

# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2017年第三季度报告

基金名称	基金经理	任职日期	离任日期	基金资产规模	说明
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 (LOF)	王黎敏	2017年11月1日	-	50.12亿元	本基金管理人于2017年11月1日起正式接管本基金，自接管之日起，本基金管理人将严格按照基金合同约定履行管理人职责，并切实维护基金份额持有人的合法权益。
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 (LOF)	王黎敏	2017年11月1日	-	50.12亿元	本基金管理人于2017年11月1日起正式接管本基金，自接管之日起，本基金管理人将严格按照基金合同约定履行管理人职责，并切实维护基金份额持有人的合法权益。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	农林牧渔	49,959,032.7	0.27
B 采矿业	采矿业	566,940,163.3	3.09
C 制造业	制造业	6,286,763,563.7	36.16
D 电力、热力、燃气及生产供应业	公用事业	454,046,097.1	2.47
E 建筑业	建筑业	798,775,316.4	4.35
F 批发和零售业	批发和零售业	385,593,274.9	2.10
G 交通运输、仓储和邮政业	交通运输、仓储和邮政业	627,418,011.87	3.42
H 住宿和餐饮业	住宿和餐饮业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术业	信息传输、软件和信息技术业	928,796,092.9	5.06
J 金融业	金融业	327,884,913.73	1.80
L 房地产业	房地产业	158,974,469.94	0.87
M 科学研究和技术服务业	科学研究和技术服务业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	水利、环境和公共设施管理业	132,487,528.24	0.72
O 居民服务、修理和其他服务业	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	教育	-	-
Q 卫生和社会工作	卫生和社会工作	34,326,868.00	0.19
R 文化、体育和娱乐业	文化、体育和娱乐业	29,919,969.39	0.16
S 综合	综合	76,266,638.30	0.42
合计	合计	18,242,699,309.02	99.38

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	农林牧渔	-	-
B 采矿业	采矿业	38,769,000	0.00
C 制造业	制造业	42,891,471.98	0.23
D 电力、热力、燃气及生产供应业	公用事业	31,089.44	0.00
E 建筑业	建筑业	-	-
F 批发和零售业	批发和零售业	26,364.95	0.00
G 交通运输、仓储和邮政业	交通运输、仓储和邮政业	25,371.91	0.00
H 住宿和餐饮业	住宿和餐饮业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术业	信息传输、软件和信息技术业	17,489.03	0.00
J 金融业	金融业	-	-
K 房地产业	房地产业	-	-
L 房地产业	房地产业	-	-
M 科学研究和技术服务业	科学研究和技术服务业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	教育	-	-
Q 卫生和社会工作	卫生和社会工作	115,299.09	0.00
R 文化、体育和娱乐业	文化、体育和娱乐业	12,765.00	0.00
S 综合	综合	-	-
合计	合计	43,099,860.36	0.23

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	-
8 其他	其他	-	-
9 其他	其他	-	-
10 其他	其他	-	-
合计	合计	18,255,759,169.38	99.68

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	权益投资	18,255,759,169.38	99.68
2 固定收益投资	固定收益投资	18,255,759,169.38	99.68
3 衍生品投资	衍生品投资	-	-
4 其他资产	其他资产	-	-
5 负债	负债	-	-
6 其他	其他	-	-
7 其他	其他	-	