嘉实服务增值行业证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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2018年10月23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。

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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实服务增值行业混合
基金主代码	070006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月1日
报告期末基金份额总额	315,124,430.74份
投资目标	在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准,在追求长期稳定增长的抑时不放弃短期收益。
投资策略	在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例,调整期间利调整范围。同时,根据今后的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票,获取稳定的长期回报。
业绩比较基准	沪深300×80%+中债总指数×20%
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金
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

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-26,510,675.06
2.本期利润	-50,190,810.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1582
4.期末基金资产净值	1,506,975,101.33
5.期末基金份额净值	4.782

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。

3.2 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	-3.18%	1.48%	-1.35%	1.08%	-1.83%	0.40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

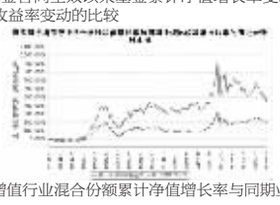

图:嘉实服务增值行业混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年4月1日至2018年9月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6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第十八条((二)投资范围和(六)投资组合比例限制)的约定:(1)在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围:股票资产25%-95%;债券资产0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中,基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的80%。(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%。(3)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%。(4)法律法规规定的其他限制。

§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		
李帅	本基金、嘉实低价策略股票基金经理	2017年11月23日	-	9年	2009年7月加入嘉实基金,先后负责A股汽车行业、海外市场投资品、A股机械行业研究,历任周期组组长、基金经理助理、暂在中信产业基金任制造业高级研究员。

注:(1)任职日期、离任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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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、《嘉实服务增值行业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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

在内部紧信用和去杠杆叠加外部贸易战的背景下,三季度市场如期平淡。我们的策略为均衡配置、降低换手率来进行防御。三季度经济基本面上,除了地产数据暂时较强,基建、制造业投资、消费、出口都面临着较大的减速压力;物价整体温和,但随着原油价格上涨和养殖疫病频发等因素,后期物价可能面临较大压力。因此短期面临的是一个类滞涨的组合。流动性上,货币政策体现为中性,但考虑到未来物价和汇率的约束,松的空间有限;财政政策体现出积极的意愿,但落地效果有待观察。企业盈利上,除了周期品和军工等行业二季报盈利增长加速,中小板企业盈利增速整体下滑,尾部风险较大。三季度上证50明显强于创业板也是对这一事实的体现。往后看,我们认为随着地产端的严控,周期品的高盈利能力和盈利增长难以持续。整体上,短期我们所经历的金融周期叠加经济周期的客观周期波动,我们维持对中期谨慎的态度,预计几个季度之后,在市场见到了估值底、政策底、流动性底之后会出现较大反弹,我们维持长期看好中国经济。

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4.782元;本报告期基金份额净值增长率为-3.18%,业绩比较基准收益率为-1.35%。

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	1,399,986,366.53	92.66
	其中:股票	1,399,986,366.53	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,056,000.00	5.30
	其中:债券	80,056,000.00	5.30
	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	27,503,108.22	1.82
8	其他资产	3,339,557.21	0.22
9	合计	1,510,885,031.96	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	460,672,459.44	30.57
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	105,248,530.70	6.98
G	交通运输、仓储和邮政业	38,973,428.49	2.59
H	住宿和餐饮业	20,247,833.25	1.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,404,461.49	11.51
J	金融业	378,112,299.04	25.09
K	房地产业	104,920,000.00	6.96
L	租赁和商务服务业	58,719,102.12	3.90
M	科学研究和技术服务业	48,944,252.00	3.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,744,000.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,399,986,366.53	92.90

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	1,500,068	102,754,658.00	6.82
2	600036	招商银行	3,000,040	92,071,227.60	6.11
3	600887	伊利股份	3,000,000	77,040,000.00	5.11
4	601336	新华保险	1,500,028	75,721,413.44	5.02
5	603345	安井食品	1,499,868	59,724,743.76	3.96
6	002027	分众传媒	6,900,012	58,719,102.12	3.90
7	601939	建设银行	7,500,000	54,300,000.00	3.60
8	601601	中国太保	1,500,000	53,265,000.00	3.53
9	600809	山西汾酒	1,000,000	47,290,000.00	3.14
10	300036	超图软件	1,999,902	44,297,829.30	2.94

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	80,056,000.00	5.31
	其中:政策性金融债	80,056,000.00	5.31
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	80,056,000.00	5.31

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	170211	17国开11	800,000	80,056,000.00	5.31

注:报告期末,本基金仅持有上述1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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金投资于"招商银行(600036)"的决策程序说明:基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断,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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	355,727.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,908,704.42
5	应收申购款	75,124.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,339,557.21

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	319,861,551.29
报告期期间基金总申购份额	2,224,474.08
减:报告期期间基金总赎回份额	6,961,594.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	315,124,430.74

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

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) 中国证监会批准嘉实服务增值行业证券投资基金设立的文件;

(2)《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实服务增值行业证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实服务增值行业证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6) 报告期内嘉实服务增值行业证券投资基金公告的各项原稿。

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
2018年10月26日

嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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2018年10月23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。

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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	5,025,706,477.00份
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。
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

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	150,847,469.71
2.本期利润	-40,347,951.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0090
4.期末基金资产净值	19,201,994,786.55
5.期末基金份额净值	3.8208

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	-1.01%	1.36%	-2.06%	1.36%	1.04%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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

(2012年5月7日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同"十五(二)投资范围和(八)2、基金投资组合比例限制"的有关约定。

§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		
陈元宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证500ETF联接A、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	-	13年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	-	12年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc.)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部。现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)任职日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

在内部紧信用和去杠杆叠加外部贸易战的背景下,三季度市场如期平淡。我们的策略为均衡配置、降低换手率来进行防御。三季度经济基本面上,除了地产数据暂时较强,基建、制造业投资、消费、出口都面临着较大的减速压力;物价整体温和,但随着原油价格上涨和养殖疫病频发等因素,后期物价可能面临较大压力。因此短期面临的是一个类滞涨的组合。流动性上,货币政策体现为中性,但考虑到未来物价和汇率的约束,松的空间有限;财政政策体现出积极的意愿,但落地效果有待观察。企业盈利上,除了周期品和军工等行业二季报盈利增长加速,中小板企业盈利增速整体下滑,尾部风险较大。三季度上证50明显强于创业板也是对这一事实的体现。往后看,我们认为随着地产端的严控,周期品的高盈利能力和盈利增长难以持续。整体上,短期我们所经历的金融周期叠加经济周期的客观周期波动,我们维持对中期谨慎的态度,预计几个季度之后,在市场见到了估值底、政策底、流动性底之后会出现较大反弹,我们维持长期看好中国经济。

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3.8208元;本报告期基金份额净值增长率为-1.01%,业绩比较基准收益率为-2.06%。

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	19,180,400,482.14	99.77
	其中:股票	19,180,400,482.14	99.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	14,000,000.00	0.07
	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	26,393,256.64	0.14
8	其他资产	4,668,889.51	0.02
9	合计	19,225,462,628.29	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	28,568,766.00	0.15
B	采矿业	665,794,369.14	3.47
C	制造业	7,521,123,530.35	39.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,123,591.93	2.82
E	建筑业	671,580,897.54	3.50
F	批发和零售业	356,596,411.46	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	574,223,671.75	2.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	686,236,443.82	3.57
J	金融业	6,645,581,052.40	34.61
K	房地产业	883,260,687.19	4.60
L	租赁和商务服务业	277,759,474.75	1.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	52,197,572.50	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,864,954.65	0.50
R	文化、体育和娱乐业	126,507,071.30	0.66
S	综合	-	-
	合计	19,127,408,494.78	99.61

5.2.2 报告期末积极投资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	13,383,581.18	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,608,423.53	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,992,004.71	0.28

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

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

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	19,869,239	1,361,042,871.50	7.09
2	600519	贵州茅台	921,670	672,819,100.00	3.50
3	600036	招商银行	18,918,815	580,618,432.35	3.02
4	601166	兴业银行	22,862,332	364,654,196.40	1.90
5	000651	格力电器	8,827,208	354,853,761.60	1.85
6	600016	民生银行	52,035,978	329,908,100.52	1.72
7	000333	美的集团	7,753,851	312,480,195.30	1.63
8	601328	交通银行	50,395,926	294,312,207.84	1.53
9	600887	伊利股份	11,149,150	286,310,172.00	1.49
10	601288	农业银行	70,266,997	273,338,618.33	1.42

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600485	信威集团	2,708,581	39,518,196.79	0.21
2	601118	海南橡胶	2,021,689	13,383,581.18	0.07
3	002937	兴瑞科技	2,114	36,593.34	0.00
4	300749	顶固集创	1,316	30,833.88	0.00
5	300748	金力永磁	2,007	22,799.52	0.00

注:信威集团、海南橡胶2只股票已被调出指数成分股,因停牌等原因暂无法卖出。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

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

2018年3月16日,中国人民银行发布银支付罚决字【2018】1号,对中国民生银行股份有限公司厦门分行(新兴支付清算中心),违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,于2018年3月14日作出行政处罚决定,给予警告,没收违法所得48,418,193.27元,并处罚款114,639,752.47元,合计处罚金额163,057,945.74元。

2018年8月1日,中国人民银行发布银反洗罚决字【2018】1号-5号,于2018年7月26日作出行政处罚决定,对交通银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项规定,处以50万元罚款;未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(三)项规定,处以40万元罚款;存在与身份不明的客户进行交易的行为,根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(四)项规定,处以40万元罚款;对交通银行合计处以130万元罚款,并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第(一)项、第(三)项和第(四)项规定,对相关责任人共处以8万元罚款。

本基金投资于"招商银行(600036)"、"兴业银行(601166)"、"民生银行(600016)"、"交通银行(601328)"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、兴业银行、民生银行、交通银行为标的指数的成份股,本基金投资于"招商银行"、"兴业银行"、"民生银行"、"交通银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,280,140.72
2	应收证券清算款	2,306,671.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-7,922.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,668,889.51

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000333	美的集团	312,480,195.30	1.63	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	600485	信威集团	39,518,196.79	0.21	重大事项停牌
2	601118	海南橡胶	13,383,581.18	0.07	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	4,182,406,477.00
报告期期间基金总申购份额	880,200,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	36,900,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,025,706,477.00

§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

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)中国证监会准予嘉实智能汽车股票型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实智能汽车股票型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实智能汽车股票型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实智能汽车股票型证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实智能汽车股票型证券投资基金公告的各项原稿。

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
2018年10月26日

嘉实智能汽车股票型证券投资基