

# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金（LOF）2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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）。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品情况

基金简称	嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)
场内简称	嘉实 300
交易代码	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
报告期末基金份额总额	16,773,799,396.48 份
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	95%的沪深 300 指数增长率加 5%的银行活期存款税后利率。
风险收益特征	风险中等，获得证券市场平均收益率。
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

### 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

### 2.1.2 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。

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	171,052,587.94
2. 本期利润	695,765,190.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0404

4. 期末基金资产净值	15,562,209,345.49
5. 期末基金份额净值	0.9278

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。

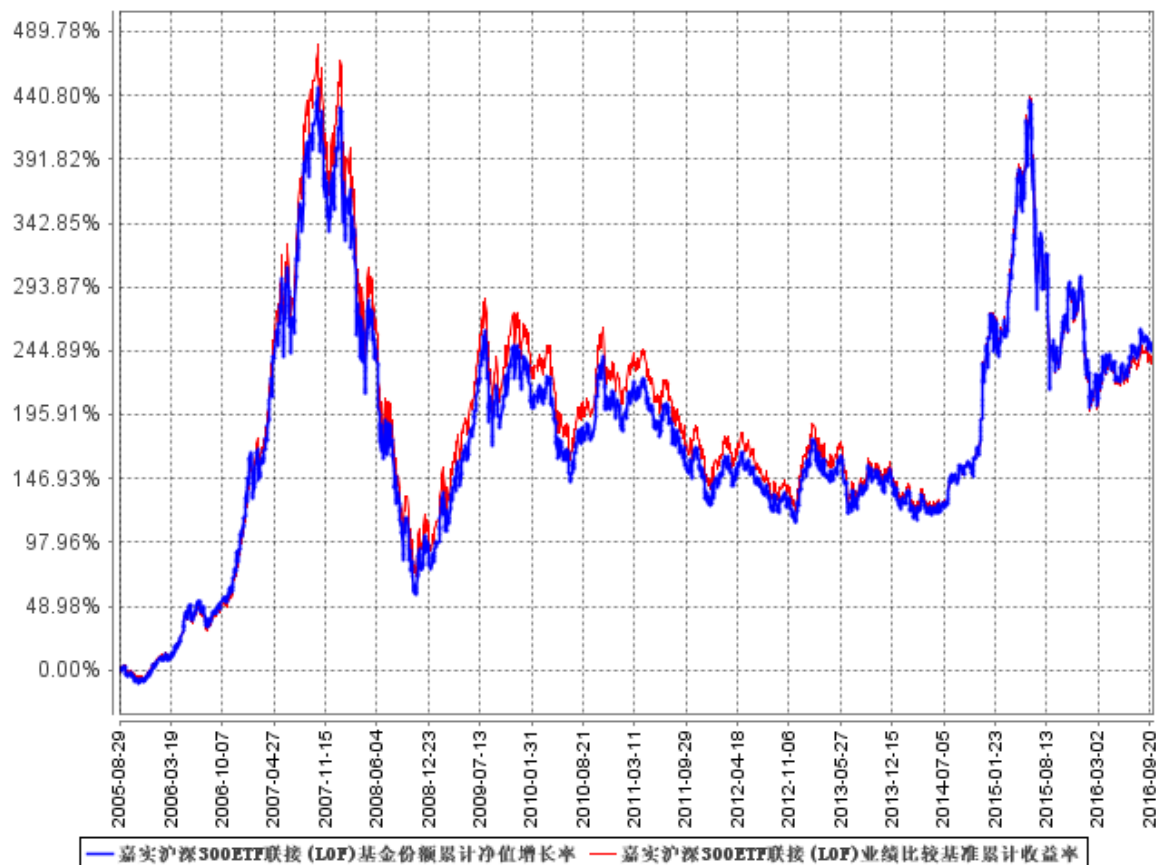
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	4.35%	0.76%	3.00%	0.76%	1.35%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



图：嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率

## 的历史走势对比图

(2005 年 8 月 29 日至 2016 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 及其联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	10 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 及其联接、	2016 年 1 月 5 日	-	11 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

	嘉实中创 400ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理			嘉实基金管理有限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 中国台湾籍。
--	---	--	--	--

注: (1) 任职日期、离职日期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 公平交易专项说明

### 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 1 次, 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 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 0.05%, 年化跟踪误差为 0.74%, 符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.3% 的限制。

本基金为目标 ETF 的联接基金, 主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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，进一步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。

#### 4.5 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 0.9278 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.35%，业绩比较基准收益率为 3.00%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	326,431,794.44	2.10
	其中：股票	326,431,794.44	2.10
2	基金投资	14,186,128,495.90	91.07
3	固定收益投资	130,035,000.00	0.83
	其中：债券	130,035,000.00	0.83
	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	100,000,000.00	0.64
	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	779,131,831.53	5.00
8	其他资产	55,569,745.02	0.36
9	合计	15,577,296,866.89	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	241,900.00	0.00
B	采矿业	10,018,331.70	0.06
C	制造业	114,581,432.72	0.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,965,995.24	0.08

E	建筑业	10,603,289.89	0.07
F	批发和零售业	6,542,992.83	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	9,245,137.89	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,745,291.17	0.12
J	金融业	109,583,083.42	0.70
K	房地产业	21,179,947.30	0.14
L	租赁和商务服务业	3,668,552.64	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,344,177.26	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	478,952.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,267,934.38	0.03
S	综合	1,964,776.00	0.01
	合计	326,431,794.44	2.10

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	377,976	12,911,660.16	0.08
2	600016	民生银行	824,600	7,635,796.00	0.05
3	601166	兴业银行	465,100	7,427,647.00	0.05
4	000002	万科A	271,600	7,107,772.00	0.05
5	600036	招商银行	359,744	6,475,392.00	0.04
6	000538	云南白药	82,000	5,676,860.00	0.04
7	601328	交通银行	958,500	5,300,505.00	0.03
8	600519	贵州茅台	17,489	5,210,147.99	0.03
9	600019	宝钢股份	925,000	5,041,250.00	0.03
10	600000	浦发银行	301,579	4,973,037.71	0.03

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-



3	金融债券	130,035,000.00	0.84
	其中：政策性金融债	130,035,000.00	0.84
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	130,035,000.00	0.84

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160401	16 农发 01	700,000	70,035,000.00	0.45
2	160209	16 国开 09	600,000	60,000,000.00	0.39

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

### 5.9 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	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	14,186,128,495.90	91.16

### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.10.1 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
----	----	----------	---------	-----------	------

IF1610	沪深 300 股指期货 IF1610 合约	135	131,519,700.00	-32,855.23	-
IF1611	沪深 300 股指期货 IF1611 合约	9	8,694,540.00	68,940.00	-
IF1612	沪深 300 股指期货 IF1612 合约	113	108,330,840.00	-1,764,420.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-1,728,335.23
股指期货投资本期收益 (元)					2,173,655.23
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-1,880,375.23

### 5.10.2 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、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。

### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 5.12 投资组合报告附注

#### 5.12.1

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。

#### 5.12.2

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。

#### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	50,920,663.70
2	应收证券清算款	55,754.52
3	应收股利	-

4	应收利息	2,229,819.59
5	应收申购款	2,363,507.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,569,745.02

#### 5.12.4 报告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。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000538	云南白药	5,676,860.00	0.04	重大事项停牌
2	600019	宝钢股份	5,041,250.00	0.03	重大事项停牌

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	18,199,185,063.35
报告期期间基金总申购份额	426,525,499.99
减：报告期期间基金总赎回份额	1,851,911,166.86
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	16,773,799,396.48

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,163,306.45
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,163,306.45
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.05

注：报告期内，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。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，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。

## §8 备查文件目录

### 8.1 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。

### 8.2 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

### 8.3 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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2016 年 10 月 25 日