

# 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

2019 年 06 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：2019 年 08 月 29 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 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。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51

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 .....	51
7.10 期末投资目标基金明细 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.13 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 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
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	经雷	刘连舸

## 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>

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(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	321.23%	15.88%

值增长率		
------	--	--

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:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×(沪深 300 指数(t)/沪深 300 指数(t-1) -1)+5%×同业存款日收益率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中 t=1, 2, 3, …。

### 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

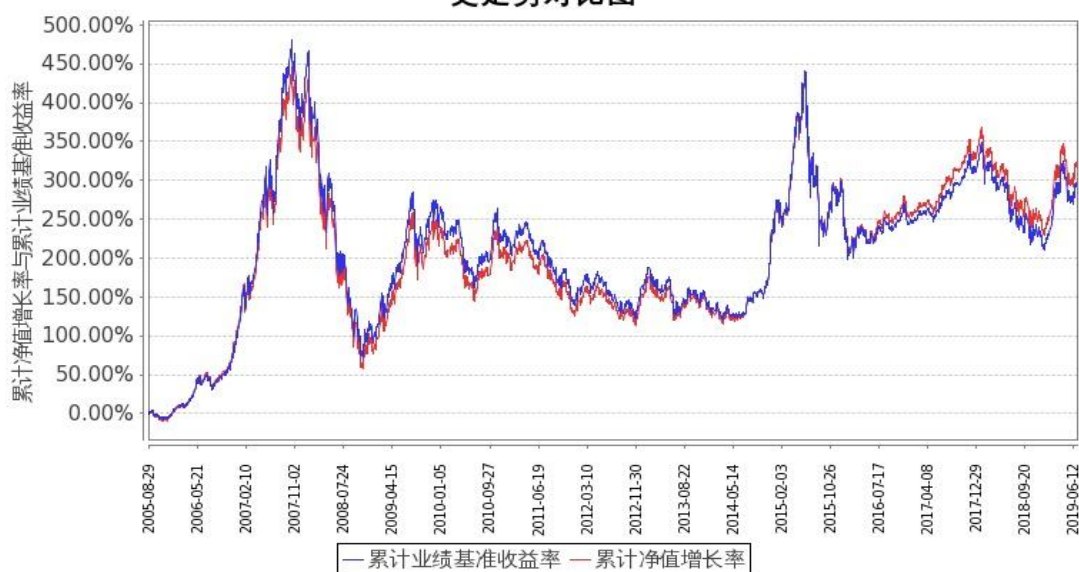


图 1: 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(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**

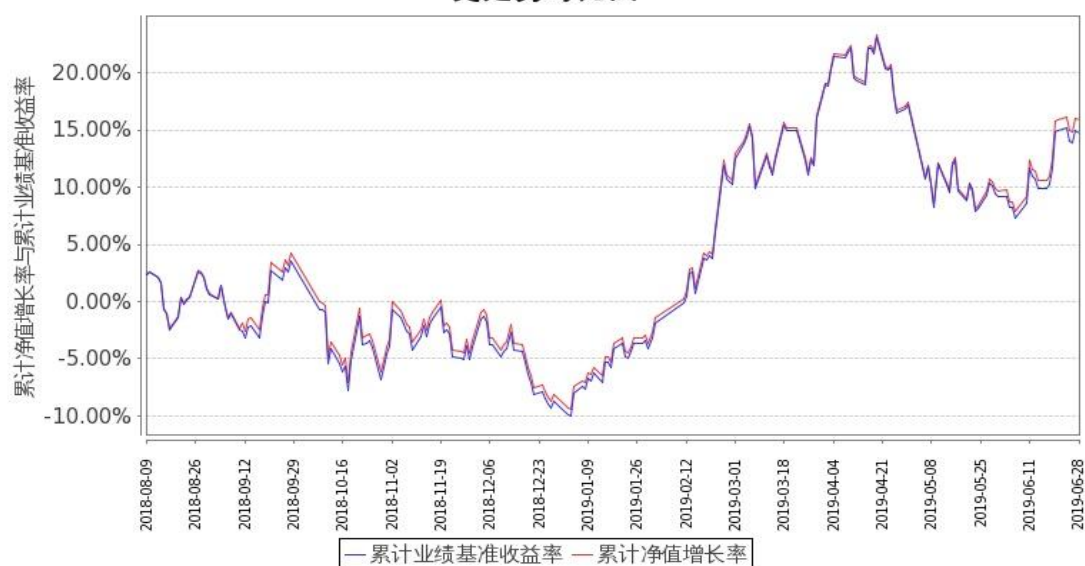


图 2：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(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、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、嘉实互通精选股票、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。

					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合规守信、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：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
<b>资产：</b>			
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
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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
<b>所有者权益：</b>			
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
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值变动数(本期利润)	-	-1,959,446,424.20	-1,959,446,424.20
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

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。

根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》，自 2018 年 8 月 8 日起，对本基金增加 C 类基金份额类别，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。C 类基金份额仅开通场外份额，不开通场内份额。本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

#### 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 [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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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	
	2019年6月30日	
活期存款	755,633,195.67	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月及以上	-	
其他存款	-	
合计	755,633,195.67	

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			
	2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	67,252,926.24	66,494,430.50	-758,495.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	279,895,430.00	279,813,000.00	-82,430.00
	合计	279,895,430.00	279,813,000.00	-82,430.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	17,449,908,595.88	20,333,079,029.51	2,883,170,433.63	
其他	-	-	-	
合计	17,797,056,952.12	20,679,386,460.01	2,882,329,507.89	

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	39,616,440.00	-	-	-
其中：股指期货投资	39,616,440.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,616,440.00	-	-	-

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）：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IF1909	IF1909	36	40,951,440.00	1,335,000.00
总额合计	-	-	-	1,335,000.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,335,000.00
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

本期末（2019年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2019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 2019年6月30日
应收活期存款利息	145,977.62
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	50,129.25
应收债券利息	4,847,713.46
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9,196.35
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7,038.28
合计	5,060,054.96

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2019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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,608,332.39

银行间市场应付交易费用	975.00
合计	4,609,307.39

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	42,523.52
预提费用	162,996.40
合计	705,519.92

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,337,596,849.03	19,337,596,849.03
本期申购	6,008,808,556.67	6,008,808,556.67
本期赎回(以“-”号填列)	-6,278,639,288.97	-6,278,639,288.97
本期末	19,067,766,116.73	19,067,766,116.73

##### 嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,625,100.66	5,625,100.66
本期申购	497,846,459.33	497,846,459.33
本期赎回(以“-”号填列)	-46,964,141.91	-46,964,141.91
本期末	456,507,418.08	456,507,418.08

注：报告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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,132,753,842.13	-4,593,131,550.04	-2,460,377,707.91
本期利润	975,085,510.62	3,149,565,751.03	4,124,651,261.65
本期基金份额交易产生的变动数	93,137,337.48	184,292,161.47	277,429,498.95
其中：基金申购款	916,463,422.69	-413,118,607.80	503,344,814.89
基金赎回款	-823,326,085.21	597,410,769.27	-225,915,315.94
本期已分配利润	-	-	-



本期末	3,200,976,690.23	-1,259,273,637.54	1,941,703,052.69
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,835.23	-491,150.36	-456,315.13
本期利润	8,561,393.31	-30,544,983.03	-21,983,589.72
本期基金份额交易产生的变动数	21,387,993.78	73,559,406.89	94,947,400.67
其中：基金申购款	23,585,288.65	77,180,159.27	100,765,447.92
基金赎回款	-2,197,294.87	-3,620,752.38	-5,818,047.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,984,222.32	42,523,273.50	72,507,495.82

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	2,756,511.36
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	503,344.58
其他	254,201.04
合计	3,514,056.98

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	59,577,191.37
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	43,574,054.77
合计	103,151,246.14

##### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	2,000,597,810.22
减：卖出股票成本总额	1,941,020,618.85

买卖股票差价收入	59,577,191.37
----------	---------------

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
申购基金份额总额	6,960,186,720.00
减：现金支付申购款总额	96,770,995.71
减：申购股票成本总额	6,819,841,669.52
申购差价收入	43,574,054.77

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	6,408,749,289.12
减：卖出/赎回基金成本总额	5,541,325,410.58
减：基金投资收益应缴纳增值税额	-
基金投资收益	867,423,878.54

#### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	121,848,061.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	116,939,063.50
减：应收利息总额	5,476,893.16
买卖债券差价收入	-567,895.42

#### 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（2019年1月1日至2019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 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	10,083,660.00

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,310,954.68

基金投资产生的股利收益	-
合计	5,310,954.68

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	3,112,024,288.00
股票投资	-1,115,658.15
债券投资	586,940.00
资产支持证券投资	-
基金投资	3,112,553,006.15
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	6,996,480.00
权证投资	-
期货	6,996,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,119,020,768.00

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	6,557,945.88
基金转出费收入	121,614.79
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	6,679,560.67

## 6.4.7.19 交易费用

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	9,678,165.99
银行间市场交易费用	1,200.00
交易基金产生的费用	545,486.50
其中：申购费	238,576.98
赎回费	33,092.19
交易费	273,817.33
合计	10,224,852.49

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	58,859.86
银行划款手续费	16,704.21
上市年费	29,752.78
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	188,700.61

#### 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
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

#### 6.4.10 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（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。

##### 6.4.10.2 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	月 30 日	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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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。

#### 6.4.10.2.3 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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日	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	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	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。

#### 6.4.10.4.2 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 (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。

#### 6.4.10.5 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 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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末 (2019 年 06 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

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 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

##### 6.4.12.2 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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	日期	原因	估值单 价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值总额	
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	-

#### 6.4.12.3 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（2019 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（2019 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 workflows、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。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	87,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	87,000.00

注：1. 本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金未持有按长期信用评级的债券投资。2. 长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 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。

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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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 2019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	755,633,195.67	-	-	-	755,633,195.67
结算备付金	130,485,531.06	-	-	-	130,485,531.06
存出保证金	5,394,556.00	-	-	4,095,144.00	9,489,700.00
交易性金融资产	279,813,000.00	-	-	20,399,573,460.01	20,679,386,460.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	5,060,054.96	5,060,054.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,133,203.48	-	-	4,813,398.04	5,946,601.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,172,459,486.21	-	-	20,413,542,057.01	21,586,001,543.22
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	-	-	-	20,297,566.43	20,297,566.43
应付赎回款	-	-	-	20,884,626.34	20,884,626.34
应付管理人报酬	-	-	-	710,037.06	710,037.06
应付托管费	-	-	-	142,007.44	142,007.44
应付销售服务费	-	-	-	168,395.32	168,395.32
应付交易费用	-	-	-	4,609,307.39	4,609,307.39
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	705,519.92	705,519.92
负债总计	-	-	-	47,517,459.90	47,517,459.90
利率敏感度缺口	1,172,459,486.21	-	-	-20,366,024,597.11	21,538,484,083.32
上年度末					
2018 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	677,241,053.05	-	-	-	677,241,053.05
结算备付金	28,870,504.37	-	-	-	28,870,504.37
存出保证金	3,450,719.85	-	-	9,010,800.00	12,461,519.85
交易性金融资产	200,536,000.00	-	87,000.00	15,914,325,250.57	16,114,948,250.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,310,058.45	6,310,058.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	121,152,230.03	-	-	4,190,307.86	125,342,537.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,031,250,507.30	-	87,000.00	15,933,836,416.88	16,965,173,924.18
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	-	-	-	76,396,149.88	76,396,149.88
应付赎回款	-	-	-	3,210,997.68	3,210,997.68
应付管理人报酬	-	-	-	599,576.39	599,576.39
应付托管费	-	-	-	119,915.26	119,915.26
应付销售服务费	-	-	-	1,503.73	1,503.73
应付交易费用	-	-	-	1,502,847.18	1,502,847.18
应付税费	-	-	-	1.21	1.21
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	955,006.20	955,006.20
负债总计	-	-	-	82,785,997.53	82,785,997.53
利率敏感度缺口	1,031,250,507.30	-	87,000.00	15,851,050,419.35	16,882,387,926.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2019 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 1.30%(2018 年 12 月 31 日: 1.19%)。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	66,494,430.50	0.31	113,089,140.88	0.67

交易性金融资产 — 基金投资	20,333,079,029.51	94.40	15,801,236,109.69	93.60
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	20,399,573,460.01	94.71	15,914,325,250.57	94.27

#### 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		
	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 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	1,073,549,796.41	840,445,625.27
	业绩比较基准下降 5%	-1,073,549,796.41	-840,445,625.27

#### 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 20,398,256,614.99 元, 属于第二层次的余额为 279,869,976.54 元, 属于第三层次的余额为 1,259,868.48 元(上年度末: 第一层次 15,911,348,117.33 元, 第二层次 203,600,133.24 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

上述第三层次资产变动如下：

金额单位：人民币元

	交易性金融资产——股票投资
2019年1月1日	-
转入	1,259,868.48
当期损失总额	-
——计入损益的损失	-
2019年6月30日	1,259,868.48
2019年6月30日仍持有的资产计入2019年半年度损益的未实现损失的变动	-
——公允价值变动收益	-

计入损益的损失计入利润表中的公允价值变动收益项目。

(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) 除公允价值外，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	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（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
11	600030	中信证券	41,101	978,614.81	0.00
12	601328	交通银行	143,500	878,220.00	0.00
13	600016	民生银行	129,600	822,960.00	0.00
14	601288	农业银行	200,100	720,360.00	0.00
15	600000	浦发银行	61,300	715,984.00	0.00
16	000002	万 科 A	25,395	706,234.95	0.00
17	300498	温氏股份	19,349	693,855.14	0.00
18	601398	工商银行	112,600	663,214.00	0.00
19	601668	中国建筑	109,600	630,200.00	0.00
20	000001	平安银行	44,900	618,722.00	0.00
21	600900	长江电力	34,400	615,760.00	0.00
22	600837	海通证券	42,200	598,818.00	0.00
23	601601	中国太保	16,325	596,025.75	0.00
24	002415	海康威视	19,500	537,810.00	0.00
25	600048	保利地产	37,196	474,620.96	0.00
26	600104	上汽集团	18,264	465,732.00	0.00
27	601169	北京银行	77,300	456,843.00	0.00
28	601888	中国国旅	5,052	447,859.80	0.00
29	603288	海天味业	4,194	440,370.00	0.00
30	601211	国泰君安	23,521	431,610.35	0.00
31	600585	海螺水泥	10,400	431,600.00	0.00
32	000725	京东方 A	123,800	425,872.00	0.00
33	601688	华泰证券	19,016	424,437.12	0.00
34	600009	上海机场	5,006	419,402.68	0.00
35	601988	中国银行	110,100	411,774.00	0.00
36	601766	中国中车	50,800	410,972.00	0.00
37	000063	中兴通讯	12,400	403,372.00	0.00
38	600031	三一重工	30,553	399,633.24	0.00
39	002304	洋河股份	3,200	388,992.00	0.00
40	600028	中国石化	69,800	381,806.00	0.00
41	300059	东方财富	28,020	379,671.00	0.00

42	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.00
43	601088	中国神华	17,166	349,843.08	0.00
44	600309	万华化学	8,167	349,465.93	0.00
45	601229	上海银行	28,500	337,725.00	0.00
46	600690	青岛海尔	19,026	328,959.54	0.00
47	002142	宁波银行	13,523	327,797.52	0.00
48	601818	光大银行	83,300	317,373.00	0.00
49	002475	立讯精密	12,800	317,312.00	0.00
50	000568	泸州老窖	3,809	307,881.47	0.00
51	000338	潍柴动力	25,000	307,250.00	0.00
52	601012	隆基股份	13,230	305,745.30	0.00
53	600340	华夏幸福	9,318	303,487.26	0.00
54	600019	宝钢股份	46,500	302,250.00	0.00
55	600050	中国联通	48,700	299,992.00	0.00
56	601857	中国石油	42,400	291,712.00	0.00
57	002027	分众传媒	53,600	283,544.00	0.00
58	601989	中国重工	47,800	265,768.00	0.00
59	600919	江苏银行	36,100	262,086.00	0.00
60	601939	建设银行	35,000	260,400.00	0.00
61	001979	招商蛇口	12,300	257,070.00	0.00
62	601009	南京银行	31,000	256,060.00	0.00
63	600999	招商证券	14,909	254,794.81	0.00
64	601390	中国中铁	38,900	253,628.00	0.00
65	002714	牧原股份	4,300	252,797.00	0.00
66	002230	科大讯飞	7,602	252,690.48	0.00
67	601006	大秦铁路	31,100	251,599.00	0.00
68	600015	华夏银行	32,100	247,170.00	0.00
69	601628	中国人寿	8,700	246,384.00	0.00
70	002594	比亚迪	4,710	238,891.20	0.00
71	601186	中国铁建	24,000	238,800.00	0.00
72	601899	紫金矿业	63,200	238,264.00	0.00
73	601336	新华保险	4,327	238,114.81	0.00
74	000661	长春高新	700	236,600.00	0.00
75	000166	申万宏源	47,000	235,470.00	0.00
76	000538	云南白药	2,800	233,576.00	0.00
77	002024	苏宁易购	19,400	222,712.00	0.00
78	600570	恒生电子	3,264	222,441.60	0.00
79	600352	浙江龙盛	13,500	212,895.00	0.00
80	000776	广发证券	15,400	211,596.00	0.00
81	601669	中国电建	39,894	211,039.26	0.00
82	601933	永辉超市	20,000	204,200.00	0.00
83	600958	东方证券	18,700	199,716.00	0.00

84	300015	爱尔眼科	6,440	199,446.80	0.00
85	601225	陕西煤业	20,800	192,192.00	0.00
86	000876	新希望	11,000	191,070.00	0.00
87	600436	片仔癀	1,640	188,928.00	0.00
88	000100	TCL 集团	56,600	188,478.00	0.00
89	601155	新城控股	4,700	187,107.00	0.00
90	300142	沃森生物	6,400	181,504.00	0.00
91	600406	国电南瑞	9,650	179,876.00	0.00
92	002202	金风科技	14,412	179,141.16	0.00
93	600741	华域汽车	8,230	177,768.00	0.00
94	600588	用友网络	6,418	172,515.84	0.00
95	002736	国信证券	12,830	168,842.80	0.00
96	600660	福耀玻璃	7,300	165,929.00	0.00
97	601377	兴业证券	24,400	164,456.00	0.00
98	000157	中联重科	26,800	161,068.00	0.00
99	600010	包钢股份	95,200	160,888.00	0.00
100	000783	长江证券	20,200	157,762.00	0.00
101	600795	国电电力	61,700	156,718.00	0.00
102	600547	山东黄金	3,800	156,446.00	0.00
103	601901	方正证券	21,500	152,865.00	0.00
104	600705	中航资本	28,100	152,302.00	0.00
105	002008	大族激光	4,400	151,272.00	0.00
106	601111	中国国航	15,600	149,292.00	0.00
107	000069	华侨城 A	21,400	148,730.00	0.00
108	603993	洛阳钼业	37,000	146,520.00	0.00
109	600111	北方稀土	11,300	145,092.00	0.00
110	601108	财通证券	13,100	143,838.00	0.00
111	600703	三安光电	12,718	143,459.04	0.00
112	600011	华能国际	23,000	143,290.00	0.00
113	600438	通威股份	10,105	142,076.30	0.00
114	600089	特变电工	19,400	140,650.00	0.00
115	600383	金地集团	11,700	139,581.00	0.00
116	600029	南方航空	17,900	138,188.00	0.00
117	601800	中国交建	12,200	138,104.00	0.00
118	600886	国投电力	17,700	137,529.00	0.00
119	601985	中国核电	24,300	135,108.00	0.00
120	002236	大华股份	9,300	135,036.00	0.00
121	600271	航天信息	5,810	133,920.50	0.00
122	002422	科伦药业	4,500	133,785.00	0.00
123	601600	中国铝业	34,100	133,672.00	0.00
124	002007	华兰生物	4,350	132,631.50	0.00
125	600516	方大炭素	10,731	131,883.99	0.00

126	600196	复星医药	5,200	131,560.00	0.00
127	600606	绿地控股	19,000	129,770.00	0.00
128	002001	新和成	6,700	129,243.00	0.00
129	002311	海大集团	4,180	129,162.00	0.00
130	601555	东吴证券	12,500	128,125.00	0.00
131	600115	东方航空	20,400	127,908.00	0.00
132	300003	乐普医疗	5,521	127,093.42	0.00
133	000895	双汇发展	5,100	126,939.00	0.00
134	600061	国投资本	8,800	123,288.00	0.00
135	600109	国金证券	12,600	122,472.00	0.00
136	600221	海航控股	60,100	122,003.00	0.00
137	002044	美年健康	9,700	120,668.00	0.00
138	300124	汇川技术	5,200	119,132.00	0.00
139	600332	白云山	2,901	118,853.97	0.00
140	000963	华东医药	4,562	118,429.52	0.00
141	000413	东旭光电	22,900	117,706.00	0.00
142	600522	中天科技	12,740	116,825.80	0.00
143	600177	雅戈尔	18,300	116,205.00	0.00
144	600018	上港集团	17,012	116,021.84	0.00
145	601788	光大证券	10,130	115,684.60	0.00
146	600487	亨通光电	6,900	115,644.00	0.00
147	002410	广联达	3,500	115,115.00	0.00
148	000768	中航飞机	7,200	113,400.00	0.00
149	601618	中国中冶	37,300	113,392.00	0.00
150	600637	东方明珠	10,700	112,778.00	0.00
151	603019	中科曙光	3,200	112,320.00	0.00
152	300122	智飞生物	2,600	112,060.00	0.00
153	600100	同方股份	12,300	111,315.00	0.00
154	000425	徐工机械	24,600	109,716.00	0.00
155	601607	上海医药	6,000	108,900.00	0.00
156	300017	网宿科技	10,100	108,878.00	0.00
157	002352	顺丰控股	3,200	108,672.00	0.00
158	300033	同花顺	1,100	108,196.00	0.00
159	600893	航发动力	4,700	106,737.00	0.00
160	300408	三环集团	5,405	105,127.25	0.00
161	002271	东方雨虹	4,600	104,236.00	0.00
162	600176	中国巨石	10,900	103,877.00	0.00
163	601877	正泰电器	4,400	101,596.00	0.00
164	601919	中远海控	20,200	101,404.00	0.00
165	600498	烽火通信	3,600	100,296.00	0.00
166	601727	上海电气	18,400	98,992.00	0.00
167	600004	白云机场	5,400	98,280.00	0.00

168	600867	通化东宝	6,374	98,159.60	0.00
169	300136	信维通信	4,000	97,800.00	0.00
170	000728	国元证券	10,500	96,285.00	0.00
171	000423	东阿阿胶	2,400	95,568.00	0.00
172	601998	中信银行	16,000	95,520.00	0.00
173	600023	浙能电力	21,300	94,146.00	0.00
174	002460	赣锋锂业	4,000	93,720.00	0.00
175	600489	中金黄金	9,000	92,430.00	0.00
176	002673	西部证券	9,100	91,728.00	0.00
177	002179	中航光电	2,736	91,546.56	0.00
178	601018	宁波港	20,600	90,434.00	0.00
179	002466	天齐锂业	3,560	89,996.80	0.00
180	600066	宇通客车	6,900	89,838.00	0.00
181	002241	歌尔股份	10,100	89,789.00	0.00
182	600809	山西汾酒	1,300	89,765.00	0.00
183	600068	葛洲坝	14,400	89,712.00	0.00
184	600926	杭州银行	10,700	89,131.00	0.00
185	600170	上海建工	23,200	87,232.00	0.00
186	601997	贵阳银行	10,040	86,846.00	0.00
187	300024	机器人	5,700	86,811.00	0.00
188	300144	宋城演艺	3,700	85,618.00	0.00
189	002081	金螳螂	8,300	85,573.00	0.00
190	601198	东兴证券	7,200	85,536.00	0.00
191	600362	江西铜业	5,400	84,996.00	0.00
192	600219	南山铝业	37,500	84,750.00	0.00
193	002146	荣盛发展	9,000	84,510.00	0.00
194	600398	海澜之家	9,300	84,351.00	0.00
195	002602	世纪华通	7,720	84,302.40	0.00
196	601021	春秋航空	1,873	84,285.00	0.00
197	000961	中南建设	9,600	83,136.00	0.00
198	601838	成都银行	9,400	83,002.00	0.00
199	600482	中国动力	3,500	82,670.00	0.00
200	601881	中国银河	6,700	82,075.00	0.00
201	600674	川投能源	9,200	81,880.00	0.00
202	603156	养元饮品	2,190	81,205.20	0.00
203	600085	同仁堂	2,800	81,200.00	0.00
204	000630	铜陵有色	32,900	80,934.00	0.00
205	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
206	000703	恒逸石化	5,900	80,594.00	0.00
207	000786	北新建材	4,400	79,772.00	0.00
208	002739	万达电影	4,300	79,292.00	0.00
209	002493	荣盛石化	6,500	78,390.00	0.00

210	600535	天士力	4,730	78,281.50	0.00
211	002456	欧菲光	9,900	77,616.00	0.00
212	300070	碧水源	9,838	76,638.02	0.00
213	600297	广汇汽车	17,100	76,266.00	0.00
214	000629	攀钢钒钛	22,400	75,936.00	0.00
215	002050	三花智控	7,170	75,643.50	0.00
216	601138	工业富联	6,200	74,710.00	0.00
217	002555	三七互娱	5,500	74,525.00	0.00
218	300296	利亚德	9,300	72,819.00	0.00
219	600369	西南证券	14,700	72,618.00	0.00
220	600346	恒力石化	5,960	72,473.60	0.00
221	002624	完美世界	2,800	72,268.00	0.00
222	000596	古井贡酒	600	71,106.00	0.00
223	603799	华友钴业	3,310	70,536.10	0.00
224	600208	新湖中宝	22,400	70,336.00	0.00
225	600663	陆家嘴	4,500	69,750.00	0.00
226	603160	汇顶科技	500	69,400.00	0.00
227	603986	兆易创新	800	69,360.00	0.00
228	002508	老板电器	2,544	69,044.16	0.00
229	002065	东华软件	9,700	67,803.00	0.00
230	603833	欧派家居	630	67,800.60	0.00
231	600118	中国卫星	3,000	67,650.00	0.00
232	000625	长安汽车	10,100	66,963.00	0.00
233	000656	金科股份	11,100	66,933.00	0.00
234	000627	天茂集团	10,300	66,847.00	0.00
235	000709	河钢股份	22,100	66,079.00	0.00
236	600153	建发股份	7,400	65,712.00	0.00
237	601992	金隅集团	17,400	65,424.00	0.00
238	600583	海油工程	11,500	64,400.00	0.00
239	601878	浙商证券	6,900	64,170.00	0.00
240	600027	华电国际	17,000	64,090.00	0.00
241	601117	中国化学	10,400	62,608.00	0.00
242	600038	中直股份	1,500	61,530.00	0.00
243	600760	中航沈飞	2,100	60,963.00	0.00
244	002032	苏泊尔	800	60,664.00	0.00
245	600977	中国电影	3,832	60,009.12	0.00
246	600415	小商品城	14,300	58,916.00	0.00
247	600688	上海石化	11,400	58,824.00	0.00
248	002153	石基信息	1,600	57,904.00	0.00
249	601216	君正集团	17,600	57,904.00	0.00
250	600816	安信信托	11,400	57,570.00	0.00
251	603858	步长制药	2,230	57,467.10	0.00

252	002558	巨人网络	3,100	56,327.00	0.00
253	000671	阳光城	8,400	54,432.00	0.00
254	002252	上海莱士	7,700	53,515.00	0.00
255	601238	广汽集团	4,800	52,464.00	0.00
256	601319	中国人保	5,500	52,195.00	0.00
257	603259	药明康德	600	52,008.00	0.00
258	601633	长城汽车	6,200	51,274.00	0.00
259	002010	传化智联	6,800	51,204.00	0.00
260	600566	济川药业	1,685	50,735.35	0.00
261	002310	东方园林	8,400	50,400.00	0.00
262	600188	兖州煤业	4,600	50,002.00	0.00
263	600704	物产中大	9,000	48,780.00	0.00
264	000402	金融街	6,200	48,608.00	0.00
265	601066	中信建投	2,300	48,484.00	0.00
266	300072	三聚环保	6,100	48,373.00	0.00
267	000898	鞍钢股份	12,620	47,829.80	0.00
268	002294	信立泰	2,100	46,998.00	0.00
269	002601	龙蟠佰利	3,151	46,729.33	0.00
270	002120	韵达股份	1,499	46,199.18	0.00
271	601898	中煤能源	9,500	45,600.00	0.00
272	601360	三六零	2,100	44,898.00	0.00
273	002773	康弘药业	1,330	43,783.60	0.00
274	002411	延安必康	2,500	43,500.00	0.00
275	600372	中航电子	2,831	42,012.04	0.00
276	300413	芒果超媒	1,000	41,050.00	0.00
277	601228	广州港	9,800	40,964.00	0.00
278	002468	申通快递	1,600	39,904.00	0.00
279	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
280	600025	华能水电	9,400	38,258.00	0.00
281	002938	鹏鼎控股	1,300	38,168.00	0.00
282	000938	紫光股份	1,400	38,150.00	0.00
283	000415	渤海租赁	9,600	37,632.00	0.00
284	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
285	600998	九州通	3,000	37,080.00	0.00
286	600339	中油工程	8,700	36,714.00	0.00
287	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
288	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
289	002925	盈趣科技	800	31,208.00	0.00
290	300251	光线传媒	4,500	30,600.00	0.00
291	601162	天风证券	2,800	30,352.00	0.00
292	601808	中海油服	3,000	28,890.00	0.00
293	300433	蓝思科技	4,100	28,577.00	0.00



294	002939	长城证券	1,700	28,373.00	0.00
295	603260	合盛硅业	600	28,236.00	0.00
296	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
297	601828	美凯龙	2,200	26,730.00	0.00
298	600390	五矿资本	2,800	26,404.00	0.00
299	002945	华林证券	1,400	25,900.00	0.00
300	000553	安道麦 A	2,400	25,728.00	0.00
301	000408	藏格控股	3,100	25,637.00	0.00
302	600233	圆通速递	1,900	23,427.00	0.00
303	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
304	601298	青岛港	2,600	21,814.00	0.00
305	002625	光启技术	2,200	20,438.00	0.00
306	601212	白银有色	4,500	19,755.00	0.00
307	601577	长沙银行	1,900	18,126.00	0.00
308	600733	北汽蓝谷	2,100	17,346.00	0.00
309	600299	安迪苏	1,500	15,555.00	0.00

#### 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	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
	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)		
本报告期末基金份额总额	19,067,766,116.73	456,507,418.08

注:报告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%	-
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 公司	2	107,994,680.74	1.09%	75,596.30	1.11%	-
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	2	-	-	-	-	新增 1

股份有限 公司							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	1	-	-	-	-	-	-

有限责任 公司						
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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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%	-	-	-	-	-	-

司								
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%	-	-	-	-

### 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	嘉实基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月2日
2	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换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	2019年1月4日
3	关于增加唐鼎耀华为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换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	2019年1月18日
4	嘉实基金管理有限公司关于增加腾安基金为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2019年1月25日
5	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019年1月28日
6	关于增加中信证券等为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月19日
7	关于增加广发证券等为嘉实旗下基金代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月25日
8	关于增加上海天天为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019年2月26日
9	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019年3月8日
10	关于增加上海陆金所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、管理人网站	2019年4月3日
11	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优	中国证券报、管理人网站	2019年6月19日

	惠的公告		
12	关于增加通华财富为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 21 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	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。

## § 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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 08 月 29 日