

# 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

## 2019年第二季度报告

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

**基金概况**

基金名称:嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)  
基金代码:007969  
基金运作方式:上市开放式基金  
基金合同生效日期:2016年12月16日

**基金的投资目标及策略**

本基金投资于沪深300指数成份股,通过投资于跟踪沪深300指数的交易型开放式指数证券投资基金(ETF),力求取得与标的指数相近的投资回报。本基金的投资范围包括沪深300指数成份股、沪深300ETF、沪深300ETF联接基金、沪深300ETF期权等。

**基金的主要财务指标**

截至2019年6月30日	
资产净值	10,097,706,145.99元
基金份额净值	4.66,107,418.01元

**基金的投资组合**

截至2019年6月30日,本基金资产组合如下:

类别	占比
沪深300ETF	66.84%
沪深300ETF联接基金	28.03%
其他资产	5.13%

**基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

**基金的风险收益特征**

本基金为跟踪沪深300指数的交易型开放式指数证券投资基金联接基金,其风险和收益特征与标的指数相似,属于中高风险的基金品种。

**基金管理人**

嘉实基金管理有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层

# 嘉实活期宝货币市场基金

## 2019年第二季度报告

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

**基金概况**

基金名称:嘉实活期宝货币市场基金  
基金代码:000961  
基金运作方式:契约式开放式  
基金合同生效日期:2015年12月15日

**基金的投资目标及策略**

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括银行存款、债券回购、央行票据、同业存单、短期融资券等,力求实现基金资产的保值增值。

**基金的主要财务指标**

截至2019年6月30日	
资产净值	10,097,706,145.99元
基金份额净值	4.66,107,418.01元

**基金的投资组合**

截至2019年6月30日,本基金资产组合如下:

类别	占比
银行存款	90.50%
债券回购	8.50%
其他资产	1.00%

**基金的风险收益特征**

本基金为货币市场基金,风险等级较低,具有低风险、低收益的特征。

**基金管理人**

嘉实基金管理有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层

# 嘉实价值精选股票型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

**基金概况**

基金名称:嘉实价值精选股票型证券投资基金  
基金代码:000587  
基金运作方式:契约式开放式  
基金合同生效日期:2017年11月16日

**基金的投资目标及策略**

本基金投资于具有良好流动性的股票、债券、货币市场工具等,追求超越业绩比较基准的投资回报。

**基金的主要财务指标**

截至2019年6月30日	
资产净值	10,097,706,145.99元
基金份额净值	4.66,107,418.01元

**基金的投资组合**

截至2019年6月30日,本基金资产组合如下:

类别	占比
股票	75.30%
债券	15.20%
其他资产	9.50%

**基金的风险收益特征**

本基金为股票型基金,风险等级较高,具有高风险、高收益的特征。

**基金管理人**

嘉实基金管理有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区1号写字楼1501层

序号	产品名称	份额(元)
1	货币型基金	6,489,700.00
2	债券型基金	1,334,538.00
3	股票型基金	2,263,806.00
4	其他	6,000,000.00
5	其他	6,946,603.00
6	其他	-
7	其他	-
8	其他	-
9	其他	30,436,354.48

6.1.2 其他产品概况

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

序号	项目	金额(元)	占比(%)
1	权益类资产	66,844,430.00	66.84%
2	固定收益类资产	28,030,000.00	28.03%
3	其他资产	2,831,715.99	2.83%
4	其中:银行存款	-	-
5	其中:债券回购	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:货币市场工具	-	-
8	其中:其他	-	-
9	合计	97,706,145.99	97.70%

6.1 报告期内基金资产组合的投资情况

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

序号	名称	公允价值(元)	占比(%)
1	沪深300ETF	6,684,430.00	66.84%
2	沪深300ETF联接基金	28,030,000.00	28.03%
3	其他资产	2,831,715.99	2.83%
4	其中:银行存款	-	-
5	其中:债券回购	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:货币市场工具	-	-
8	其中:其他	-	-
9	合计	97,706,145.99	97.70%

6.1 报告期内基金资产组合的投资情况

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

序号	名称	公允价值(元)	占比(%)
1	银行理财产品	100,180,236.52	100.18%
2	其他资产	779,034.34	0.77%
3	其他	8,000,000.00	8.00%
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	100,977,036.28	100.98%

6.1 报告期内基金资产组合的投资情况

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。

序号	名称	公允价值(元)	占比(%)
1	国债	2,074,405,386.38	20.74%
2	地方政府债	2,074,405,386.38	20.74%
3	其他	-	-
4	其他	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	其他	1,502,062,176.59	15.02%

6.1 报告期内基金资产组合的投资情况

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

**1.1 重要提示**

嘉实基金管理有限公司(以下简称"管理人"或"基金管理人")经中国证监会核准,取得证券投资基金业务资格。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行受托人义务,确保基金财产的安全,维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不公平的方式从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。基金管理人承诺不以不正当手段谋求基金财产的不当增值,也不从事任何可能导致基金份额持有人利益受损的活动。