

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金
2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 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 2021 年 10 月 22 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 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	沪深 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	3,883,716,676.00 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。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
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（2021年7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	301,883,021.23
2. 本期利润	-1,252,283,923.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3244
4. 期末基金资产净值	18,903,568,497.30
5. 期末基金份额净值	4.8674

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

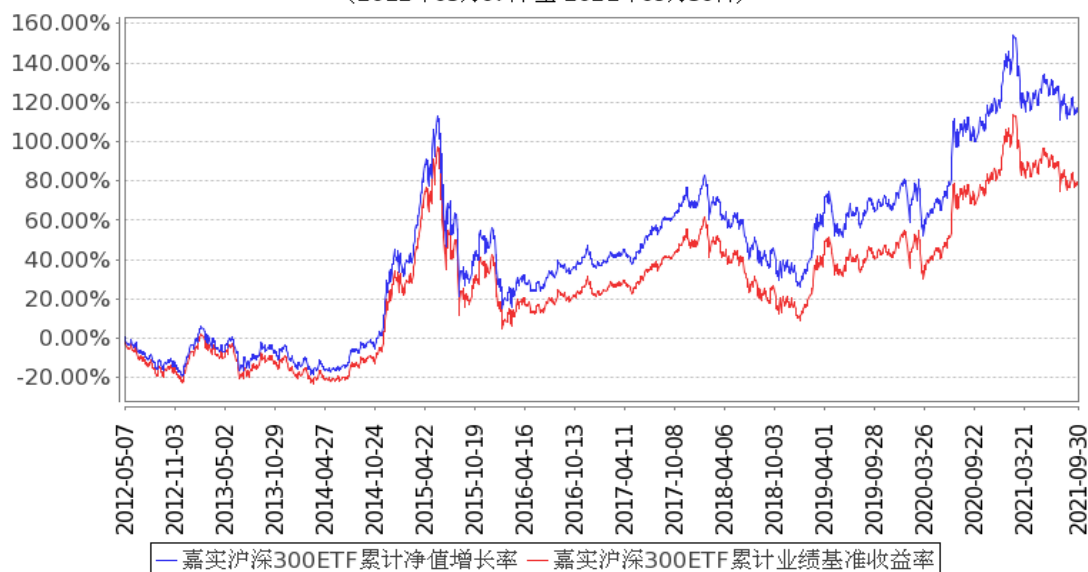
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.03%	1.20%	-6.85%	1.20%	0.82%	0.00%
过去六个月	-1.93%	1.10%	-3.60%	1.10%	1.67%	0.00%
过去一年	7.65%	1.21%	6.08%	1.21%	1.57%	0.00%
过去三年	48.18%	1.35%	41.51%	1.35%	6.67%	0.00%
过去五年	61.29%	1.19%	49.58%	1.20%	11.71%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	116.41%	1.44%	79.18%	1.44%	37.23%	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

嘉实沪深300ETF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05月07日至2021年09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个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
何如	本基金 嘉实沪深300ETF 联接 (LOF)、嘉实H股指数 (QDII-LOF)、嘉实中证500ETF 嘉实中证500ETF 联接基金经理	2016年1月5日	-	15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，现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
刘珈吟	本基金 嘉实沪深300ETF 联接 (LOF)、嘉实H股指数 (QDII-LOF)、	2021年9月24日	-	12年	2009年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实中证主要消费 ETF、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、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实 H 股 50ETF (QDII) 基金经理				
陈正宪	本基金基金经理	2016 年 1 月 5 日	2021 年 9 月 24 日	16 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。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 1 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.46%。

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具。

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 4.8674 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.03%，业绩比较基准收益率为-6.85%。

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	18,714,546,737.70	98.51
	其中：股票	18,714,546,737.70	98.51

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	135,000,000.00	0.71
	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	61,261,786.40	0.32
8	其他资产	87,462,846.43	0.46
9	合计	18,998,271,370.53	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 2,306,206,927.00 元，占基金资产净值的比例为 12.20%。

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境内股票投资组合

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	203,279,655.79	1.08
B	采矿业	466,135,226.74	2.47
C	制造业	10,238,992,538.71	54.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	416,034,015.31	2.20
E	建筑业	300,757,187.33	1.59
F	批发和零售业	118,777,952.59	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	546,015,782.24	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	626,166,113.78	3.31
J	金融业	4,390,023,040.35	23.22
K	房地产业	407,758,583.98	2.16
L	租赁和商务服务业	309,662,371.64	1.64
M	科学研究和技术服务业	360,862,598.60	1.91
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	18,876,266.52	0.10
Q	卫生和社会工作	245,660,198.74	1.30
R	文化、体育和娱乐业	63,293,485.82	0.33
S	综合	-	-
	合计	18,712,295,018.14	98.99

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,183,206.37	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	61,893.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
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	934,637.94	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,045.28	0.00
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	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,249,380.88	0.01

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	600519	贵州茅台	590,946	1,081,431,180.00	5.72
2	600036	招商银行	11,649,386	587,711,523.70	3.11
3	601318	中国平安	10,195,716	493,064,825.76	2.61
4	000858	五粮液	1,826,500	400,715,835.00	2.12
5	601012	隆基股份	4,076,013	336,189,552.24	1.78
6	000333	美的集团	4,641,677	323,060,719.20	1.71
7	300059	东方财富	7,782,187	267,473,767.19	1.41
8	603259	药明康德	1,687,922	257,914,481.60	1.36
9	601166	兴业银行	13,686,732	250,467,195.60	1.32
10	002415	海康威视	4,396,735	241,820,425.00	1.28

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	688131	皓元医药	1,955	654,670.85	0.00
2	688621	阳光诺和	1,485	247,772.25	0.00
3	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.00
4	688766	普冉股份	704	169,896.32	0.00
5	688636	智明达	918	126,013.86	0.00

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2110	IF2110	54	78,832,440.00	599,516.06	-
IF2111	IF2111	10	14,554,800.00	-5,880.00	-
IF2112	IF2112	60	87,073,200.00	22,920.00	-
公允价值变动总额合计（元）					616,556.06

股指期货投资本期收益（元）	-10,474,136.06
股指期货投资本期公允价值变动（元）	168,716.06

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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) 2021年5月21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（银保监罚决字〔2021〕16号），对招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，于2021年5月17日作出行政处罚决定，罚款7170万元。

2021年8月20日，中国人民银行银罚字〔2021〕26号对兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于2021年8月13日作出行政处罚决定，罚款合计5万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”、“兴业银行（601166）”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、兴业银行作为标的指数成份股，本基金投资于“招商银行”、“兴业银行”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，其他八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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	22,937,411.89
2	应收证券清算款	63,979,698.15
3	应收股利	515.00
4	应收利息	545,221.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,462,846.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601318	中国平安	122,582,928.00	0.65	转融通出借证券
2	000858	五粮液	96,794,868.00	0.51	转融通出借证券
3	000333	美的集团	80,311,440.00	0.42	转融通出借证券
4	002415	海康威视	60,115,000.00	0.32	转融通出借证券
5	601012	隆基股份	45,058,824.00	0.24	转融通出借证券
6	601166	兴业银行	12,758,760.00	0.07	转融通出借证券
7	603259	药明康德	7,151,040.00	0.04	转融通出借证券
8	600036	招商银行	1,866,650.00	0.01	转融通出借证券

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	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	----------	--------	--------

			允价值（元）	值比例（%）	说明
1	688131	皓元医药	654,670.85	0.00	新股锁定
2	688621	阳光诺和	247,772.25	0.00	新股锁定
3	688772	珠海冠宇	187,012.80	0.00	新发未上市
4	688766	普冉股份	169,896.32	0.00	新股锁定
5	688636	智明达	126,013.86	0.00	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,340,016,676.00
报告期期间基金总申购份额	895,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,351,800,000.00
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	3,883,716,676.00

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	2021/07/01 至 2021/09/30	2,488,709,018.00	150,700,000.00	242,545,600.00	2,396,863,418.00	61.72

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数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) 报告期内嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

9.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日