

2017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：2017年10月25日

1.1 重要提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员在签署基金定期报告时并不在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，且不存在误导性陈述或重大遗漏。
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2017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摘要。

本报告期中的财务指标未经过审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金简称 嘉实沪深300

基金主代码 159919

基金运作方式 约定净值型开放式

基金经理合同期限 2012年5月7日至2017年5月6日

报告期末基金资产净值 4,365,106,477.00元

投资目标 本基金主要投资于沪深300指数成份股，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 本基金将完全复制标的指数，定期对投资组合进行调整，以保证投资组合与标的指数的表现相一致。本基金将定期对投资组合进行调整，以保证投资组合与标的指数的表现相一致。

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高于股票型基金，低于股票型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于股票，因此预期收益和风险水平高于股票型基金，但低于股票型基金。

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

1.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 225,932,505.96

2.本期利润 983,676,674.43

3.期末可供分配利润 18,358,028.955

4.期末基金资产净值 4,365,106,477.00

5.期末基金份额净值 1.0025

**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）扣减相关费用后的余额，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交易费用，计入费用后实际收益水平将产生差异。
3)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摘要。**

1.4 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.2 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.3 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.4 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.5 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.6 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.7 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.8 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.9 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.10 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.11 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.12 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.13 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.14 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.15 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.16 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.17 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.18 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.19 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.20 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.21 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.22 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.23 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.24 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.25 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.26 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.27 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.28 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.29 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.30 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.31 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.32 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.33 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.34 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.35 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.36 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.37 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.38 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.39 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.40 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.41 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.42 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.43 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.44 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.45 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.46 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.47 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.48 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.49 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.50 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.51 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.52 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.53 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.54 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.55 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.56 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.57 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.58 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.59 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.60 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.61 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.62 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.63 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.64 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.65 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.66 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.67 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.68 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.69 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.70 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.71 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.72 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.73 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.74 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.75 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.76 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.77 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.78 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.79 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.80 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.81 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.82 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.83 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.84 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.85 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.86 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.87 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.88 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.89 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.90 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.91 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.92 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.93 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.94 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.95 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.96 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.97 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.98 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.99 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.10 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.11 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.12 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.13 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.14 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.15 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.16 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.17 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.18 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.19 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.20 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.21 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.22 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.23 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.24 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.25 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.26 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.27 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.28 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.29 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.30 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.31 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.32 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.33 报告期单日基金净值涨跌幅度

5.34 报告期单日基金净值涨跌幅度