

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

基金经理人: 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: 2019年7月17日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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。
本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2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金托管人报告、基金投资组合报告和投资组合报告的有关内容，并保证复核结果与基金管理人计算结果一致。
本基金经中国证监会2012年1月16日准予注册。基金名称变更为“嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”，变更后的基金代码为160706。

基金的过往业绩并不代表未来的业绩表现。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。

本报告期的财务资料未经审计。

本基金的管理费率为每年1.5%，基金托管费率为每年0.25%。

2.1 基金的基本情况

基金简称 嘉实沪深300ETF联接(LOF)

基金代码 160706

基金运作方式 上市开放式

基金合同生效日 2006年6月21日

报告期末基金份额总额 19,524,273,534.04份

本基金上市开放式基金的管理费率为每年1.5%，基金托管费率为每年0.25%。本基金的管理费和托管费每日计提并按月支付。

投资策略 本基金通过被动式指数化投资，通过严苛的投资纪律和最优化的资产配置，力争在扣除管理费和托管费后，力争实现净值增长率超越沪深300指数收益率2%。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征 风险收益中等，获取市场平均的收益。

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金销售代理人 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 嘉实沪深300ETF联接(LOF)

下属分级基金的场内简称 嘉实300A

下属分级基金的场外简称 嘉实300C

下属分级基金的交易代码 160706

报告期末下属分级基金的份额总额 19,067,706,116.07份

456,507,410.06份

本基金的场外货币市场基金的代码为嘉实300C，不是严格的“场内简称”，而是指本基金在交易所买卖时的外延简称。

2.1.1 基金的基本情况

基金名称 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金代码 160706

基金运作方式 交易型开放式

基金上市的证券交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2012年6月21日

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金销售代理人 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 嘉实沪深300ETF联接(LOF)

下属分级基金的场内简称 嘉实300A

下属分级基金的场外简称 嘉实300C

下属分级基金的交易代码 160706

报告期末下属分级基金的份额总额 19,067,706,116.07份

456,507,410.06份

本基金的场外货币市场基金的代码为嘉实300C，不是严格的“场内简称”，而是指本基金在交易所买卖时的外延简称。

2.1.2 基金的基本情况

基金名称 嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金代码 160706

基金运作方式 交易型开放式

基金上市的证券交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2012年6月21日

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金销售代理人 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 嘉实沪深300ETF联接(LOF)

下属分级基金的场内简称 嘉实300A

下属分级基金的场外简称 嘉实300C

下属分级基金的交易代码 160706

报告期末下属分级基金的份额总额 19,067,706,116.07份

456,507,410.06份

本基金的场外货币市场基金的代码为嘉实300C，不是严格的“场内简称”，而是指本基金在交易所买卖时的外延简称。

2.1.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日) 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

嘉实沪深300ETF联接(LOF) A 嘉实沪深300ETF联接(LOF) C

本期利润 -9,430,489.39 -9,430,489.39

已实现收益 -9,430,489.39 -9,430,489.39

未实现收益 -0,00000 -0,00000

454,507,410.06份 454,507,410.06份

期末可供分配利润 21,009,409,409.42 629,014,913.00

期末可供分配基金份额总额 1,010,500 1,010,500

3.1 主要财务指标

注: 根据中国证监会准予注册的《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金》(基金代码:160706)的《招募说明书》,本基金的管理费率为每年1.5%,基金托管费率为每年0.25%。本基金的管理费和托管费每日计提并按月支付。

本基金的管理费和托管费从基金财产中每日计提,由基金管理人按季支付给基金管理人,由基金托管人按季支付给基金托管人。

3.2 基金报告期每份额可供收益和其同类型业绩比较基准收益的比率

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准 (%) 业绩比较基 准 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.22% 1.6% -1.1% 1.6% 0.08% 0.01%

注: (1)本基金的管理费收入按每季实际天数以单利方式分摊; (2)本基金的托管费收入按每季实际天数以单利方式分摊; (3)本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率。

3.3 报告期末可供分配基金份额总额

注: 本基金的管理费和托管费从基金财产中每日计提,由基金管理人按季支付给基金管理人,由基金托管人按季支付给基金托管人。

3.4 基金合同当事人约定的基金收益分配原则、执行时间、分配对象、收益分配方法

3.5 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.6 基金合同当事人约定的基金收益分配政策

3.7 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.8 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.9 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.10 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.11 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.12 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.13 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.14 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.15 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.16 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.17 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.18 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.19 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.20 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.21 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.22 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.23 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.24 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.25 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.26 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.27 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.28 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.29 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.30 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.31 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.32 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.33 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.34 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.35 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.36 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.37 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.38 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.39 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.40 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.41 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.42 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.43 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.44 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.45 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.46 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.47 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.48 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.49 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.50 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.51 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.52 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.53 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.54 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.55 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.56 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.57 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.58 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.59 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.60 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.61 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.62 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.63 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.64 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.65 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.66 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.67 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.68 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.69 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.70 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.71 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.72 基金合同当事人约定的基金收益分配方案

3.73 基金合同当事人