

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 04 月 08 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 2020 年 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 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	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
4.10 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	14
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	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	55

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
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 .....	64
8.7 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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
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 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 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	6,536,016,676.00 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	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
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 27 楼 09-14 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	《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
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、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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	1,879,124,291.73	-6,548,248.53	735,023,006.08
本期利润	6,989,012,004.19	-4,684,725,114.57	3,766,516,136.91
加权平均基金份额 本期利润	1.1369	-1.0366	0.8396
本期加权平均净值 利润率	30.00%	-26.38%	21.10%
本期基金份额净值 增长率	38.10%	-24.03%	23.36%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	11,787,249,921.12	4,083,151,385.90	7,442,246,508.76
期末可供分配基金 份额利润	1.8034	0.7287	1.7867
期末基金资产净值	27,183,389,199.65	18,743,619,783.58	18,339,948,550.23
期末基金份额净值	4.1590	3.3450	4.4030
3.1.3 累计期末指 标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值 增长率	76.56%	27.85%	68.29%

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) 上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	7.25%	0.73%	7.39%	0.74%	-0.14%	-0.01%
过去六个月	7.95%	0.86%	7.08%	0.86%	0.87%	0.00%
过去一年	38.10%	1.24%	36.07%	1.25%	2.03%	-0.01%
过去三年	29.42%	1.12%	23.76%	1.12%	5.66%	0.00%
过去五年	25.46%	1.53%	15.93%	1.54%	9.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	76.56%	1.45%	50.84%	1.46%	25.72%	-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

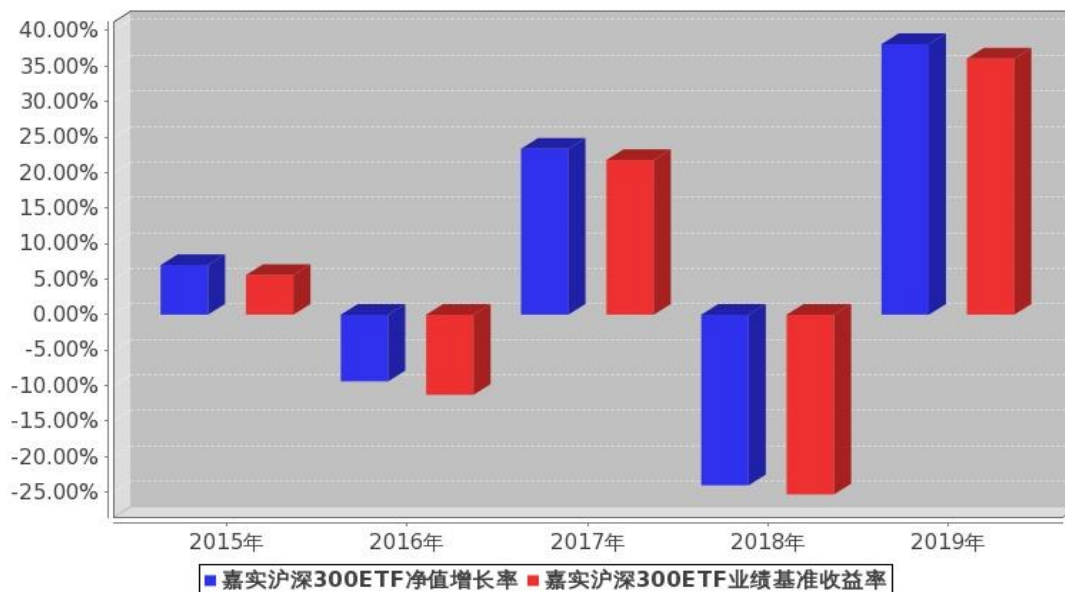
(2012 年 5 月 7 日至 2019 年 12 月 31 日)

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）投资禁止行为与限制 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

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

截止2019年12月31日，基金管理人共管理176只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、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、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴

科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，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		
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)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接基金经理	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，现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深	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。

	300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接基金经理				
--	---	--	--	--	--

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 5 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

2019 年深 300 指数全年呈上涨走势。年初至 4 月中旬，在央行 1 月开始的数次降准、外管局将合格境外机构投资者（QFII）总额度由 1500 亿美元增加至 3000 亿美元、科创板政策陆续出台与落地以及 2 月份社融数据大超市场预期等一系列政策利好下，A 股市场热情被迅速点燃，市场迎来一波迅猛上涨。4 月中旬到 6 月，中美贸易争端再起。5 月 9 日美国政府宣布，自 2019 年 5 月 10 日起，对从中国进口的 2000 亿美元清单商品加征的关税税率由 10%提高到 25%，随后中美进行数次交锋，A 股也迎来一波短暂的回调。6 月到 12 月，G20 峰会后，中美关系逐渐趋于缓和，随着科创板正式落地以及央行“全面+定向”降准的实施，A 股再次震荡上行，报告期内沪深 300 指数上涨 36.07%。

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 4.1590 元；本报告期基金份额净值增长率为 38.10%，业绩比较基准收益率为 36.07%。

### 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 2020 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 合规管理：主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 法律事务：负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成监察稽核报告、合规报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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

力和相关工作经历。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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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。

#### 4.10 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

普华永道中天审字(2020)第23628号

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 一、 审计意见

### (一) 我们审计的内容

我们审计了嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### (二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了嘉实沪深 300ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实沪深 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 三、 管理层和治理层对财务报表的责任

嘉实沪深300ETF基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实沪深300ETF基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实沪深300ETF基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督嘉实沪深300ETF基金的财务报告过程。

#### 四、 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致嘉实沪深 300ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。



普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

薛 竞

中国·上海市

周 祎

2020年3月30日

## § 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	21,703,693.53	11,854,841.01
结算备付金		26,697,797.36	2,949,257.00
存出保证金		16,519,683.62	2,577,992.63
交易性金融资产	7.4.7.2	27,007,495,900.25	18,718,783,312.15
其中：股票投资		27,005,582,800.25	18,715,314,312.15
基金投资		-	-
债券投资		1,913,100.00	3,469,000.00
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	134,000,000.00	19,000,000.00
应收证券清算款		21,616,190.17	4,142,066.83
应收利息	7.4.7.5	61,641.94	437.58
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		27,228,094,906.87	18,759,307,907.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,591,856.16	2,659,078.05
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,418,555.77	8,044,905.93
应付托管费		2,083,711.14	1,608,981.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,490,274.14	1,477,244.50
应交税费		42,243.71	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	2,079,066.30	1,897,900.69
负债合计		44,705,707.22	15,688,123.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	15,396,139,278.53	14,660,468,397.68
未分配利润	7.4.7.10	11,787,249,921.12	4,083,151,385.90
所有者权益合计		27,183,389,199.65	18,743,619,783.58
负债和所有者权益总计		27,228,094,906.87	18,759,307,907.20

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.1590 元，基金份额总额 6,536,016,676.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		7,145,870,435.60	-4,565,864,108.23
1. 利息收入		1,965,440.21	1,230,310.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	443,294.52	299,105.17
债券利息收入		10,461.30	2,603.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,314,092.16	928,602.31
证券出借利息收入		197,592.23	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,029,827,381.29	113,028,286.24

其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,447,146,640.10	-256,727,942.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,419,432.37	1,144,298.99
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	9,501,562.72	-3,870,417.95
股利收益	7.4.7.15	565,759,746.10	372,482,347.30
3. 公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.16	5,109,887,712.46	-4,678,176,866.04
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	4,189,901.64	-1,945,839.40
减：二、费用		156,858,431.41	118,861,006.34
1. 管理人报酬		116,003,316.96	88,852,770.58
2. 托管费		23,200,663.31	17,770,554.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	10,277,700.40	6,364,091.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		32,828.49	991.67
7. 其他费用	7.4.7.19	7,343,922.25	5,872,598.98
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		6,989,012,004.19	-4,684,725,114.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		6,989,012,004.19	-4,684,725,114.57

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	14,660,468,397.68	4,083,151,385.90	18,743,619,783.58
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	6,989,012,004.19	6,989,012,004.19

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)	735,670,880.85	715,086,531.03	1,450,757,411.88
其中: 1. 基金申购款	8,859,367,692.55	5,849,276,177.31	14,708,643,869.86
2. 基金赎回款	-8,123,696,811.70	-5,134,189,646.28	-13,257,886,457.98
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)	15,396,139,278.53	11,787,249,921.12	27,183,389,199.65
项目	上年度可比期间 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、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	3,762,766,356.21	1,325,629,991.71	5,088,396,347.92
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

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>罗丽丽</u>	<u>罗丽丽</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 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(以下简称“本基金”)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]393 号《关于核准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 19,332,261,440.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 128 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 19,333,307,392.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,045,952.00 份基金份额。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2012]第 131 号文审核同意,本基金 19,333,307,392.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在深交所挂牌交易。

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基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。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)。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

根据于 2012 年 8 月 6 日嘉实沪深 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》，并经中国证监会 2012 年 8 月 21 日证监许可[2012]1146 号文核准，嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)自 2012 年 8 月 21 日起变更投资范围及相关事宜而成为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“嘉实沪深 300ETF 联接基金”)。嘉实沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目

前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交

易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认



为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2019 年 12 月 31 日	
	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
活期存款	21,703,693.53	11,854,841.01
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	21,703,693.53	11,854,841.01

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	23,260,432,524.13	27,005,582,800.25	3,745,150,276.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,913,100.00	1,913,100.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,913,100.00	1,913,100.00	-
资产支持证券	-	-	-	

基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		23,262,345,624.13	27,007,495,900.25	3,745,150,276.12
项目	上年度末 2018年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20,069,983,518.09	18,715,314,312.15	-1,354,669,205.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,469,000.00	3,469,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,469,000.00	3,469,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		20,073,452,518.09	18,718,783,312.15	-1,354,669,205.94

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	144,064,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	144,064,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	144,064,680.00	-	-	-

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
IF2003	IF2003	30	37,078,200.00	2,410,500.00
IF2006	IF2006	94	116,082,480.00	6,685,500.00
总额合计	-	-	-	9,096,000.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	9,096,000.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

项目	上年度末 2018年12月31日
----	---------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,598,150.40	-	-	-
其中：股指期货投资	22,598,150.40	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,598,150.40	-	-	-

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)	合约市值	公允价值变动
		(单位：手)		
IF1901	IF1901	24	21,625,920.00	-972,230.40
总额合计	-	-	-	-972,230.40
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-972,230.40
股指期货投资净额	-	-	-	-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	134,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	134,000,000.00	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	19,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	19,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	4,122.24	2,502.01
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	12,037.36	1,535.78
应收债券利息	176.77	212.89
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-10,956.16	-4,000.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	55,720.03	-
其他	541.70	186.90
合计	61,641.94	437.58

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,490,274.14	1,477,244.50
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,490,274.14	1,477,244.50

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
其他	-	-
预提费用	290,000.00	460,000.00
应付指数使用费	1,789,066.30	1,437,900.69
合计	2,079,066.30	1,897,900.69

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,603,506,477.00	14,660,468,397.68

本期申购	15,300,000.00	40,029,429.33
本期赎回（以“-”号填列）	-7,200,000.00	-18,837,378.51
2019年01月11日 基金拆分/份额折算前	5,611,606,477.00	14,681,660,448.50
基金拆分/份额折算变动份额	621,110,199.00	-
本期申购	3,744,000,000.00	8,819,338,263.22
本期赎回（以“-”号填列）	-3,440,700,000.00	-8,104,859,433.19
本期末	6,536,016,676.00	15,396,139,278.53

注：根据《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算的公告》（以下简称“份额折算公告”）的有关规定，本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2019 年 1 月 11 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 19,282,939,871.25 元，折算前基金份额总额为 5,611,606,477.00 份。根据份额折算公告中的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 1.110680861，折算后基金份额总额为 6,232,716,676.00 份，折算后基金份额净值为 3.0938 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，于 2019 年 1 月 11 日（权益登记日）日终对当日登记在册的本基金的基金份额实施折算，并于同一日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,112,219,110.26	-10,029,067,724.36	4,083,151,385.90
本期利润	1,879,124,291.73	5,109,887,712.46	6,989,012,004.19
本期基金份额交易产生的变动数	832,892,525.65	-117,805,994.62	715,086,531.03
其中：基金申购款	9,148,575,034.25	-3,299,298,856.94	5,849,276,177.31
基金赎回款	-8,315,682,508.60	3,181,492,862.32	-5,134,189,646.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,824,235,927.64	-5,036,986,006.52	11,787,249,921.12

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	156,278.15	115,377.92
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	282,470.57	179,347.13
其他	4,545.80	4,380.12
合计	443,294.52	299,105.17



## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	63,081,965.91	-495,226,518.44
股票投资收益——赎回 差价收入	1,384,064,674.19	238,498,576.34
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	1,447,146,640.10	-256,727,942.10

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	4,343,955,829.97	2,398,740,959.75
减：卖出股票成本总额	4,280,873,864.06	2,893,967,478.19
买卖股票差价收入	63,081,965.91	-495,226,518.44

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
赎回基金份额对价总额	13,257,886,457.98	1,663,989,592.03
减：现金支付赎回款总额	1,414,484,429.98	-22,373,068.97
减：赎回股票成本总额	10,459,337,353.81	1,447,864,084.66
赎回差价收入	1,384,064,674.19	238,498,576.34

## 7.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 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12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,375,574.81	15,989,380.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	97,945,500.00	14,842,600.00
减：应收利息总额	10,642.44	2,481.57
买卖债券差价收入	7,419,432.37	1,144,298.99

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 收益金额 2018年1月1日至2018年12 月31日
股指期货投资收益	9,501,562.72	-3,870,417.95

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
股票投资产生的股利收益	565,759,746.10	372,482,347.30
其中：证券出借权益补偿收入	3,000.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	565,759,746.10	372,482,347.30

## 7.4.7.16 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 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
1. 交易性金融资产	5,099,819,482.06	-4,677,107,735.64
股票投资	5,099,819,482.06	-4,677,107,735.64
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	10,068,230.40	-1,069,130.40
权证投资	-	-
期货投资	10,068,230.40	-1,069,130.40
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	5,109,887,712.46	-4,678,176,866.04

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转出费收入	-	-
替代损益	4,189,901.64	-1,945,839.40
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	4,189,901.64	-1,945,839.40

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
交易所市场交易费用	10,277,700.40	6,364,091.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,277,700.40	6,364,091.01

## 7.4.7.19 其他费用

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 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	170,000.00	160,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	28,723.23	21,432.69
上市年费	60,000.00	60,000.00
债券托管账户维护费	-	-
指数使用费	6,960,199.02	5,331,166.29
红利手续费	-	-
其他	5,000.00	-
合计	7,343,922.25	5,872,598.98

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 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
DWS Investments Singapore Limited	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

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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	2018 年 1 月 1 日至 2018

	12 月 31 日	年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	116,003,316.96	88,852,770.58
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人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。

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。

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,200,663.31	17,770,554.10

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.5.2 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 2019年12月31日		上年度末 2018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)	4,491,383,192.00	68.72	4,723,837,402.00	84.30

## 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	21,703,693.53	156,278.15	11,854,841.01	115,377.92

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2019年12月31日)，本基金持有41,308,229股中国银行的A股普通股，估值总额为人民币152,427,365.01元，占基金资产净值的比例为0.56%(2018年12月31日：估值总额为人民币150,994,491.69元，占基金资产净值的比例为0.81%)。

## 7.4.11 利润分配情况

本期(2019年1月1日至2019年12月31日)，本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末(2019年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额		
688037	芯源微	2019年12月6日	2020年6月16日	科创板新股锁定	26.97	58.98	3,028	81,665.16	178,591.44	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新发未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新发未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688168	安博通	2019年8月30日	2020年3月6日	科创板新股锁定	56.88	97.93	2,252	128,093.76	220,538.36	-
688128	中国电研	2019年10月29日	2020年5月6日	科创板新股锁定	18.79	17.52	9,027	169,617.33	158,153.04	-
688058	宝兰德	2019年10月25日	2020年5月6日	科创板新股锁定	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-
688023	安恒信息	2019年10月29日	2020年5月6日	科创板新股锁定	56.50	122.53	2,728	154,132.00	334,261.84	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新发未上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
002466	天齐锂业	2019年12月26日	2020年1月3日	配股未上市	8.75	30.18	375,727	3,287,611.25	11,339,440.86	-

## 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
110065	淮矿转债	2019年12月25日	2020年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	1,680	168,000.00	168,000.00	-
128084	木森	2019年	2020	新债未	100.00	100.00	2,360	236,000.00	236,000.00	-

	转债	12月18日	2020年1月10日	上市						
113029	明阳转债	2019年12月18日	2020年1月7日	新债未上市	100.00	100.00	1,890	189,000.00	189,000.00	-
128085	鸿达转债	2019年12月18日	2020年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	3,040	304,000.00	304,000.00	-
128086	国轩转债	2019年12月19日	2020年1月10日	新债未上市	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	-
128088	深南转债	2019年12月24日	2020年1月16日	新债未上市	100.00	100.00	8,331	833,100.00	833,100.00	-

注:1. 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。

2. 基金持有的股票在流通受限期内, 如获得股票红利、送股、转增股、配股的, 则该股票的数量和期末成本总额相应调整, 新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019年12月31日	重大事项停牌	39.39	2020年1月2日	40.43	1,269,328	45,206,390.06	49,998,829.92	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位: 人民币元



合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:张)	期末估值总额
2019121800000076	000413	东旭光电	2019-12-18	2020-01-01	3.36	255,000	856,800.00
2019121800000077	000413	东旭光电	2019-12-18	2020-01-01	3.36	1,000,000	3,360,000.00
2019121800000078	000413	东旭光电	2019-12-18	2020-01-01	3.36	210,000	705,600.00
2019121800000098	000723	美锦能源	2019-12-18	2020-01-01	9.43	255,000	2,404,650.00
2019121800000106	000723	美锦能源	2019-12-18	2020-01-01	9.43	160,000	1,508,800.00
2019121800000117	000786	北新建材	2019-12-18	2020-01-01	25.45	38,300	974,735.00
2019121800000186	002241	歌尔股份	2019-12-18	2020-01-01	19.92	50,000	996,000.00
2019121800000209	002294	信立泰	2019-12-18	2020-01-01	19.94	55,000	1,096,700.00
2019121800000217	002456	欧菲光	2019-12-18	2020-01-01	15.6	90,000	1,404,000.00
2019121800000220	002456	欧菲光	2019-12-18	2020-01-01	15.6	100,000	1,560,000.00
2019121800000222	002460	赣锋锂业	2019-12-18	2020-01-01	34.83	200,000	6,966,000.00
2019121800000223	002460	赣锋锂业	2019-12-18	2020-01-01	34.83	58,000	2,020,140.00
2019121800000240	002607	中公教育	2019-12-18	2020-01-01	17.88	10,000	178,800.00
2019121800000274	002939	长城证券	2019-12-18	2020-01-01	13.86	115,500	1,600,830.00
2019121800000294	300033	同花顺	2019-12-18	2020-01-01	109.11	72,500	7,910,475.00
2019121800000389	300433	蓝思科技	2019-12-18	2020-01-01	13.82	115,000	1,589,300.00
2019121800000395	300433	蓝思科技	2019-12-18	2020-01-01	13.82	150,000	2,073,000.00
2019121800000412	600998	九州通	2019-12-18	2020-01-01	14.15	59,900	847,585.00
2019121800000424	600369	西南证券	2019-12-18	2020-01-01	5.19	952,000	4,940,880.00
2019121800000457	600516	方大炭素	2019-12-18	2020-01-01	12.16	200,000	2,432,000.00
20191218	600516	方大炭素	2019-12-18	2020-01-01	12.16	40,000	486,400.00

00000463							
20191218 00000471	600690	海尔智家	2019-12-18	2020-01-01	19.5	54,000	1,053,000.00
20191218 00000534	600733	北汽蓝谷	2019-12-18	2020-01-01	5.84	100,000	584,000.00
20191218 00000552	600733	北汽蓝谷	2019-12-18	2020-01-01	5.84	188,300	1,099,672.00
20191218 00000560	601066	中信建投	2019-12-18	2020-01-01	30.4	151,000	4,590,400.00
20191218 00000571	600816	安信信托	2019-12-18	2020-01-01	4.44	700,000	3,108,000.00
20191218 00000601	600208	新湖中宝	2019-12-18	2020-01-01	3.78	679,200	2,567,376.00
20191218 00000619	600208	新湖中宝	2019-12-18	2020-01-01	3.78	258,000	975,240.00
20191218 00000631	600208	新湖中宝	2019-12-18	2020-01-01	3.78	330,000	1,247,400.00
20191218 00000640	600703	三安光电	2019-12-18	2020-01-01	18.36	117,000	2,148,120.00
20191219 00000181	002456	欧菲光	2019-12-19	2020-01-02	15.6	130,000	2,028,000.00
20191220 00000047	000703	恒逸石化	2019-12-20	2020-01-03	13.92	10,000	139,200.00
20191220 00000112	002607	中公教育	2019-12-20	2020-01-03	17.88	10,000	178,800.00
20191220 00000120	002958	青农商行	2019-12-20	2020-01-03	6.47	169,400	1,096,018.00
20191220 00000153	601577	长沙银行	2019-12-20	2020-01-03	9.07	13,300	120,631.00
20191220 00000164	600516	方大炭素	2019-12-20	2020-01-03	12.16	150,000	1,824,000.00
20191220 00000208	601878	浙商证券	2019-12-20	2020-01-03	11.13	451,000	5,019,630.00
20191220 00000211	600816	安信信托	2019-12-20	2020-01-03	4.44	40,000	177,600.00
20191223 00000349	600703	三安光电	2019-12-23	2020-01-06	18.36	90,000	1,652,400.00
20191224 00000074	000413	东旭光电	2019-12-24	2020-01-07	3.36	670,600	2,253,216.00
20191224 00000099	000723	美锦能源	2019-12-24	2020-01-07	9.43	192,200	1,812,446.00
20191224 00000181	002939	长城证券	2019-12-24	2020-01-07	13.86	53,000	734,580.00
20191224	002958	青农商行	2019-12-24	2020-01-07	6.47	132,300	855,981.00

00000182							
20191224 00000214	601901	方正证券	2019-12-24	2020-01-07	8.67	70,000	606,900.00
20191224 00000253	603799	华友钴业	2019-12-24	2020-01-07	39.39	32,000	1,260,480.00
20191224 00000265	600733	北汽蓝谷	2019-12-24	2020-01-07	5.84	67,000	391,280.00
20191224 00000280	601066	中信建投	2019-12-24	2020-01-07	30.4	69,700	2,118,880.00
20191224 00000284	601878	浙商证券	2019-12-24	2020-01-07	11.13	80,000	890,400.00
20191224 00000306	600928	西安银行	2019-12-24	2020-01-07	7.77	134,000	1,041,180.00
20191224 00000310	601138	工业富联	2019-12-24	2020-01-07	18.27	35,000	639,450.00
20191224 00000314	600208	新潮中宝	2019-12-24	2020-01-07	3.78	104,000	393,120.00
20191225 00000118	002456	欧菲光	2019-12-25	2020-01-08	15.6	10,000	156,000.00
20191225 00000119	002294	信立泰	2019-12-25	2020-01-08	19.94	27,000	538,380.00
20191225 00000122	002410	广联达	2019-12-25	2020-01-08	33.98	20,000	679,600.00
20191225 00000159	300433	蓝思科技	2019-12-25	2020-01-08	13.82	40,000	552,800.00
20191225 00000161	300433	蓝思科技	2019-12-25	2020-01-08	13.82	21,800	301,276.00
20191225 00000173	601108	财通证券	2019-12-25	2020-01-08	11.34	300,000	3,402,000.00
20191225 00000181	600893	航发动力	2019-12-25	2020-01-08	21.68	10,000	216,800.00
20191225 00000188	600867	通化东宝	2019-12-25	2020-01-08	12.65	10,000	126,500.00
20191225 00000195	600438	通威股份	2019-12-25	2020-01-08	13.13	10,000	131,300.00
20191225 00000200	601800	中国交建	2019-12-25	2020-01-08	9.16	13,700	125,492.00
20191225 00000210	601238	广汽集团	2019-12-25	2020-01-08	11.69	10,600	123,914.00
20191226 00000059	000100	TCL 集团	2019-12-26	2020-01-09	4.47	229,000	1,023,630.00
20191226 00000107	002411	延安必康	2019-12-26	2020-01-09	15.63	45,000	703,350.00
20191226	002456	欧菲光	2019-12-26	2020-01-09	15.6	111,000	1,731,600.00

00000116							
20191226 00000157	300433	蓝思科技	2019-12-26	2020-01-09	13.82	33,000	456,060.00
20191226 00000168	601108	财通证券	2019-12-26	2020-01-09	11.34	700,000	7,938,000.00
20191226 00000177	600516	方大炭素	2019-12-26	2020-01-09	12.16	50,000	608,000.00
20191226 00000184	600516	方大炭素	2019-12-26	2020-01-09	12.16	200,000	2,432,000.00
20191226 00000194	603799	华友钴业	2019-12-26	2020-01-09	39.39	32,000	1,260,480.00
20191226 00000200	603799	华友钴业	2019-12-26	2020-01-09	39.39	37,000	1,457,430.00
20191226 00000211	601878	浙商证券	2019-12-26	2020-01-09	11.13	127,400	1,417,962.00
20191227 00000246	002460	赣锋锂业	2019-12-27	2020-01-10	34.83	29,000	1,010,070.00
20191230 00000141	603799	华友钴业	2019-12-30	2020-01-13	39.39	10,000	393,900.00
20191230 00000143	601360	三六零	2019-12-30	2020-01-13	23.51	30,000	705,300.00
20191230 00000157	600928	西安银行	2019-12-30	2020-01-13	7.77	107,300	833,721.00
合计	-	-	-	-	-	11,681,000	116,845,660.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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。

#### 7.4.13.2 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，基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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通过券款对付的方式进行交割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。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	168,000.00	3,469,000.00
AAA 以下	1,745,100.00	-
未评级	-	-
合计	1,913,100.00	3,469,000.00

注：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。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，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。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	21,703,693.53	-	-	-	21,703,693.53
结算备付金	26,697,797.36	-	-	-	26,697,797.36
存出保证金	1,203,615.62	-	-	15,316,068.00	16,519,683.62
交易性金融资产	-	-	1,913,100.00	27,005,582,800.25	27,007,495,900.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	134,000,000.00	-	-	-	134,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	21,616,190.17	21,616,190.17
应收利息	-	-	-	61,641.94	61,641.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>183,605,106.51</b>	<b>-</b>	<b>1,913,100.00</b>	<b>27,042,576,700.36</b>	<b>27,228,094,906.87</b>
<b>负债</b>					
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	-	-	-	27,591,856.16	27,591,856.16
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,418,555.77	10,418,555.77
应付托管费	-	-	-	2,083,711.14	2,083,711.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,490,274.14	2,490,274.14
应付税费	-	-	-	42,243.71	42,243.71



应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,079,066.30	2,079,066.30
负债总计	-	-	-	44,705,707.22	44,705,707.22
利率敏感度缺口	183,605,106.51	-	1,913,100.00	26,997,870,993.14	27,183,389,199.65
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	11,854,841.01	-	-	-	11,854,841.01
结算备付金	2,949,257.00	-	-	-	2,949,257.00
存出保证金	415,400.63	-	-	2,162,592.00	2,577,992.63
交易性金融资产	-	-	3,469,000.00	18,715,314,312.15	18,718,783,312.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	19,000,000.00	-	-	-	19,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	4,142,066.83	4,142,066.83
应收利息	-	-	-	437.58	437.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,219,498.64	-	3,469,000.00	18,721,619,408.56	18,759,307,907.20
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	-	-	-	2,659,078.05	2,659,078.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,044,905.93	8,044,905.93
应付托管费	-	-	-	1,608,981.15	1,608,981.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,477,244.50	1,477,244.50
应付税费	-	-	-	13.30	13.30
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,897,900.69	1,897,900.69
负债总计	-	-	-	15,688,123.62	15,688,123.62
利率敏感度缺口	34,219,498.64	-	3,469,000.00	18,705,931,284.94	18,743,619,783.58

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数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。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	27,005,582,800.25	99.35	18,715,314,312.15	99.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

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	27,005,582,800.25	99.35	18,715,314,312.15	99.85

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,357,032,026.50	935,549,958.00
	业绩比较基准下降 5%	-1,357,032,026.50	-935,549,958.00

#### 7.4.14 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 26,954,276,081.10 元，属于第二层次的余额为 53,219,819.15 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 18,393,755,246.28 元，第二层次 325,028,065.87 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	-
转入第三层次	17,009,888.68
转出第三层次	-17,009,888.68
当期损失总额	-
——计入损益的损失	-
2019年12月31日	-
2019年12月31日仍持有的资产计入 2019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。

金额单位：人民币元

	交易性金融资产——股票投资
2018年1月1日	13,974,918.68
转入第三层次	-
转出第三层次	-13,974,918.68
当期损失总额	-
——计入损益的损失	-
2018年12月31日	-

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 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。

## § 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	27,005,582,800.25	99.18
	其中：股票	27,005,582,800.25	99.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,913,100.00	0.01
	其中：债券	1,913,100.00	0.01
	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	134,000,000.00	0.49
	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	48,401,490.89	0.18
8	其他各项资产	38,197,515.73	0.14
9	合计	27,228,094,906.87	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 116,845,660.00 元，占基金资产净值的比例为 0.43%。

### 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	394,351,195.20	1.45

B	采矿业	815,134,395.85	3.00
C	制造业	11,409,297,511.97	41.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	645,309,782.35	2.37
E	建筑业	689,845,903.40	2.54
F	批发和零售业	298,759,665.81	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	780,968,668.79	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	814,014,055.66	2.99
J	金融业	9,018,966,659.59	33.18
K	房地产业	1,234,973,340.18	4.54
L	租赁和商务服务业	336,928,409.47	1.24
M	科学研究和技术服务业	132,512,869.72	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	28,222,182.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,758,944.00	0.09
Q	卫生和社会工作	240,308,356.40	0.88
R	文化、体育和娱乐业	140,740,675.14	0.52
S	综合	-	-
	合计	27,004,092,615.53	99.34

### 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	496,553.18	0.00
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	686,242.70	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	158,153.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,347,526.96	0.00

## 8.3 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

## 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	21,227,937	1,814,139,496.02	6.67
2	600519	贵州茅台	980,934	1,160,444,922.00	4.27
3	600036	招商银行	20,216,631	759,740,992.98	2.79
4	000651	格力电器	9,432,108	618,557,642.64	2.28
5	601166	兴业银行	28,497,432	564,249,153.60	2.08
6	000333	美的集团	9,501,352	553,453,754.00	2.04
7	600276	恒瑞医药	6,063,908	530,713,228.16	1.95
8	000858	五粮液	3,794,625	504,723,071.25	1.86
9	600030	中信证券	15,384,125	389,218,362.50	1.43
10	600887	伊利股份	11,955,250	369,895,435.00	1.36
11	000002	万科A	11,416,707	367,389,631.26	1.35
12	600900	长江电力	17,249,422	317,044,376.36	1.17
13	000001	平安银行	18,980,587	312,230,656.15	1.15
14	600016	民生银行	48,650,578	306,985,147.18	1.13
15	601328	交通银行	53,857,126	303,215,619.38	1.12
16	600000	浦发银行	23,013,638	284,678,702.06	1.05
17	601288	农业银行	75,087,097	277,071,387.93	1.02
18	601398	工商银行	42,280,357	248,608,499.16	0.91
19	600837	海通证券	15,861,186	245,213,935.56	0.90
20	300498	温氏股份	7,274,311	244,416,849.60	0.90
21	002415	海康威视	7,311,926	239,392,457.24	0.88
22	601601	中国太保	6,166,023	233,322,310.32	0.86
23	601668	中国建筑	41,136,832	231,188,995.84	0.85
24	002475	立讯精密	6,281,876	229,288,474.00	0.84
25	600048	保利地产	14,026,494	226,948,672.92	0.83
26	600585	海螺水泥	3,915,197	214,552,795.60	0.79
27	000725	京东方A	46,372,725	210,532,171.50	0.77
28	600031	三一重工	11,556,165	197,032,613.25	0.72
29	601688	华泰证券	8,652,839	175,739,160.09	0.65
30	600309	万华化学	3,074,144	172,674,668.48	0.64
31	601888	中国国旅	1,917,191	170,534,139.45	0.63
32	603288	海天味业	1,585,637	170,471,833.87	0.63
33	300059	东方财富	10,515,132	165,823,631.64	0.61
34	601169	北京银行	29,006,649	164,757,766.32	0.61
35	000063	中兴通讯	4,650,476	164,580,345.64	0.61
36	600104	上汽集团	6,875,094	163,970,991.90	0.60
37	601211	国泰君安	8,836,467	163,386,274.83	0.60

38	002142	宁波银行	5,509,246	155,085,274.90	0.57
39	601988	中国银行	41,308,229	152,427,365.01	0.56
40	002714	牧原股份	1,688,640	149,934,345.60	0.55
41	600009	上海机场	1,892,558	149,038,942.50	0.55
42	000338	潍柴动力	9,376,784	148,903,329.92	0.55
43	600690	海尔智家	7,225,284	140,893,038.00	0.52
44	601818	光大银行	31,209,509	137,633,934.69	0.51
45	601766	中国中车	19,068,796	136,151,203.44	0.50
46	600028	中国石化	26,217,970	133,973,826.70	0.49
47	603259	药明康德	1,438,481	132,512,869.72	0.49
48	601229	上海银行	13,919,510	132,096,149.90	0.49
49	600919	江苏银行	18,101,200	131,052,688.00	0.48
50	002304	洋河股份	1,182,789	130,698,184.50	0.48
51	601012	隆基股份	5,173,424	128,456,117.92	0.47
52	002027	分众传媒	20,103,077	125,845,262.02	0.46
53	000661	长春高新	279,659	125,007,573.00	0.46
54	000568	泸州老窖	1,433,018	124,214,000.24	0.46
55	601899	紫金矿业	26,943,328	123,669,875.52	0.45
56	001979	招商蛇口	6,197,352	123,141,384.24	0.45
57	000100	TCL 集团	26,470,864	118,324,762.08	0.44
58	601088	中国神华	6,465,127	117,988,567.75	0.43
59	601628	中国人寿	3,270,269	114,034,280.03	0.42
60	601857	中国石油	19,038,306	110,993,323.98	0.41
61	600050	中国联通	18,245,051	107,463,350.39	0.40
62	002230	科大讯飞	3,009,368	103,763,008.64	0.38
63	600999	招商证券	5,607,222	102,556,090.38	0.38
64	601009	南京银行	11,636,391	102,051,149.07	0.38
65	600019	宝钢股份	17,461,397	100,228,418.78	0.37
66	600570	恒生电子	1,262,121	98,104,665.33	0.36
67	600406	国电南瑞	4,526,752	95,876,607.36	0.35
68	300015	爱尔眼科	2,420,976	95,773,810.56	0.35
69	601006	大秦铁路	11,654,125	95,680,366.25	0.35
70	601939	建设银行	13,160,179	95,148,094.17	0.35
71	601390	中国中铁	15,964,062	94,826,528.28	0.35
72	601989	中国重工	17,939,635	94,003,687.40	0.35
73	600015	华夏银行	12,066,794	92,552,309.98	0.34
74	601186	中国铁建	9,023,082	91,494,051.48	0.34
75	000166	申万宏源	17,632,153	90,276,623.36	0.33
76	000538	云南白药	996,049	89,076,662.07	0.33
77	002241	歌尔股份	4,442,722	88,499,022.24	0.33
78	600703	三安光电	4,800,111	88,130,037.96	0.32
79	000776	广发证券	5,790,278	87,838,517.26	0.32



80	002594	比亚迪	1,769,435	84,348,966.45	0.31
81	000876	新希望	4,134,652	82,486,307.40	0.30
82	600741	华域汽车	3,086,716	80,223,748.84	0.30
83	601336	新华保险	1,632,173	80,221,302.95	0.30
84	002044	美年健康	5,364,356	79,875,260.84	0.29
85	603986	兆易创新	382,532	78,376,981.48	0.29
86	300142	沃森生物	2,403,200	77,959,808.00	0.29
87	600958	东方证券	7,019,787	75,532,908.12	0.28
88	600352	浙江龙盛	5,100,548	73,804,929.56	0.27
89	002024	苏宁易购	7,284,979	73,651,137.69	0.27
90	601225	陕西煤业	7,841,596	70,495,948.04	0.26
91	002236	大华股份	3,532,035	70,216,855.80	0.26
92	600588	用友网络	2,449,262	69,559,040.80	0.26
93	601901	方正证券	7,999,402	69,354,815.34	0.26
94	300003	乐普医疗	2,092,384	69,216,062.72	0.25
95	300136	信维通信	1,515,121	68,756,190.98	0.25
96	601155	新城控股	1,764,500	68,321,440.00	0.25
97	000157	中联重科	10,142,323	67,750,717.64	0.25
98	600340	华夏幸福	2,359,814	67,726,661.80	0.25
99	002008	大族激光	1,667,159	66,686,360.00	0.25
100	600346	恒力石化	4,141,940	66,602,395.20	0.25
101	600547	山东黄金	2,040,256	66,553,150.72	0.24
102	600660	福耀玻璃	2,750,203	65,977,369.97	0.24
103	600436	片仔癀	593,156	65,170,049.72	0.24
104	601669	中国电建	14,995,677	65,081,238.18	0.24
105	601377	兴业证券	9,190,883	65,071,451.64	0.24
106	300347	泰格医药	1,023,900	64,659,285.00	0.24
107	002202	金风科技	5,398,515	64,512,254.25	0.24
108	600383	金地集团	4,422,971	64,133,079.50	0.24
109	002352	顺丰控股	1,723,700	64,104,403.00	0.24
110	601138	工业富联	3,504,000	64,018,080.00	0.24
111	000069	华侨城A	8,024,302	62,509,312.58	0.23
112	300124	汇川技术	2,039,715	62,496,867.60	0.23
113	600886	国投电力	6,648,101	61,029,567.18	0.22
114	601985	中国核电	12,204,500	61,022,500.00	0.22
115	600029	南方航空	8,432,226	60,543,382.68	0.22
116	002736	国信证券	4,815,976	60,440,498.80	0.22
117	603993	洛阳钼业	13,848,187	60,378,095.32	0.22
118	600010	宝钢股份	44,675,175	58,971,231.00	0.22
119	002001	新和成	2,518,700	58,584,962.00	0.22
120	002456	欧菲光	3,713,930	57,937,308.00	0.21
121	002007	华兰生物	1,644,336	57,798,410.40	0.21

122	601111	中国国航	5,856,547	56,749,940.43	0.21
123	603160	汇顶科技	274,671	56,664,627.30	0.21
124	000895	双汇发展	1,951,074	56,639,678.22	0.21
125	601933	永辉超市	7,499,126	56,543,410.04	0.21
126	601877	正泰电器	2,109,085	56,523,478.00	0.21
127	601108	财通证券	4,926,100	55,861,974.00	0.21
128	002555	三七互娱	2,071,463	55,784,498.59	0.21
129	002311	海大集团	1,545,050	55,621,800.00	0.20
130	600795	国电电力	23,109,089	54,075,268.26	0.20
131	000783	长江证券	7,569,281	54,044,666.34	0.20
132	002602	世纪华通	4,657,150	53,231,224.50	0.20
133	300144	宋城演艺	1,701,784	52,602,143.44	0.19
134	600196	复星医药	1,973,653	52,499,169.80	0.19
135	002466	天齐锂业	1,738,812	52,477,346.16	0.19
136	600018	上港集团	9,088,650	52,441,510.50	0.19
137	002460	赣锋锂业	1,495,317	52,081,891.11	0.19
138	600705	中航资本	10,560,298	51,217,445.30	0.19
139	600115	东方航空	8,781,300	51,019,353.00	0.19
140	600271	航天信息	2,189,968	50,741,558.56	0.19
141	000938	紫光股份	1,596,744	50,457,110.40	0.19
142	000425	徐工机械	9,198,169	50,313,984.43	0.19
143	601788	光大证券	3,825,362	50,112,242.20	0.18
144	603799	华友钴业	1,269,328	49,998,829.92	0.18
145	600438	通威股份	3,802,100	49,921,573.00	0.18
146	600061	国投资本	3,285,583	49,743,726.62	0.18
147	600606	绿地控股	7,155,900	49,733,505.00	0.18
148	603501	韦尔股份	344,133	49,348,672.20	0.18
149	600089	特变电工	7,279,230	48,406,879.50	0.18
150	601997	贵阳银行	5,046,060	48,240,333.60	0.18
151	600011	华能国际	8,623,000	48,116,340.00	0.18
152	600177	雅戈尔	6,884,323	47,983,731.31	0.18
153	601555	东吴证券	4,709,182	47,044,728.18	0.17
154	002050	三花智控	2,707,800	46,926,174.00	0.17
155	600183	生益科技	2,229,700	46,645,324.00	0.17
156	300122	智飞生物	936,300	46,496,658.00	0.17
157	300033	同花顺	424,612	46,329,415.32	0.17
158	600111	北方稀土	4,273,404	46,323,699.36	0.17
159	600809	山西汾酒	515,516	46,241,785.20	0.17
160	002271	东方雨虹	1,742,499	45,845,148.69	0.17
161	002493	荣盛石化	3,691,400	45,736,446.00	0.17
162	300408	三环集团	2,047,800	45,624,984.00	0.17
163	601600	中国铝业	12,819,965	45,382,676.10	0.17

164	002410	广联达	1,325,200	45,030,296.00	0.17
165	600176	中国巨石	4,121,922	44,928,949.80	0.17
166	002624	完美世界	1,007,900	44,488,706.00	0.16
167	000768	中航飞机	2,710,693	44,401,151.34	0.16
168	600109	国金证券	4,746,853	44,145,732.90	0.16
169	002120	韵达股份	1,308,460	43,571,718.00	0.16
170	603019	中科曙光	1,238,280	42,819,722.40	0.16
171	600487	亨通光电	2,615,940	42,535,184.40	0.16
172	601800	中国交建	4,600,923	42,144,454.68	0.16
173	000786	北新建材	1,650,000	41,992,500.00	0.15
174	000963	华东医药	1,708,221	41,646,427.98	0.15
175	601607	上海医药	2,260,031	41,516,769.47	0.15
176	002179	中航光电	1,042,636	40,725,362.16	0.15
177	600100	同方股份	4,642,800	40,717,356.00	0.15
178	601919	中远海控	7,593,448	40,017,470.96	0.15
179	600522	中天科技	4,811,300	39,933,790.00	0.15
180	002422	科伦药业	1,686,900	39,625,281.00	0.15
181	600332	白云山	1,107,277	39,430,133.97	0.15
182	601618	中国中冶	13,992,510	39,179,028.00	0.14
183	600221	海航控股	22,548,861	39,009,529.53	0.14
184	600516	方大炭素	3,194,984	38,851,005.44	0.14
185	000961	中南建设	3,628,700	38,282,785.00	0.14
186	000625	长安汽车	3,813,046	38,244,851.38	0.14
187	600893	航发动力	1,759,160	38,138,588.80	0.14
188	600498	烽火通信	1,378,100	37,828,845.00	0.14
189	600637	东方明珠	4,039,255	37,807,426.80	0.14
190	600066	宇通客车	2,607,810	37,161,292.50	0.14
191	601998	中信银行	6,003,511	37,041,662.87	0.14
192	600926	杭州银行	4,026,696	36,884,535.36	0.14
193	000728	国元证券	3,946,196	36,581,236.92	0.13
194	300413	芒果超媒	1,040,780	36,385,668.80	0.13
195	300017	网宿科技	3,805,161	36,263,184.33	0.13
196	600068	葛洲坝	5,420,422	36,208,418.96	0.13
197	601727	上海电气	7,162,543	35,669,464.14	0.13
198	601198	东兴证券	2,705,600	35,551,584.00	0.13
199	600004	白云机场	2,030,000	35,423,500.00	0.13
200	600867	通化东宝	2,792,168	35,320,925.20	0.13
201	603899	晨光文具	721,300	35,156,162.00	0.13
202	600362	江西铜业	2,035,715	34,464,654.95	0.13
203	600674	川投能源	3,453,650	34,018,452.50	0.13
204	002673	西部证券	3,427,997	33,594,370.60	0.12
205	002146	荣盛发展	3,405,514	33,476,202.62	0.12

206	601838	成都银行	3,541,100	32,117,777.00	0.12
207	000656	金科股份	4,180,700	32,107,776.00	0.12
208	600583	海油工程	4,332,979	31,977,385.02	0.12
209	600208	新湖中宝	8,430,930	31,868,915.40	0.12
210	600023	浙能电力	7,996,405	31,665,763.80	0.12
211	000423	东阿阿胶	893,473	31,602,140.01	0.12
212	601021	春秋航空	718,706	31,544,006.34	0.12
213	600219	南山铝业	14,058,610	31,491,286.40	0.12
214	002508	老板电器	926,940	31,339,841.40	0.12
215	601117	中国化学	4,837,600	31,154,144.00	0.11
216	000703	恒逸石化	2,223,100	30,945,552.00	0.11
217	600170	上海建工	8,725,462	30,888,135.48	0.11
218	002601	龙蟠佰利	1,990,100	30,627,639.00	0.11
219	600085	同仁堂	1,070,077	30,154,769.86	0.11
220	000596	古井贡酒	220,221	29,932,438.32	0.11
221	300024	机器人	2,137,234	29,921,276.00	0.11
222	002739	万达电影	1,624,200	29,479,230.00	0.11
223	601018	宁波港	7,748,630	29,444,794.00	0.11
224	601881	中国银河	2,532,200	29,398,842.00	0.11
225	601878	浙商证券	2,617,410	29,131,773.30	0.11
226	002252	上海莱士	3,889,342	28,858,917.64	0.11
227	000413	东旭光电	8,578,641	28,824,233.76	0.11
228	000630	铜陵有色	12,355,670	28,788,711.10	0.11
229	600369	西南证券	5,535,836	28,730,988.84	0.11
230	600489	中金黄金	3,385,512	28,709,141.76	0.11
231	603833	欧派家居	243,395	28,477,215.00	0.10
232	300070	碧水源	3,713,445	28,222,182.00	0.10
233	002916	深南电路	196,600	27,936,860.00	0.10
234	002081	金螳螂	3,138,425	27,680,908.50	0.10
235	600038	中直股份	579,847	27,664,500.37	0.10
236	600535	天士力	1,773,963	27,354,509.46	0.10
237	000627	天茂集团	3,863,100	27,196,224.00	0.10
238	000671	阳光城	3,165,900	26,910,150.00	0.10
239	600482	中国动力	1,330,662	26,613,240.00	0.10
240	601066	中信建投	873,773	26,562,699.20	0.10
241	600760	中航沈飞	821,900	25,972,040.00	0.10
242	002032	苏泊尔	326,420	25,062,527.60	0.09
243	600153	建发股份	2,780,137	24,993,431.63	0.09
244	600118	中国卫星	1,163,032	24,853,993.84	0.09
245	000629	攀钢钒钛	8,406,100	24,545,812.00	0.09
246	002153	石基信息	627,852	24,486,228.00	0.09
247	601992	金隅集团	6,537,300	24,384,129.00	0.09

248	603156	养元饮品	825,203	23,955,643.09	0.09
249	600655	豫园股份	3,042,600	23,853,984.00	0.09
250	002607	中公教育	1,328,800	23,758,944.00	0.09
251	600027	华电国际	6,387,975	23,443,868.25	0.09
252	600663	陆家嘴	1,720,786	23,247,818.86	0.09
253	000723	美锦能源	2,402,900	22,659,347.00	0.08
254	002938	鹏鼎控股	500,400	22,467,960.00	0.08
255	601808	中海油服	1,164,700	22,362,240.00	0.08
256	600977	中国电影	1,463,445	22,273,632.90	0.08
257	002558	巨人网络	1,191,460	21,517,767.60	0.08
258	000709	河钢股份	8,313,426	21,448,639.08	0.08
259	601238	广汽集团	1,824,120	21,323,962.80	0.08
260	300433	蓝思科技	1,535,352	21,218,564.64	0.08
261	601633	长城汽车	2,360,031	20,886,274.35	0.08
262	600297	广汇汽车	6,399,000	20,860,740.00	0.08
263	601216	君正集团	6,613,714	20,700,924.82	0.08
264	600398	海澜之家	2,603,200	19,992,576.00	0.07
265	600848	上海临港	781,100	19,176,005.00	0.07
266	002773	康弘药业	516,650	19,100,550.50	0.07
267	600816	安信信托	4,273,776	18,975,565.44	0.07
268	002411	延安必康	1,202,300	18,791,949.00	0.07
269	601360	三六零	794,350	18,675,168.50	0.07
270	600188	兖州煤业	1,736,109	18,333,311.04	0.07
271	601577	长沙银行	2,014,200	18,268,794.00	0.07
272	601898	中煤能源	3,588,000	18,011,760.00	0.07
273	002010	传化智联	2,553,900	17,826,222.00	0.07
274	002294	信立泰	817,259	16,296,144.46	0.06
275	600733	北汽蓝谷	2,741,300	16,009,192.00	0.06
276	601319	中国人保	2,088,500	15,851,715.00	0.06
277	000898	鞍钢股份	4,695,500	15,729,925.00	0.06
278	600998	九州通	1,109,100	15,693,765.00	0.06
279	600566	济川药业	640,200	15,480,036.00	0.06
280	600989	宝丰能源	1,579,000	15,016,290.00	0.06
281	600025	华能水电	3,529,300	14,893,646.00	0.05
282	600372	中航电子	1,030,016	14,667,427.84	0.05
283	600233	圆通速递	1,119,104	14,156,665.60	0.05
284	000415	渤海租赁	3,629,600	13,792,480.00	0.05
285	601236	红塔证券	782,400	13,120,848.00	0.05
286	002841	视源股份	139,300	11,938,010.00	0.04
287	002468	申通快递	600,600	11,711,700.00	0.04
288	600968	海油发展	3,989,000	11,687,770.00	0.04
289	601212	白银有色	2,902,500	10,681,200.00	0.04

290	002939	长城证券	668,600	9,266,796.00	0.03
291	601828	美凯龙	788,200	8,930,306.00	0.03
292	601698	中国卫通	783,100	8,864,692.00	0.03
293	603260	合盛硅业	282,188	8,316,080.36	0.03
294	600390	五矿资本	966,160	7,980,481.60	0.03
295	002945	华林证券	530,800	7,930,152.00	0.03
296	002958	青农商行	1,198,800	7,756,236.00	0.03
297	601162	天风证券	1,011,000	7,440,960.00	0.03
298	600928	西安银行	954,700	7,418,019.00	0.03
299	601298	青岛港	947,800	6,511,386.00	0.02
300	600299	安迪苏	580,399	6,419,212.94	0.02

### 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	688023	安恒信息	2,728	334,261.84	0.00
2	688168	安博通	2,252	220,538.36	0.00
3	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.00
4	688037	芯源微	3,028	178,591.44	0.00
5	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.00
6	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.00
7	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.00
8	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
9	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
10	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

### 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	300498	温氏股份	298,413,553.79	1.59
2	600519	贵州茅台	126,373,352.48	0.67
3	603259	药明康德	105,559,538.37	0.56
4	601166	兴业银行	77,187,236.53	0.41
5	000333	美的集团	77,180,164.33	0.41
6	600900	长江电力	74,611,013.34	0.40
7	300347	泰格医药	63,098,927.03	0.34
8	601318	中国平安	61,793,695.93	0.33
9	600276	恒瑞医药	59,385,110.05	0.32
10	601088	中国神华	53,456,191.59	0.29
11	603019	中科曙光	51,886,600.89	0.28
12	600183	生益科技	50,169,683.24	0.27

13	603501	韦尔股份	48,757,697.49	0.26
14	000002	万科A	47,789,326.10	0.25
15	601108	财通证券	47,194,371.86	0.25
16	601688	华泰证券	44,109,163.29	0.24
17	000661	长春高新	43,324,980.48	0.23
18	002410	广联达	40,600,122.00	0.22
19	000596	古井贡酒	36,184,094.56	0.19
20	002602	世纪华通	34,595,721.54	0.18

#### 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	303,449,227.63	1.62
2	600519	贵州茅台	227,020,583.49	1.21
3	600036	招商银行	120,160,952.53	0.64
4	600276	恒瑞医药	72,252,561.01	0.39
5	601166	兴业银行	68,573,426.56	0.37
6	600887	伊利股份	60,295,762.59	0.32
7	600030	中信证券	56,281,579.47	0.30
8	000661	长春高新	53,795,265.22	0.29
9	601328	交通银行	50,406,113.00	0.27
10	600016	民生银行	49,151,049.60	0.26
11	600340	华夏幸福	46,651,085.78	0.25
12	000858	五粮液	46,000,256.36	0.25
13	600000	浦发银行	45,128,492.41	0.24
14	601288	农业银行	44,922,571.00	0.24
15	000651	格力电器	43,963,834.63	0.23
16	000333	美的集团	43,142,690.51	0.23
17	601398	工商银行	40,205,717.22	0.21
18	601668	中国建筑	39,565,103.07	0.21
19	002065	东华软件	38,095,735.33	0.20
20	600837	海通证券	36,643,606.21	0.20

#### 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	3,609,892,619.75
卖出股票收入（成交）总额	4,343,955,829.97

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）	1,913,100.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,913,100.00	0.01

### 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	128088	深南转债	8,331	833,100.00	0.00
2	128085	鸿达转债	3,040	304,000.00	0.00
3	128084	木森转债	2,360	236,000.00	0.00
4	113029	明阳转债	1,890	189,000.00	0.00
5	128086	国轩转债	1,830	183,000.00	0.00

### 8.7 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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
IF2003	IF2003	30	37,078,200.00	2,410,500.00	-
IF2006	IF2006	94	116,082,480.00	6,685,500.00	-
公允价值变动总额合计（元）					9,096,000.00
股指期货投资本期收益（元）					9,501,562.72
股指期货投资本期公允价值变动（元）					10,068,230.40



### 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

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

#### 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	16,519,683.62
2	应收证券清算款	21,616,190.17
3	应收股利	-
4	应收利息	61,641.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,197,515.73

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 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

无。

## 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	688023	安恒信息	334,261.84	0.00	科创板新股锁定
2	688168	安博通	220,538.36	0.00	科创板新股锁定
3	688181	八亿时空	189,377.88	0.00	新发未上市
4	688037	芯源微	178,591.44	0.00	科创板新股锁定
5	688128	中国电研	158,153.04	0.00	科创板新股锁定

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

## § 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（%）
23,587	277,102.50	6,067,645,351.00	92.83	468,371,325.00	7.17

## 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)	4,491,383,192.00	68.72

## 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	中央汇金资产管理有限责任公司	313,051,932.00	4.79
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	124,877,385.00	1.91
3	友邦保险有限公司上海分公司—传统—普通保险产品	106,285,100.00	1.63
4	中信证券股份有限公司	83,637,334.00	1.28

5	中央汇金投资有限 责任公司	83,301,065.00	1.27
6	友邦保险有限公司广 东分公司—传统—普 通保险产品	67,461,667.00	1.03
7	中英人寿保险有限公 司—传统保险产品	51,000,000.00	0.78
8	海通证券股份有限公 司	45,456,900.00	0.70
9	上海展弘投资管理有 限公司—展弘稳进1号 私募证券投资基金	41,327,954.00	0.63
10	长江养老保险股份有 限公司—中国太平洋 人寿权益基金型投资 产品（财富管家）委托 专户	39,200,072.00	0.60
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	4,491,383,192.00	68.72

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

无。

### 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	5,603,506,477.00
本报告期基金总申购份额	3,759,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,447,900,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	621,110,199.00
本报告期期末基金份额总额	6,536,016,676.00

注：报告期间拆分变动份额为基金折算增加份额。

## § 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

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。

2019 年 6 月，刘连舸先生任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。

### 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 170,000.00 元，该审计机构已连续 8 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
中信证券股份有限公司	7	3,166,283,806.70	39.98%	2,014,826.45	38.89%	新增2个
中国国际金融股份有限公司	5	1,725,398,339.47	21.79%	1,090,050.15	21.04%	新增2个
中泰证券股份有限公司	4	628,939,034.51	7.94%	440,259.43	8.50%	-
兴业证券股份有限公司	3	597,593,529.57	7.55%	418,319.66	8.08%	-
西部证券股份有限公司	2	387,822,641.12	4.90%	244,826.81	4.73%	新增
中信建投证券股份有限公司	4	348,299,237.64	4.40%	243,812.89	4.71%	-
光大证券股份有限公司	2	275,979,883.93	3.48%	193,185.95	3.73%	新增1个
西南证券股份有限公司	2	192,060,964.64	2.43%	121,249.73	2.34%	-

东方证券 股份有限 公司	4	137,575,119.75	1.74%	96,303.83	1.86%	-
方正证券 股份有限 公司	5	133,271,468.46	1.68%	93,290.12	1.80%	-
广发证券 股份有限 公司	4	96,667,053.14	1.22%	67,668.17	1.31%	-
长江证券 股份有限 公司	2	80,574,576.30	1.02%	56,404.74	1.09%	新增1 个
东吴证券 股份有限 公司	3	47,821,938.60	0.60%	30,191.06	0.58%	-
国泰君安 证券股份 有限公司	4	36,825,309.91	0.46%	25,778.01	0.50%	-
海通证券 股份有限 公司	2	24,701,132.50	0.31%	17,291.08	0.33%	-
华泰证券 股份有限 公司	6	20,646,088.02	0.26%	14,452.33	0.28%	新增2 个
国海证券 股份有限 公司	2	14,210,005.94	0.18%	8,970.63	0.17%	-
中国中金 财富证券 有限公司	1	4,929,100.58	0.06%	3,450.35	0.07%	-

安信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
广州证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	新增1 个
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-



天源证券 经纪有限 公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	新增
中银国际 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。

## 3. 中国中投证券有限责任公司更名为中国中金财富证券有限公司。

### 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
东吴证券股份有限公司	-	-	193,000,000.00	1.54%	-	-
方正证券股份有限公司	4,853,797.70	4.61%	1,560,000,000.00	12.46%	-	-
光大证券股份有限公司	3,915,821.50	3.72%	419,000,000.00	3.35%	-	-
广发证券股份有限公司	1,947,685.30	1.85%	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	108,000,000.00	0.86%	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	1,211,000,000.00	9.67%	-	-
西部证券股份有限	-	-	35,000,000.00	0.28%	-	-

公司						
西南证券股份有限公司	22,058,272.30	20.93%	297,000,000.00	2.37%	-	-
中国国际金融股份有限公司	1,172,220.00	1.11%	1,672,000,000.00	13.36%	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	365,000,000.00	2.92%	-	-
中航证券有限公司	-	-	182,000,000.00	1.45%	-	-
中信建投证券股份有限公司	1,062,480.71	1.01%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	70,365,297.30	66.78%	6,475,000,000.00	51.73%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实沪深 300ETF 流动性服务商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 03 日
2	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 04 日
3	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 11 日
4	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果及恢复交易和申购、赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 14 日
5	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 28 日
6	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 02 月 11 日
7	关于增加华宝证券为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 03 月 13 日
8	关于嘉实沪深 300ETF 流动性服务商的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 04 月 01 日
9	关于增加广州证券为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回	证券时报、管理人网站	2019 年 05 月 31 日

	回代理券商的公告		
10	关于增加国盛证券为嘉实旗下基金申购赎回代理券商的公告	证券时报、管理人网站	2019年06月26日
11	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停场内现金申购业务的公告	证券时报、管理人网站	2019年08月27日
12	关于增加德邦证券为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	证券时报、管理人网站	2019年09月27日
13	关于嘉实沪深 300ETF 开通场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎业务并修改基金合同的公告	证券时报、管理人网站	2019年10月16日
14	关于嘉实沪深 300ETF 更新招募说明书的更正公告	证券时报、管理人网站	2019年10月19日
15	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金“深市股票实物申赎、沪市股票现金替代”模式下增加申购赎回代理券商的公告	证券时报、管理人网站	2019年10月21日
16	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、管理人网站	2019年11月05日
17	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、管理人网站	2019年11月06日
18	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、管理人网站	2019年11月18日

## § 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	2019/01/01 至 2019/12/31	4,725,237,402.00	7,279,926,852.00	7,513,781,062.00	4,491,383,192.00	68.72

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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (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公告的各项原稿。

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2020 年 04 月 08 日