2,735,446.36
债券利息收入		3,204,594.84	3,658,265.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		234,359.80	125,715.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		985,401,843.94	317,155,039.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	103,151,246.14	-28,193,983.29
基金投资收益	6.4.7.13	867,423,878.54	342,901,654.11
债券投资收益	6.4.7.14	-567,895.42	-137,413.15
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	10,083,660.00	-2,140,731.84
股利收益	6.4.7.16	5,310,954.68	4,725,513.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,119,020,768.00	-2,276,783,512.39
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	6,679,560.67	1,154,762.24
减：二、费用		15,387,512.30	7,492,140.99
1. 管理人报酬		3,743,329.28	3,427,897.03
2. 托管费		748,665.86	685,579.40
3. 销售服务费		481,961.87	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,224,852.49	3,060,868.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.19	42,176.21
7. 其他费用	6.4.7.20	188,700.61	275,619.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,102,667,671.93	-1,959,446,424.20

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,102,667,671.93	-1,959,446,424.20

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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 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）	19,343,221,949.69	-2,460,834,023.04	16,882,387,926.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,102,667,671.93	4,102,667,671.93
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）	181,051,585.12	372,376,899.62	553,428,484.74
其中：1. 基金申购款	6,506,655,016.00	604,110,262.81	7,110,765,278.81
2. 基金赎回款	-6,325,603,430.88	-231,733,363.19	-6,557,336,794.07
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）	19,524,273,534.81	2,014,210,548.51	21,538,484,083.32
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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）	14,714,457,646.96	2,245,259,308.44	16,959,716,955.40
二、本期经营活动产生的基金净	-	-1,959,446,424.20	-1,959,446,424.20

值变动数（本期利润）			
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）	598,398,503.73	35,064,571.98	633,463,075.71
其中：1. 基金申购款	2,221,072,531.06	245,431,893.44	2,466,504,424.50
2. 基金赎回款	-1,622,674,027.33	-210,367,321.46	-1,833,041,348.79
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）	-	-339,554,786.10	-339,554,786.10
五、期末所有者权益（基金净值）	15,312,856,150.69	-18,677,329.88	15,294,178,820.81

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：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
嘉实沪深 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

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,743,329.28	3,427,897.03
其中：支付销售机构的客户维护费	5,963,607.04	5,936,239.40

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。

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	748,665.86	685,579.40

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。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	447,701.05	447,701.05
中国银行	—	—	—
合计	—	447,701.05	447,701.05

注：（1）本基金 C 类份额销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	本期 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
期初持有的基金份额	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	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.05%	—
项目	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
期初持有的基金份额	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	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.06%	-

注:本报告期内(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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。

6.4.4.4.2 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

本期末(2019年6月30日)及上年度末(2018年12月31日),其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国银行股份有限公司_活期	755,633,195.67	2,756,511.36	613,220,294.60	2,554,754.37

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末(2019年6月30日),本基金持有5,277,207,119.00份目标ETF基金份额(2018年12月31日:4,723,837,402.00份),占其总份额的比例为77.57%(2018年12月31日:84.30%)。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.12.1.1 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通 受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通 受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.5.2 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 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600485	*ST 信威	2016 年 12 月 26 日	重大 事项 停牌	6.28	2019 年 7 月 12 日	13.86	200,616	2,538,103.50	1,259,868.48	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2019 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2019 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	66,494,430.50	0.31
	其中：股票	66,494,430.50	0.31
2	基金投资	20,333,079,029.51	94.20
3	固定收益投资	279,813,000.00	1.30
	其中：债券	279,813,000.00	1.30
	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	-	-
	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	886,118,726.73	4.11
8	其他各项资产	20,496,356.48	0.09
9	合计	21,586,001,543.22	100.00

7.2 报告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	946,652.14	0.00
B	采矿业	2,438,250.33	0.01
C	制造业	27,129,902.74	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,466,779.00	0.01
E	建筑业	1,960,688.26	0.01
F	批发和零售业	882,079.52	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,979,797.70	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,365,482.68	0.01
J	金融业	22,709,964.62	0.11
K	房地产业	2,940,511.17	0.01
L	租赁和商务服务业	905,885.80	0.00
M	科学研究和技术服务业	52,008.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	76,638.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	320,114.80	0.00
R	文化、体育和娱乐业	319,675.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	66,494,430.50	0.31

7.3 期末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	56,513	5,007,616.93	0.02
2	600519	贵州茅台	2,634	2,591,856.00	0.01
3	600036	招商银行	53,841	1,937,199.18	0.01
4	601166	兴业银行	75,900	1,388,211.00	0.01
5	000651	格力电器	25,086	1,379,730.00	0.01
6	600485	*ST 信威	200,616	1,259,868.48	0.01
7	000333	美的集团	24,130	1,251,381.80	0.01
8	000858	五粮液	10,107	1,192,120.65	0.01
9	600887	伊利股份	31,848	1,064,041.68	0.00
10	600276	恒瑞医药	16,100	1,062,600.00	0.00

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>) 的半年度报告正文。

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	575,411,178.64	3.41
2	600036	招商银行	236,309,145.86	1.40
3	600519	贵州茅台	230,082,992.69	1.36
4	000651	格力电器	163,759,684.60	0.97
5	601166	兴业银行	160,241,837.51	0.95
6	000858	五粮液	134,341,960.40	0.80
7	600887	伊利股份	120,878,320.36	0.72
8	600276	恒瑞医药	118,793,963.30	0.70
9	600030	中信证券	117,399,813.27	0.70
10	000333	美的集团	115,460,259.20	0.68
11	601328	交通银行	113,837,166.79	0.67
12	600016	民生银行	104,570,653.58	0.62
13	601288	农业银行	94,989,890.36	0.56
14	000002	万科A	93,439,895.40	0.55
15	600000	浦发银行	90,641,148.08	0.54
16	601668	中国建筑	84,473,435.29	0.50
17	601398	工商银行	82,289,612.65	0.49
18	002415	海康威视	77,330,179.63	0.46
19	000001	平安银行	75,279,167.76	0.45
20	600900	长江电力	73,831,208.52	0.44

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	131,941,798.87	0.78
2	600519	贵州茅台	77,544,010.56	0.46
3	600036	招商银行	55,684,452.83	0.33
4	601166	兴业银行	38,643,103.78	0.23
5	000651	格力电器	36,657,317.31	0.22
6	000333	美的集团	34,609,488.44	0.21
7	601328	交通银行	30,459,614.27	0.18
8	600887	伊利股份	29,215,693.31	0.17
9	600016	民生银行	27,387,776.87	0.16
10	600030	中信证券	26,580,260.24	0.16
11	600276	恒瑞医药	26,374,177.06	0.16
12	000858	五粮液	26,169,824.72	0.16
13	601288	农业银行	25,198,895.37	0.15

14	000002	万 科 A	23,595,384.92	0.14
15	600000	浦发银行	23,164,617.14	0.14
16	601668	中国建筑	22,771,284.60	0.13
17	601398	工商银行	21,475,484.42	0.13
18	002415	海康威视	21,281,445.79	0.13
19	600900	长江电力	19,331,195.35	0.11
20	000001	平安银行	18,894,972.69	0.11

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	7,928,495,286.14
卖出股票收入（成交）总额	2,000,597,810.22

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	279,813,000.00	1.30
	其中：政策性金融债	279,813,000.00	1.30
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	279,813,000.00	1.30

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	190402	19 农发 02	1,200,000	119,796,000.00	0.56
2	180209	18 国开 09	1,000,000	100,030,000.00	0.46
3	180216	18 国开 16	300,000	30,009,000.00	0.14
4	190302	19 进出 02	200,000	19,982,000.00	0.09
5	190201	19 国开 01	100,000	9,996,000.00	0.05

7.7 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。

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	20,333,079,029.51	94.40

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
IF1909	IF1909	36	40,951,440.00	1,335,000.00	-
公允价值变动总额合计(元)					1,335,000.00
股指期货投资本期收益(元)					10,083,660.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					6,996,480.00

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 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 7 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布深圳保监局二〇一八年行政处罚信息主动公开事项(十三)深保监罚〔2018〕23 号，2018 年 7 月 5 日因招商银行股份有限公司违反《中华人民共和国保险法》第一百三十一条第(一)项规定，根据该法第一百六十五条予以处罚，罚款 30 万元。

本基金投资于“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，招商银行为标的指数的成份股，本基金投资于“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，其他九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。

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	9,489,700.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,060,054.96
5	应收申购款	5,946,601.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,496,356.48

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	600485	*ST 信威	1,259,868.48	0.01	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

份额级别	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（%）

嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	563,367	33,846.08	9,133,988,207.57	47.90	9,933,777,909.16	52.10
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C	3,773	120,993.22	421,687,197.63	92.37	34,820,220.45	7.63
合计	566,804	34,446.25	9,555,675,405.20	48.94	9,968,598,129.61	51.06

注：(1) 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 份额占嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 总份额比例、个人投资者持有嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 份额占嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 总份额比例；

(2) 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 份额占嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 总份额比例、个人投资者持有嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 份额占嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C 总份额比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A

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	7.46
2	邵阳市精英职业技术学校	18,870,363.00	3.29
3	温国伟	5,429,323.00	0.95
4	文竹	5,105,369.00	0.89
5	赵玉玲	3,720,000.00	0.65
6	崔钱德	2,840,000.00	0.50
7	王云华	2,568,055.00	0.45
8	李雪梅	2,495,422.00	0.44
9	侯晓颖	2,399,232.00	0.42
10	戚威	2,209,062.00	0.39

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	份额级别	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	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	1,212,942.96	0.01
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C	8,712.89	0.00

金			
	合计	1, 221, 655. 85	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	份额级别	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	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	0~10
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	0
	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C
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	19, 337, 596, 849. 03	5, 625, 100. 66
本报告期基金总申购份额	6, 008, 808, 556. 67	497, 846, 459. 33
减：本报告期基金总赎回份额	6, 278, 639, 288. 97	46, 964, 141. 91
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	19, 067, 766, 116. 73	456, 507, 418. 08

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

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。

2019 年 6 月 6 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》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、托管人的托管业务部门及其相关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	3,024,783,998.88	30.47%	2,117,374.85	31.21%	-
方正证券股份有限公司	5	2,163,308,582.67	21.79%	1,514,406.55	22.32%	-

公司						
中国国际 金融股份 有限公司	3	1,838,923,027.82	18.52%	1,171,169.44	17.26%	-
中信证券 股份有限 公司	6	784,586,769.66	7.90%	503,801.03	7.43%	新增 1 个
安信证券 股份有限 公司	3	560,889,045.11	5.65%	392,622.58	5.79%	-
民生证券 股份有限 公司	2	278,185,381.27	2.80%	194,729.77	2.87%	-
国元证券 股份有限 公司	1	253,179,684.37	2.55%	177,225.86	2.61%	-
中泰证券 股份有限 公司	4	238,239,184.82	2.40%	166,767.63	2.46%	-
东吴证券 股份有限 公司	3	206,132,986.59	2.08%	144,292.99	2.13%	-
渤海证券 股份有限 公司	1	175,092,790.64	1.76%	122,565.03	1.81%	-
瑞银证券 有限责任 公司	1	138,548,355.23	1.40%	96,983.84	1.43%	-
华创证券 有限责任	2	107,994,680.74	1.09%	75,596.30	1.11%	-

公司						
国信证券 股份有限 公司	1	102,389,503.87	1.03%	71,672.70	1.06%	-
西部证券 股份有限 公司	2	54,601,100.13	0.55%	34,469.26	0.51%	新增
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	新增

天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
东方证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-

中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 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	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

中信建投 证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
天源证券 经纪有限 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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。

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
安信证券股份有限公司	10,045,463.50	61.19%	655,000,000.00	32.35%	—	—	—	—
东吴证券股份有限公司	1,049,487.30	6.39%	100,000,000.00	4.94%	—	—	—	—
方正证券股份有限公司	910,726.70	5.55%	180,000,000.00	8.89%	—	—	—	—
国元证券股份有限公司	98,219.10	0.60%	390,000,000.00	19.26%	—	—	—	—
瑞银证券有限责任公司	477,065.20	2.91%	—	—	—	—	—	—
招商证券股份有限公司	2,362,877.44	14.39%	—	—	—	—	5,622,482,433.12	100.00%
中国国际金融股份有限公司	1,473,685.50	8.98%	—	—	—	—	—	—
中泰证券股份有限公司	—	—	700,000,000.00	34.57%	—	—	—	—

§ 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	2019/01/01 至 2019/01/22, 2019/02/26 至 2019/05/06	4,234,792,218.78	—	754,559,669.00	3,480,232,549.78	17.83
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。							

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 08 月 29 日