

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 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.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 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贵金属投资明细.....	54
7.9 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.....	54
7.10 期末投资目标基金明细.....	54
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.13 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
11.1 备查文件目录.....	61
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实中证 500ETF 联接
基金主代码	000008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	268,773,815.50 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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，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 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%。
风险收益特征	本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的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。

### 2.2.1 目标基金产品说明

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。
业绩比较基准	中证 500 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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		安奎	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	126,373,898.89
本期利润	204,166,595.27
加权平均基金份额本期利润	0.8286
本期加权平均净值利润率	38.59%
本期基金份额净值增长率	61.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	180,863,998.16
期末可供分配基金份额利润	0.6729
期末基金资产净值	640,326,453.18
期末基金份额净值	2.3824
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	138.24%

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-9.77%	3.56%	-10.07%	3.60%	0.30%	-0.04%
过去三个月	20.46%	2.74%	21.70%	2.75%	-1.24%	-0.01%
过去六个月	61.50%	2.16%	63.34%	2.17%	-1.84%	-0.01%
过去一年	113.15%	1.71%	118.28%	1.72%	-5.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	138.24%	1.47%	139.55%	1.51%	-1.31%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95% + 银行活期存款税后利率\*5%。

中证 500 指数由沪深 A 股市场中经营状况良好、价格无异常波动或市场操纵的 500 只股票组成，以调整股本为权数，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

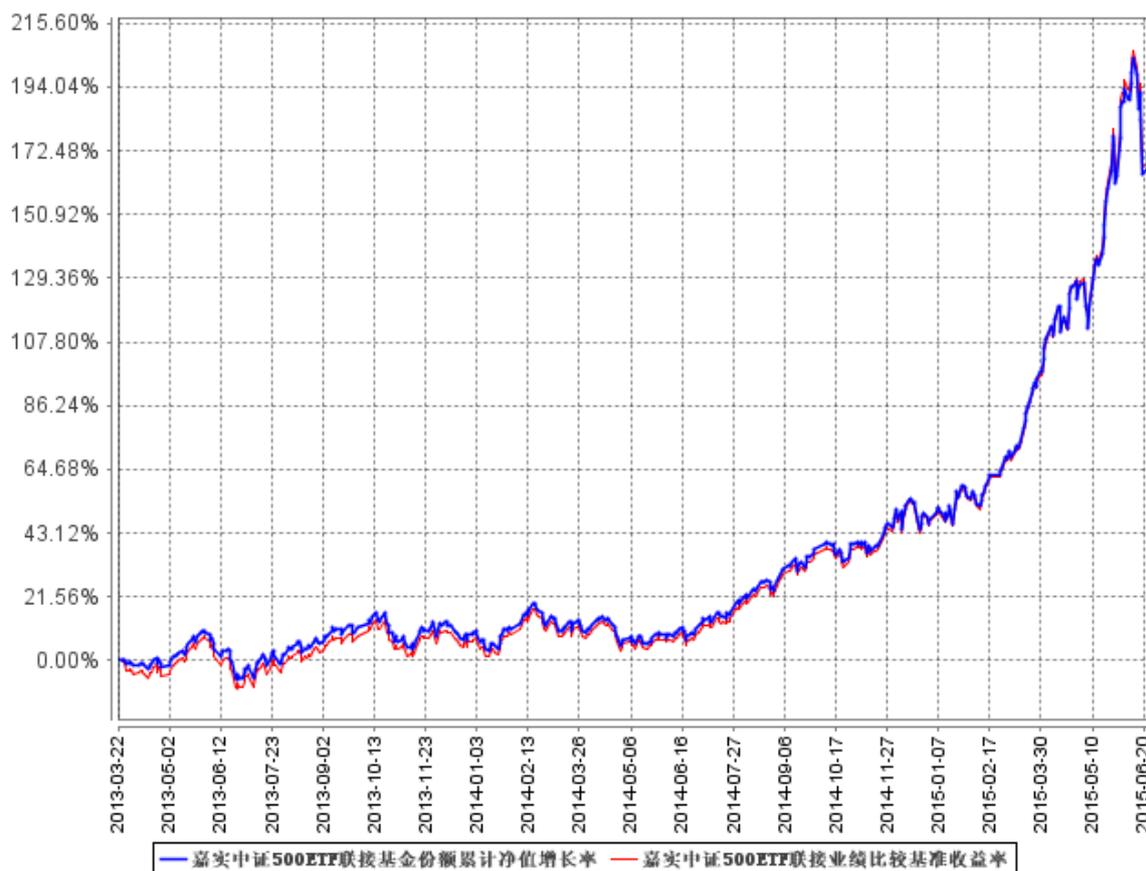
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{中证 500 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实中证500ETF联接基金份额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



图：嘉实中证 500ETF 联接基金份额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  
(2013 年 3 月 22 日至 2015 年 6 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 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、73 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、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 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理，公司指数投资部总监	2013 年 3 月 22 日	-	17 年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家（天同）180 指数基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

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、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 3 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其

他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.05%，年度化拟合偏离度为 0.74%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35%的限制。

##### 4.4.2 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 2.3824 元；本报告期基金份额净值增长率为 61.50%，业绩比较基准收益率为 63.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金将在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化投资管理策略，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，进一步降低基金的跟踪误差，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十六（三）收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	59,298,039.33	16,934,811.10
结算备付金		1,477,188.05	197,202.31
存出保证金		189,586.90	46,379.65
交易性金融资产	6.4.7.2	609,079,088.16	253,649,265.40
其中：股票投资		21,421,286.46	7,841,428.00
基金投资		587,657,801.70	245,807,837.40
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,069,287.86	3,027,849.42
应收利息	6.4.7.5	10,872.10	4,151.20
应收股利		-	-
应收申购款		10,262,745.94	2,906,511.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	278,029.02	211,440.10
资产总计		702,664,837.36	276,977,610.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		61,432,434.13	8,151,535.44
应付管理人报酬		28,115.71	10,390.27
应付托管费		5,623.14	2,078.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	378,762.31	92,112.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债	6.4.7.8	-	-
其他负债		493,448.89	391,415.75
负债合计		62,338,384.18	8,647,532.02
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	268,773,815.50	181,894,326.90
未分配利润	6.4.7.10	371,552,637.68	86,435,751.79
所有者权益合计		640,326,453.18	268,330,078.69
负债和所有者权益总计		702,664,837.36	276,977,610.71

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3824 元，基金份额总额 268,773,815.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015	上年度可比期间 2014年1月1日至
-----	-----	----------------------	-----------------------

		年 6 月 30 日	2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		205,395,686.30	2,108,848.28
1.利息收入		146,021.56	16,671.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	146,021.56	16,671.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		125,899,728.09	1,272,886.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,640,410.34	-146,957.77
基金投资收益	6.4.7.13	118,196,117.20	1,406,891.14
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	63,200.55	12,953.58
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	77,792,696.38	742,043.29
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	1,557,240.27	77,246.50
<b>减：二、费用</b>		1,229,091.03	271,923.24
1. 管理人报酬		112,554.97	14,468.65
2. 托管费		22,511.02	2,893.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	890,852.57	63,781.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	203,172.47	190,779.15
<b>三、利润总额</b>		204,166,595.27	1,836,925.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		204,166,595.27	1,836,925.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	181,894,326.90	86,435,751.79	268,330,078.69

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	204,166,595.27	204,166,595.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	86,879,488.60	80,950,290.62	167,829,779.22
其中: 1. 基金申购款	661,423,293.08	767,296,280.23	1,428,719,573.31
2. 基金赎回款	-574,543,804.48	-686,345,989.61	-1,260,889,794.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	268,773,815.50	371,552,637.68	640,326,453.18
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	62,555,323.84	5,905,975.12	68,461,298.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,836,925.04	1,836,925.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,504,155.11	-88,301.70	2,415,853.41
其中: 1. 基金申购款	58,284,419.53	6,609,331.68	64,893,751.21
2. 基金赎回款	-55,780,264.42	-6,697,633.38	-62,477,897.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	65,059,478.95	7,654,598.46	72,714,077.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

赵学军

基金管理人负责人

王红

主管会计工作负责人

常旭

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监

监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 292,881,567.31 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 292,915,388.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 33,821.52 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。正常情况下,本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 X 95% + 银行活期存款税后利率 X 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	59,298,039.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	59,298,039.33

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,868,184.75	21,421,286.46	553,101.71
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	471,346,708.33	587,657,801.70	116,311,093.37
其他	-	-	-
合计	492,214,893.08	609,079,088.16	116,864,195.08

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,675.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,038.54
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	72.50
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	85.30
合计	10,872.10

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
其他应收款	278,029.02
待摊费用	-
合计	278,029.02

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	378,762.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	378,762.31

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	214,930.40
预提费用	278,518.49
应付指数使用费	-

可退替代款	-
应付替代款	-
其他	-
合计	493,448.89

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	181,894,326.90	181,894,326.90
本期申购	661,423,293.08	661,423,293.08
本期赎回	-574,543,804.48	-574,543,804.48
本期末	268,773,815.50	268,773,815.50

注：申购含转换入，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,284,188.60	52,151,563.19	86,435,751.79
本期利润	126,373,898.89	77,792,696.38	204,166,595.27
本期基金份额交易产生的变动数	20,205,910.67	60,744,379.95	80,950,290.62
其中：基金申购款	258,049,068.94	509,247,211.29	767,296,280.23
基金赎回款	-237,843,158.27	-448,502,831.34	-686,345,989.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	180,863,998.16	190,688,639.52	371,552,637.68

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,905.02
其他	7,051.56
合计	146,021.56

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,215,373.30
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	8,855,783.64
合计	7,640,410.34

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	208,615,612.17
减：卖出股票成本总额	209,830,985.47
买卖股票差价收入	-1,215,373.30

**6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	568,683,810.00
减：现金支付申购款总额	52,451,509.58
减：申购股票成本总额	507,376,516.78
申购差价收入	8,855,783.64

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	453,125,777.66
减：卖出/赎回基金成本总额	334,929,660.46
基金投资收益	118,196,117.20

**6.4.7.14 债券投资收益**

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金无债券投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	63,200.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	63,200.55

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	77,792,696.38
——股票投资	488,007.09
——债券投资	-
——基金投资	77,304,689.29
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	77,792,696.38

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,088,462.80
基金转出费收入	468,777.47
债券认购手续费返还	-
替代损益	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	1,557,240.27

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	890,852.57
银行间市场交易费用	-
合计	890,852.57

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	15,453.98
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	200.00
合计	203,172.47

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“嘉实中证 500ETF”）	本基金是该基金的联接基金

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	112,554.97	14,468.65
其中：支付销售机构的客户维护费	358,196.91	66,745.01

注 1：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬 = （前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值）（若为负数，则取 0） × 0.5% / 当年天数。

注 2：根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	22,511.02	2,893.69

的托管费		
------	--	--

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = (前一日的基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值) (若为负数，则取 0) × 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2015 年 6 月 30 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	59,298,039.33	116,064.98	4,300,043.13	15,870.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2015 年 6 月 30 日），本基金持有 66,912,360 份目标 ETF 基金份额（2014 年 12 月 31 日：46,260,132 份），占其总份额的比例为 56.55%（2014 年 12 月 31 日：66.34%）。

### 6.4.11 利润分配情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015 年 6 月 18 日	2015 年 7 月 2 日	配股未上市	10.46	30.80	330	3,451.80	10,164.00	-

##### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的债券。

##### 6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	重大事项停牌	21.54	-	-	3,000	61,920.71	64,620.00	-
000519	江南红箭	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	26.06	-	-	4,800	125,088.00	125,088.00	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	21.36	2015 年 7 月 14 日	19.22	1,700	33,703.76	36,312.00	-
000566	海南海药	2015 年 6 月 18 日	重大事项停牌	40.76	-	-	1,600	78,576.27	65,216.00	-
000592	平潭发展	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	29.76	2015 年 7 月 14 日	30.00	5,400	191,153.00	160,704.00	-

000650	仁和药业	2015年6月12日	重大事项停牌	17.17	-	-	2,300	35,515.85	39,491.00	-
000669	金鸿能源	2015年5月4日	重大事项停牌	37.72	2015年7月23日	33.95	700	25,241.32	26,404.00	-
000688	建新矿业	2015年6月10日	重大事项停牌	17.07	-	-	4,800	81,936.00	81,936.00	-
000693	华泽钴镍	2015年6月30日	重大事项停牌	20.57	2015年8月18日	22.63	1,100	23,243.00	22,627.00	-
000697	炼石有色	2015年5月18日	重大事项停牌	33.83	-	-	3,200	108,256.00	108,256.00	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项停牌	30.36	2015年7月2日	30.78	3,300	105,666.00	100,188.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项停牌	34.88	-	-	2,900	102,842.99	101,152.00	-
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项停牌	19.13	-	-	4,136	73,513.23	79,121.68	-
000788	北大医药	2015年5月25日	重大事项停牌	20.72	2015年7月21日	18.65	4,800	99,456.00	99,456.00	-
000850	华茂股份	2015年5月7日	重大事项停牌	10.98	-	-	8,000	87,840.00	87,840.00	-
000887	中鼎股份	2015年6月30日	重大事项停牌	24.75	-	-	2,700	68,703.44	66,825.00	-
000979	中弘股份	2015年5月25日	重大事项停牌	6.04	-	-	320	1,677.85	1,932.80	-
000982	中银绒业	2014年8月25日	重大事项停牌	4.64	-	-	9,600	44,544.00	44,544.00	-
001696	宗申动力	2015年6月30日	重大事项停牌	17.25	2015年8月24日	15.53	3,300	58,513.18	56,925.00	-
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	1,400	53,297.66	61,712.00	-

		日	停牌							
002069	獐子岛	2015年 6月1日	重大 事项 停牌	19.76	-	-	3,200	63,232.00	63,232.00	-
002091	江苏 国泰	2015年 6月1日	重大 事项 停牌	26.22	-	-	3,200	83,904.00	83,904.00	-
002106	莱宝 高科	2015年 4月7日	重大 事项 停牌	16.42	-	-	6,400	105,088.00	105,088.00	-
002143	印纪 传媒	2015年 6月30日	重大 事项 停牌	32.01	2015年 7月1日	33.50	1,100	35,236.00	35,211.00	-
002183	怡亚 通	2015年 6月1日	重大 事项 停牌	73.15	-	-	1,400	93,644.34	102,410.00	-
002191	劲嘉 股份	2015年 6月18日	重大 事项 停牌	19.22	-	-	3,600	67,046.90	69,192.00	-
002194	武汉 凡谷	2015年 6月18日	重大 事项 停牌	26.98	2015年 7月24日	24.28	2,100	55,859.34	56,658.00	-
002203	海亮 股份	2015年 4月27日	重大 事项 停牌	12.71	-	-	6,400	81,344.00	81,344.00	-
002223	鱼跃 医疗	2015年 6月25日	重大 事项 停牌	57.75	2015年 7月13日	60.48	2,200	146,080.00	127,050.00	-
002226	江南 化工	2015年 6月8日	重大 事项 停牌	13.18	-	-	400	5,257.66	5,272.00	-
002238	天威 视讯	2015年 6月29日	重大 事项 停牌	23.76	-	-	1,200	29,891.00	28,512.00	-
002242	九阳 股份	2015年 6月15日	重大 事项 停牌	19.45	2015年 7月7日	17.51	4,800	93,360.00	93,360.00	-
002269	美邦 服饰	2015年 5月22日	重大 事项 停牌	11.86	2015年 7月2日	10.67	250	2,513.51	2,965.00	-
002276	万马 股份	2015年 6月30日	重大 事项 停牌	34.15	2015年 7月20日	30.74	200	7,960.70	6,830.00	-
002308	威创	2015年	重大	31.00	-	-	1,300	34,552.72	40,300.00	-

	股份	6月12日	事项停牌							
002309	中利科技	2015年6月2日	重大事项停牌	33.39	2015年7月21日	30.05	3,200	106,848.00	106,848.00	-
002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项停牌	31.15	-	-	4,800	149,520.00	149,520.00	-
002345	潮宏基	2015年5月22日	重大事项停牌	19.58	-	-	4,800	93,984.00	93,984.00	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项停牌	65.52	-	-	1,500	96,739.41	98,280.00	-
002414	高德红外	2015年5月13日	重大事项停牌	39.36	-	-	1,700	64,469.90	66,912.00	-
002461	珠江啤酒	2015年6月4日	重大事项停牌	26.40	2015年7月24日	23.76	3,200	84,480.00	84,480.00	-
002557	洽洽食品	2015年6月29日	重大事项停牌	16.38	2015年8月24日	14.74	2,000	35,477.00	32,760.00	-
002574	明牌珠宝	2015年6月4日	重大事项停牌	22.90	-	-	3,200	73,280.00	73,280.00	-
002662	京威股份	2015年5月15日	重大事项停牌	17.84	2015年8月13日	16.06	3,200	57,088.00	57,088.00	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项停牌	27.70	2015年7月1日	30.00	1,700	48,352.67	47,090.00	-
002727	一心堂	2015年4月13日	重大事项停牌	78.24	2015年8月17日	70.42	1,600	125,184.00	125,184.00	-
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项停牌	56.66	2015年7月20日	68.82	1,300	100,315.77	73,658.00	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项停牌	37.76	2015年7月13日	34.65	3,200	146,126.00	120,832.00	-
600078	澄星股份	2015年6月9日	重大事项停牌	15.23	2015年7月1日	13.71	400	5,794.04	6,092.00	-

600110	中科英华	2015年6月26日	重大事项停牌	13.73	-	-	4,800	58,176.00	65,904.00	-
600175	美都能源	2015年6月29日	重大事项停牌	10.64	2015年7月20日	9.58	11,000	116,296.00	117,040.00	-
600312	平高电气	2015年6月22日	重大事项停牌	22.58	-	-	9,400	219,977.80	212,252.00	-
600333	长春燃气	2015年5月29日	重大事项停牌	11.97	2015年7月9日	10.77	200	2,394.00	2,394.00	-
600335	国机汽车	2015年6月15日	重大事项停牌	27.62	2015年7月21日	34.14	3,200	97,042.00	88,384.00	-
600366	宁波韵升	2015年5月22日	重大事项停牌	35.09	2015年8月12日	31.58	1,500	49,649.15	52,635.00	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项停牌	15.71	2015年8月19日	14.00	2,600	36,927.55	40,846.00	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	重大事项停牌	47.84	2015年7月22日	43.06	1,300	55,284.85	62,192.00	-
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大事项停牌	22.64	2015年7月20日	20.35	6,400	144,896.00	144,896.00	-
600482	风帆股份	2015年5月28日	重大事项停牌	42.38	-	-	100	3,581.20	4,238.00	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	重大事项停牌	29.64	-	-	1,800	51,253.61	53,352.00	-
600587	新华医疗	2015年5月22日	重大事项停牌	58.63	2015年7月3日	52.77	1,150	62,990.54	67,424.50	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	重大事项停牌	16.73	-	-	4,400	74,922.45	73,612.00	-
600645	中源协和	2015年4月27日	重大事项停牌	81.32	-	-	139	10,137.90	11,303.48	-
600654	中安消	2015年6月29日	重大事项	30.91	-	-	5,600	184,905.00	173,096.00	-

		日	停牌							
600702	沱牌 舍得	2015年 6月30 日	重大 事项 停牌	26.11	2015年 8月20 日	28.00	2,300	60,745.00	60,053.00	-
600790	轻纺 城	2015年 5月25 日	重大 事项 停牌	13.38	2015年 8月18 日	12.04	9,600	128,448.00	128,448.00	-
600869	智慧 能源	2015年 5月11 日	重大 事项 停牌	29.14	2015年 8月10 日	21.25	3,200	93,248.00	93,248.00	-
600872	中炬 高新	2015年 4月29 日	重大 事项 停牌	23.17	-	-	4,000	76,655.31	92,680.00	-
600879	航天 电子	2015年 5月15 日	重大 事项 停牌	24.50	-	-	3,000	72,607.92	73,500.00	-
600967	北方 创业	2015年 4月13 日	重大 事项 停牌	17.12	-	-	2,400	41,136.00	41,088.00	-
600978	宜华 木业	2015年 6月19 日	重大 事项 停牌	22.44	-	-	1,800	38,466.67	40,392.00	-
601311	骆驼 股份	2015年 6月18 日	重大 事项 停牌	28.20	2015年 7月15 日	25.38	2,000	56,372.77	56,400.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金

融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人中国建设银行和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用

评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，但投资目标 ETF 基金和标的指数成份股不受此限。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,298,039.33	-	-	-	59,298,039.33
结算备付金	1,477,188.05	-	-	-	1,477,188.05
存出保证金	189,586.90	-	-	-	189,586.90
交易性金融资产	-	-	-	609,079,088.16	609,079,088.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	22,069,287.86	22,069,287.86
应收利息	-	-	-	10,872.10	10,872.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	368,009.22	-	-	9,894,736.72	10,262,745.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	278,029.02	278,029.02
资产总计	61,332,823.50	-	-	641,332,013.86	702,664,837.36
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	61,432,434.13	61,432,434.13
应付管理人报酬	-	-	-	28,115.71	28,115.71
应付托管费	-	-	-	5,623.14	5,623.14

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	378,762.31	378,762.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	493,448.89	493,448.89
负债总计	-	-	-	62,338,384.18	62,338,384.18
利率敏感度缺口	61,332,823.50	-	-	578,993,629.68	640,326,453.18
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,934,811.10	-	-	-	16,934,811.10
结算备付金	197,202.31	-	-	-	197,202.31
存出保证金	46,379.65	-	-	-	46,379.65
交易性金融资产	-	-	-	253,649,265.40	253,649,265.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,027,849.42	3,027,849.42
应收利息	-	-	-	4,151.20	4,151.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	35,262.95	-	-	2,871,248.58	2,906,511.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	211,440.10	211,440.10
资产总计	17,213,656.01	-	-	259,763,954.70	276,977,610.71
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,151,535.44	8,151,535.44
应付管理人报酬	-	-	-	10,390.27	10,390.27
应付托管费	-	-	-	2,078.07	2,078.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	92,112.49	92,112.49
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	391,415.75	391,415.75
负债总计	-	-	-	8,647,532.02	8,647,532.02
利率敏感度缺口	17,213,656.01	-	-	251,116,422.68	268,330,078.69

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：目标 ETF 资产比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	21,421,286.46	3.35	7,841,428.00	2.92

交易性金融资产—基金投资	587,657,801.70	91.77	245,807,837.40	91.61
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	609,079,088.16	95.12	253,649,265.40	94.53

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	31,757,091.92	13,253,912.45
	业绩比较基准下降 5%	-31,757,091.92	-13,253,912.45

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 603,856,023.70 元，属于第二层级的余额为 5,223,064.46 元，无属于第三层级的余额（2014 年 12 月 31 日：第一层级 252,505,968.40 元，第二层级 1,143,297.00 元，无属于第三层级的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.4)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,421,286.46	3.05
	其中：股票	21,421,286.46	3.05
2	基金投资	587,657,801.70	83.63
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	-	-
	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	60,775,227.38	8.65

8	其他各项资产	32,810,521.82	4.67
	合计	702,664,837.36	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	437,685.00	0.07
B	采矿业	676,264.00	0.11
C	制造业	12,727,763.18	1.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	602,454.00	0.09
E	建筑业	537,471.00	0.08
F	批发和零售业	1,574,361.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	626,238.00	0.10
H	住宿和餐饮业	29,800.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,164,107.00	0.18
J	金融业	176,482.00	0.03
K	房地产业	1,418,164.80	0.22
L	租赁和商务服务业	591,906.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	46,923.48	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	113,940.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,970.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	429,433.00	0.07
S	综合	226,324.00	0.04
	合计	21,421,286.46	3.35

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600312	平高电气	9,400	212,252.00	0.03
2	600654	中安消	5,600	173,096.00	0.03

3	000592	平潭发展	5,400	160,704.00	0.03
4	002325	洪涛股份	4,800	149,520.00	0.02
5	600416	湘电股份	6,400	144,896.00	0.02
6	300147	香雪制药	4,230	130,284.00	0.02
7	600790	轻纺城	9,600	128,448.00	0.02
8	002223	鱼跃医疗	2,200	127,050.00	0.02
9	002727	一心堂	1,600	125,184.00	0.02
10	000519	江南红箭	4,800	125,088.00	0.02
11	300291	华录百纳	3,200	120,832.00	0.02
12	600175	美都能源	11,000	117,040.00	0.02
13	002405	四维图新	2,500	109,500.00	0.02
14	000697	炼石有色	3,200	108,256.00	0.02
15	002309	中利科技	3,200	106,848.00	0.02
16	002106	莱宝高科	6,400	105,088.00	0.02
17	002183	怡亚通	1,400	102,410.00	0.02
18	000748	长城信息	2,900	101,152.00	0.02
19	000732	泰禾集团	3,300	100,188.00	0.02
20	000788	北大医药	4,800	99,456.00	0.02
21	002368	太极股份	1,500	98,280.00	0.02
22	600037	歌华有线	3,100	97,650.00	0.02
23	600881	亚泰集团	7,600	96,596.00	0.02
24	002345	潮宏基	4,800	93,984.00	0.01
25	002242	九阳股份	4,800	93,360.00	0.01
26	600869	智慧能源	3,200	93,248.00	0.01
27	600872	中炬高新	4,000	92,680.00	0.01
28	600435	北方导航	2,000	90,740.00	0.01
29	600895	张江高科	3,100	90,241.00	0.01
30	000540	中天城投	7,100	89,460.00	0.01
31	600158	中体产业	3,100	88,815.00	0.01
32	600376	首开股份	4,600	88,734.00	0.01
33	002030	达安基因	2,000	88,600.00	0.01
34	600335	国机汽车	3,200	88,384.00	0.01
35	000850	华茂股份	8,000	87,840.00	0.01
36	600594	益佰制药	1,500	87,195.00	0.01
37	300033	同花顺	1,000	85,990.00	0.01
38	002461	珠江啤酒	3,200	84,480.00	0.01
39	000998	隆平高科	3,100	84,010.00	0.01
40	002091	江苏国泰	3,200	83,904.00	0.01
41	600601	方正科技	9,100	82,810.00	0.01

42	000688	建新矿业	4,800	81,936.00	0.01
43	600219	南山铝业	8,100	81,729.00	0.01
44	002203	海亮股份	6,400	81,344.00	0.01
45	600500	中化国际	4,600	80,408.00	0.01
46	600635	大众公用	8,100	79,218.00	0.01
47	000786	北新建材	4,136	79,121.68	0.01
48	600143	金发科技	6,600	78,672.00	0.01
49	002400	省广股份	3,100	78,306.00	0.01
50	300253	卫宁软件	1,500	78,000.00	0.01
51	600021	上海电力	3,600	75,960.00	0.01
52	600816	安信信托	1,500	74,730.00	0.01
53	000012	南玻A	5,600	74,704.00	0.01
54	600320	振华重工	7,100	74,550.00	0.01
55	600079	人福医药	2,000	74,100.00	0.01
56	600525	长园集团	3,600	74,052.00	0.01
57	300144	宋城演艺	1,300	73,658.00	0.01
58	600643	爱建股份	4,400	73,612.00	0.01
59	600879	航天电子	3,000	73,500.00	0.01
59	600200	江苏吴中	2,000	73,500.00	0.01
61	002574	明牌珠宝	3,200	73,280.00	0.01
62	601012	隆基股份	4,600	72,404.00	0.01
63	600026	中海发展	5,600	71,904.00	0.01
64	600201	金宇集团	1,000	71,120.00	0.01
65	600198	大唐电信	2,000	70,880.00	0.01
66	000547	闽福发A	2,600	69,368.00	0.01
67	002191	劲嘉股份	3,600	69,192.00	0.01
68	600811	东方集团	5,600	69,048.00	0.01
69	000031	中粮地产	3,600	68,004.00	0.01
69	600797	浙大网新	3,600	68,004.00	0.01
71	600587	新华医疗	1,150	67,424.50	0.01
72	002414	高德红外	1,700	66,912.00	0.01
73	000887	中鼎股份	2,700	66,825.00	0.01
74	600436	片仔癀	1,000	66,670.00	0.01
75	000997	新大陆	2,500	66,500.00	0.01
76	600787	中储股份	4,100	66,010.00	0.01
77	600110	中科英华	4,800	65,904.00	0.01
78	600655	豫园商城	4,100	65,805.00	0.01
79	000566	海南海药	1,600	65,216.00	0.01
80	002701	奥瑞金	2,500	65,075.00	0.01

81	000661	长春高新	500	65,000.00	0.01
82	300199	翰宇药业	2,000	64,660.00	0.01
83	000066	长城电脑	3,000	64,620.00	0.01
84	000690	宝新能源	5,100	64,515.00	0.01
85	002022	科华生物	1,500	63,990.00	0.01
86	600651	飞乐音响	3,100	63,767.00	0.01
87	600675	中华企业	5,600	63,336.00	0.01
88	000616	海航投资	6,100	63,318.00	0.01
89	002069	獐子岛	3,200	63,232.00	0.01
90	600169	太原重工	7,100	63,190.00	0.01
91	002266	浙富控股	4,600	62,928.00	0.01
92	002424	贵州百灵	1,000	62,560.00	0.01
93	600521	华海药业	2,000	62,500.00	0.01
94	600410	华胜天成	1,300	62,192.00	0.01
95	600446	金证股份	500	61,730.00	0.01
96	002018	华信国际	1,400	61,712.00	0.01
97	600770	综艺股份	3,100	60,574.00	0.01
98	600702	沱牌舍得	2,300	60,053.00	0.01
99	002004	华邦颖泰	4,600	59,708.00	0.01
100	600704	物产中大	2,500	59,700.00	0.01
101	300273	和佳股份	2,000	59,580.00	0.01
102	600584	长电科技	3,100	59,241.00	0.01
103	600122	宏图高科	3,600	59,112.00	0.01
104	601608	中信重工	3,600	58,680.00	0.01
105	000930	中粮生化	3,100	58,435.00	0.01
106	600428	中远航运	3,600	58,284.00	0.01
107	002073	软控股份	2,500	57,750.00	0.01
108	600151	航天机电	3,600	57,708.00	0.01
109	000415	渤海租赁	6,100	57,706.00	0.01
110	600755	厦门国贸	5,100	57,324.00	0.01
111	002662	京威股份	3,200	57,088.00	0.01
112	000062	深圳华强	1,000	57,070.00	0.01
113	001696	宗申动力	3,300	56,925.00	0.01
114	600522	中天科技	2,500	56,825.00	0.01
115	002194	武汉凡谷	2,100	56,658.00	0.01
116	002489	浙江永强	1,500	56,550.00	0.01
117	601311	骆驼股份	2,000	56,400.00	0.01
118	000511	烯碳新材	4,600	56,350.00	0.01
119	002250	联化科技	2,500	56,000.00	0.01

120	002013	中航机电	2,000	55,700.00	0.01
121	000006	深振业 A	4,100	55,637.00	0.01
122	600125	铁龙物流	3,600	55,548.00	0.01
123	600664	哈药股份	4,600	55,384.00	0.01
124	600694	大商股份	1,000	55,280.00	0.01
125	600759	洲际油气	3,600	55,008.00	0.01
126	000078	海王生物	2,500	55,000.00	0.01
127	600240	华业资本	3,600	54,936.00	0.01
128	600765	中航重机	2,000	54,860.00	0.01
129	002340	格林美	3,600	54,756.00	0.01
130	002161	远望谷	2,500	54,400.00	0.01
131	600176	中国巨石	2,000	54,120.00	0.01
132	600086	东方金钰	1,000	53,770.00	0.01
133	600685	中船防务	1,000	53,740.00	0.01
134	002285	世联行	2,500	53,600.00	0.01
135	600017	日照港	6,600	53,526.00	0.01
136	000897	津滨发展	5,600	53,424.00	0.01
137	600499	科达洁能	1,800	53,352.00	0.01
138	600498	烽火通信	2,000	52,920.00	0.01
139	600366	宁波韵升	1,500	52,635.00	0.01
140	600528	中铁二局	3,100	51,987.00	0.01
141	000718	苏宁环球	3,600	51,948.00	0.01
142	002573	清新环境	2,500	51,675.00	0.01
143	600611	大众交通	3,100	51,615.00	0.01
144	300267	尔康制药	1,500	51,135.00	0.01
145	600808	马钢股份	9,600	51,072.00	0.01
145	000667	美好集团	7,600	51,072.00	0.01
147	600220	江苏阳光	6,100	50,569.00	0.01
148	300072	三聚环保	1,500	50,550.00	0.01
149	600673	东阳光科	5,100	50,439.00	0.01
150	600511	国药股份	1,000	50,390.00	0.01
151	600835	上海机电	1,500	49,410.00	0.01
152	601000	唐山港	3,600	49,284.00	0.01
153	000758	中色股份	2,500	49,075.00	0.01
154	600058	五矿发展	1,500	49,005.00	0.01
155	600171	上海贝岭	2,000	48,900.00	0.01
156	600056	中国医药	2,000	48,680.00	0.01
157	600517	置信电气	3,100	48,515.00	0.01
158	600426	华鲁恒升	2,600	48,256.00	0.01

159	600880	博瑞传播	3,100	48,143.00	0.01
160	002315	焦点科技	500	48,000.00	0.01
160	002049	同方国芯	1,000	48,000.00	0.01
162	600433	冠豪高新	3,100	47,709.00	0.01
163	600187	国中水务	6,100	47,580.00	0.01
164	000021	深科技	3,100	47,275.00	0.01
165	002665	首航节能	1,700	47,090.00	0.01
166	002005	德豪润达	4,100	47,068.00	0.01
167	002428	云南锗业	2,000	47,020.00	0.01
168	002063	远光软件	1,500	46,905.00	0.01
169	002174	游族网络	500	46,380.00	0.01
170	600409	三友化工	4,100	46,330.00	0.01
171	300274	阳光电源	1,500	45,855.00	0.01
172	600006	东风汽车	3,600	45,648.00	0.01
173	000656	金科股份	6,600	45,606.00	0.01
174	000939	凯迪电力	3,100	45,415.00	0.01
175	600325	华发股份	2,500	45,250.00	0.01
176	600614	鼎立股份	1,500	44,820.00	0.01
177	600580	卧龙电气	2,500	44,575.00	0.01
178	000982	中银绒业	9,600	44,544.00	0.01
179	000988	华工科技	2,500	44,525.00	0.01
180	002219	恒康医疗	1,000	44,460.00	0.01
181	000685	中山公用	1,500	44,145.00	0.01
182	000088	盐田港	3,100	43,896.00	0.01
183	600270	外运发展	1,500	43,740.00	0.01
184	600812	华北制药	3,600	43,704.00	0.01
185	600418	江淮汽车	3,100	43,648.00	0.01
186	000933	神火股份	4,600	43,332.00	0.01
187	603019	中科曙光	500	43,295.00	0.01
188	002595	豪迈科技	2,000	43,160.00	0.01
189	600478	科力远	2,500	42,550.00	0.01
190	600138	中青旅	2,000	42,240.00	0.01
191	002029	七匹狼	2,000	42,000.00	0.01
192	300244	迪安诊断	500	41,970.00	0.01
193	002092	中泰化学	4,100	41,779.00	0.01
193	600183	生益科技	4,100	41,779.00	0.01
195	600557	康缘药业	1,500	41,745.00	0.01
196	000652	泰达股份	4,100	41,738.00	0.01
197	000671	阳光城	2,000	41,560.00	0.01

197	002195	二三四五	1,000	41,560.00	0.01
199	300088	长信科技	1,500	41,250.00	0.01
200	600967	北方创业	2,400	41,088.00	0.01
201	000681	视觉中国	1,000	41,060.00	0.01
202	600395	盘江股份	2,600	40,846.00	0.01
203	000830	鲁西化工	4,100	40,836.00	0.01
204	600284	浦东建设	2,500	40,775.00	0.01
205	600067	冠城大通	4,100	40,672.00	0.01
206	002299	圣农发展	2,000	40,600.00	0.01
207	300202	聚龙股份	1,000	40,400.00	0.01
208	600978	宜华木业	1,800	40,392.00	0.01
209	002308	威创股份	1,300	40,300.00	0.01
210	600289	亿阳信通	2,000	39,860.00	0.01
211	600039	四川路桥	6,100	39,833.00	0.01
212	600160	巨化股份	3,600	39,672.00	0.01
213	000650	仁和药业	2,300	39,491.00	0.01
214	600851	海欣股份	3,100	39,246.00	0.01
215	600062	华润双鹤	1,500	39,060.00	0.01
216	600064	南京高科	2,000	39,000.00	0.01
217	002168	深圳惠程	2,500	38,800.00	0.01
218	600826	兰生股份	1,000	38,630.00	0.01
219	000829	天音控股	2,600	38,610.00	0.01
220	000572	海马汽车	4,600	38,594.00	0.01
221	002271	东方雨虹	1,500	38,550.00	0.01
222	002155	湖南黄金	3,100	38,533.00	0.01
223	002508	老板电器	1,000	38,360.00	0.01
224	600699	均胜电子	1,000	38,310.00	0.01
225	600380	健康元	2,500	37,900.00	0.01
226	600161	天坛生物	1,000	37,660.00	0.01
227	600458	时代新材	1,500	37,650.00	0.01
227	603766	隆鑫通用	1,500	37,650.00	0.01
229	600267	海正药业	2,000	37,580.00	0.01
230	000028	国药一致	500	37,255.00	0.01
231	000816	智慧农业	3,600	37,224.00	0.01
232	000973	佛塑科技	3,100	37,200.00	0.01
233	002444	巨星科技	2,000	36,960.00	0.01
234	600422	昆药集团	1,000	36,930.00	0.01
235	002244	滨江集团	2,000	36,820.00	0.01
236	600487	亨通光电	1,000	36,800.00	0.01

237	000550	江铃汽车	1,000	36,700.00	0.01
238	000528	柳 工	3,100	36,642.00	0.01
239	002251	步 步 高	1,500	36,600.00	0.01
240	600300	维维股份	3,600	36,540.00	0.01
241	000848	承德露露	2,000	36,400.00	0.01
242	000090	天健集团	1,500	36,375.00	0.01
243	000680	山推股份	4,100	36,367.00	0.01
244	000543	皖能电力	1,700	36,312.00	0.01
245	002440	闰土股份	1,500	35,955.00	0.01
246	600481	双良节能	1,500	35,925.00	0.01
247	002390	信邦制药	2,000	35,760.00	0.01
248	002050	三花股份	3,100	35,619.00	0.01
249	000541	佛山照明	3,100	35,557.00	0.01
250	600536	中国软件	1,000	35,480.00	0.01
251	600736	苏州高新	3,100	35,309.00	0.01
252	000926	福星股份	2,500	35,275.00	0.01
253	002143	印纪传媒	1,100	35,211.00	0.01
254	600546	山煤国际	4,100	34,891.00	0.01
255	600298	安琪酵母	1,000	34,780.00	0.01
256	600757	长江传媒	2,500	34,750.00	0.01
257	000587	金叶珠宝	1,500	34,695.00	0.01
258	002311	海大集团	2,500	34,475.00	0.01
259	000975	银泰资源	2,000	34,460.00	0.01
260	000620	新华联	2,500	34,050.00	0.01
260	600572	康恩贝	1,500	34,050.00	0.01
262	000513	丽珠集团	500	33,915.00	0.01
263	600120	浙江东方	1,000	33,890.00	0.01
264	000612	焦作万方	3,100	33,852.00	0.01
265	600351	亚宝药业	2,500	33,850.00	0.01
266	000735	罗 牛 山	3,600	33,804.00	0.01
267	600004	白云机场	2,000	33,800.00	0.01
268	600761	安徽合力	2,000	33,460.00	0.01
269	300115	长盈精密	1,000	33,310.00	0.01
270	601001	大同煤业	3,600	33,264.00	0.01
271	000422	湖北宜化	3,600	33,228.00	0.01
272	600216	浙江医药	2,500	33,200.00	0.01
273	600825	新华传媒	2,000	33,180.00	0.01
274	002384	东山精密	1,500	33,165.00	0.01
275	002122	天马股份	3,100	33,015.00	0.01

276	002179	中航光电	1,000	33,000.00	0.01
277	600260	凯乐科技	2,000	32,900.00	0.01
278	000777	中核科技	1,000	32,850.00	0.01
279	002078	太阳纸业	4,100	32,800.00	0.01
280	002557	洽洽食品	2,000	32,760.00	0.01
281	002064	华峰氨纶	3,600	32,652.00	0.01
282	000488	晨鸣纸业	3,600	32,292.00	0.01
283	000861	海印股份	1,500	32,235.00	0.01
284	002358	森源电气	1,500	32,220.00	0.01
285	600729	重庆百货	1,000	32,180.00	0.01
286	002396	星网锐捷	1,000	32,100.00	0.01
287	600993	马应龙	1,000	32,090.00	0.01
288	002093	国脉科技	2,000	32,000.00	0.00
289	000900	现代投资	3,100	31,806.00	0.00
290	002672	东江环保	1,500	31,725.00	0.00
291	601002	晋亿实业	2,000	31,640.00	0.00
292	600859	王府井	1,000	31,500.00	0.00
293	601908	京运通	1,500	31,470.00	0.00
294	600885	宏发股份	1,000	31,340.00	0.00
295	600748	上实发展	2,000	31,300.00	0.00
296	002056	横店东磁	1,000	31,280.00	0.00
297	002273	水晶光电	1,000	31,250.00	0.00
298	603077	和邦股份	1,500	31,200.00	0.00
298	000636	风华高科	2,500	31,200.00	0.00
300	002048	宁波华翔	1,500	31,185.00	0.00
301	300039	上海凯宝	2,000	31,100.00	0.00
302	002466	天齐锂业	500	30,900.00	0.00
303	600059	古越龙山	2,000	30,640.00	0.00
304	600292	中电远达	1,000	30,540.00	0.00
305	601126	四方股份	1,000	30,500.00	0.00
306	002463	沪电股份	3,600	30,060.00	0.00
307	300043	互动娱乐	2,000	30,020.00	0.00
307	600545	新疆城建	2,000	30,020.00	0.00
309	000961	中南建设	1,500	29,955.00	0.00
310	601233	桐昆股份	1,500	29,940.00	0.00
310	600894	广日股份	1,500	29,940.00	0.00
312	002237	恒邦股份	2,500	29,925.00	0.00
313	002221	东华能源	1,000	29,830.00	0.00
314	600754	锦江股份	1,000	29,800.00	0.00

315	601886	江河创建	2,000	29,760.00	0.00
316	601880	大连港	4,100	29,520.00	0.00
317	600566	济川药业	1,000	29,480.00	0.00
318	002181	粤传媒	2,000	29,400.00	0.00
319	000600	建投能源	2,000	29,360.00	0.00
320	600259	广晟有色	500	29,330.00	0.00
321	000877	天山股份	2,500	29,300.00	0.00
322	601369	陕鼓动力	2,500	29,275.00	0.00
323	600261	阳光照明	3,600	29,268.00	0.00
324	600970	中材国际	2,000	29,240.00	0.00
325	002437	誉衡药业	1,000	29,050.00	0.00
326	002431	棕榈园林	1,000	29,020.00	0.00
327	601005	重庆钢铁	5,100	29,019.00	0.00
328	002011	盾安环境	2,000	28,980.00	0.00
329	600640	号百控股	1,000	28,880.00	0.00
330	002477	雏鹰农牧	1,500	28,800.00	0.00
331	000969	安泰科技	2,000	28,760.00	0.00
332	002588	史丹利	1,000	28,750.00	0.00
333	600180	瑞茂通	1,000	28,660.00	0.00
334	600460	士兰微	3,100	28,613.00	0.00
335	600884	杉杉股份	1,000	28,600.00	0.00
336	002642	荣之联	500	28,575.00	0.00
337	002238	天威视讯	1,200	28,512.00	0.00
338	000762	西藏矿业	1,500	28,500.00	0.00
338	600112	天成控股	1,500	28,500.00	0.00
340	002503	搜于特	1,500	28,320.00	0.00
341	600586	金晶科技	4,100	28,208.00	0.00
342	002317	众生药业	1,000	28,190.00	0.00
343	600509	天富能源	2,000	28,140.00	0.00
343	000563	陕国投 A	2,000	28,140.00	0.00
345	000931	中关村	2,000	28,120.00	0.00
346	600195	中牧股份	1,000	28,100.00	0.00
347	300134	大富科技	1,000	27,950.00	0.00
348	600596	新安股份	2,000	27,880.00	0.00
349	601678	滨化股份	3,100	27,807.00	0.00
350	000726	鲁泰 A	2,000	27,800.00	0.00
351	600850	华东电脑	500	27,695.00	0.00
352	600251	冠农股份	2,000	27,660.00	0.00
353	002028	思源电气	1,500	27,600.00	0.00

354	002479	富春环保	1,500	27,525.00	0.00
355	002681	奋达科技	1,000	27,460.00	0.00
356	002482	广田股份	1,000	27,300.00	0.00
357	000099	中信海直	1,500	26,670.00	0.00
358	002041	登海种业	1,500	26,535.00	0.00
359	600720	祁连山	2,500	26,475.00	0.00
360	000669	金鸿能源	700	26,404.00	0.00
361	002698	博实股份	500	26,400.00	0.00
362	600496	精工钢构	3,600	26,316.00	0.00
363	000401	冀东水泥	2,000	26,300.00	0.00
364	601139	深圳燃气	2,500	26,250.00	0.00
365	002025	航天电器	1,000	26,200.00	0.00
366	600456	宝钛股份	1,000	26,070.00	0.00
367	600823	世茂股份	2,000	26,060.00	0.00
368	002332	仙琚制药	1,500	25,980.00	0.00
369	002233	塔牌集团	1,500	25,890.00	0.00
370	600073	上海梅林	2,000	25,880.00	0.00
371	600141	兴发集团	1,500	25,845.00	0.00
372	002277	友阿股份	1,500	25,740.00	0.00
373	002408	齐翔腾达	1,500	25,710.00	0.00
374	002249	大洋电机	2,000	25,640.00	0.00
375	600392	盛和资源	1,000	25,510.00	0.00
376	600874	创业环保	2,000	25,500.00	0.00
377	002190	成飞集成	500	25,495.00	0.00
378	600831	广电网络	1,500	25,455.00	0.00
379	600329	中新药业	1,000	25,190.00	0.00
380	600628	新世界	1,500	25,125.00	0.00
381	603699	纽威股份	1,000	24,990.00	0.00
382	000603	盛达矿业	1,000	24,940.00	0.00
383	600776	东方通信	1,500	24,735.00	0.00
384	002128	露天煤业	1,500	24,720.00	0.00
385	002342	巨力索具	2,600	24,622.00	0.00
386	600425	青松建化	2,500	24,550.00	0.00
387	000417	合肥百货	2,000	24,500.00	0.00
388	603005	晶方科技	500	24,455.00	0.00
389	601010	文峰股份	2,500	24,425.00	0.00
390	000869	张裕 A	500	24,395.00	0.00
391	002480	新筑股份	1,500	24,390.00	0.00
392	600864	哈投股份	1,500	24,300.00	0.00

393	600639	浦东金桥	1,000	24,290.00	0.00
394	002663	普邦园林	2,500	24,250.00	0.00
395	600488	天药股份	2,500	24,225.00	0.00
396	002254	泰和新材	1,500	24,150.00	0.00
397	002281	光迅科技	500	24,040.00	0.00
398	000418	小天鹅 A	1,000	23,900.00	0.00
399	000049	德赛电池	500	23,850.00	0.00
400	601777	力帆股份	1,500	23,685.00	0.00
401	000596	古井贡酒	500	23,340.00	0.00
402	600510	黑牡丹	1,500	23,280.00	0.00
403	002267	陕天然气	1,500	23,235.00	0.00
404	000030	富奥股份	2,000	23,140.00	0.00
405	000860	顺鑫农业	1,000	22,910.00	0.00
406	002393	力生制药	500	22,840.00	0.00
407	601101	昊华能源	2,000	22,800.00	0.00
408	000693	华泽钴镍	1,100	22,627.00	0.00
409	600429	三元股份	2,000	22,580.00	0.00
410	600132	重庆啤酒	1,000	22,520.00	0.00
411	600337	美克家居	1,500	22,410.00	0.00
412	000525	红太阳	1,000	22,370.00	0.00
413	002140	东华科技	1,000	22,360.00	0.00
414	002216	三全食品	1,500	22,050.00	0.00
414	603366	日出东方	1,500	22,050.00	0.00
416	600551	时代出版	1,000	21,710.00	0.00
417	002551	尚荣医疗	500	21,695.00	0.00
418	002373	千方科技	500	21,645.00	0.00
419	002392	北京利尔	2,500	21,600.00	0.00
420	600997	开滦股份	2,500	21,550.00	0.00
421	600199	金种子酒	1,500	21,000.00	0.00
422	603555	贵人鸟	500	20,890.00	0.00
423	600280	中央商场	1,500	20,805.00	0.00
424	600657	信达地产	2,500	20,600.00	0.00
425	000501	鄂武商 A	1,000	20,500.00	0.00
426	002240	威华股份	1,500	20,340.00	0.00
427	600636	三爱富	1,000	20,280.00	0.00
427	002678	珠江钢琴	1,000	20,280.00	0.00
429	000631	顺发恒业	2,500	20,225.00	0.00
430	601515	东风股份	1,000	20,200.00	0.00
431	000823	超声电子	1,500	20,190.00	0.00

432	002204	大连重工	1,500	20,040.00	0.00
433	603899	晨光文具	500	20,030.00	0.00
434	603698	航天工程	500	19,710.00	0.00
435	000919	金陵药业	1,000	19,480.00	0.00
436	600780	通宝能源	2,000	19,420.00	0.00
437	000703	恒逸石化	1,500	19,140.00	0.00
438	002371	七星电子	500	19,000.00	0.00
439	603369	今世缘	500	18,545.00	0.00
440	002327	富安娜	1,500	18,510.00	0.00
441	603169	兰石重装	1,000	18,490.00	0.00
442	600971	恒源煤电	2,000	18,300.00	0.00
442	000921	海信科龙	1,500	18,300.00	0.00
444	600617	国新能源	1,000	18,270.00	0.00
445	002293	罗莱家纺	1,000	18,090.00	0.00
446	600507	方大特钢	2,000	18,080.00	0.00
447	600537	亿晶光电	1,000	17,900.00	0.00
448	600773	西藏城投	1,000	17,610.00	0.00
449	002118	紫鑫药业	1,000	17,300.00	0.00
450	601208	东材科技	1,500	17,130.00	0.00
451	600803	新奥股份	1,000	17,110.00	0.00
452	002419	天虹商场	1,000	17,000.00	0.00
453	000852	江钻股份	500	16,925.00	0.00
454	000426	兴业矿业	1,000	16,510.00	0.00
455	600088	中视传媒	500	16,135.00	0.00
456	600750	江中药业	500	16,095.00	0.00
457	600743	华远地产	2,000	16,060.00	0.00
458	601226	华电重工	1,000	15,910.00	0.00
459	600983	惠而浦	1,000	15,890.00	0.00
460	600389	江山股份	500	15,620.00	0.00
461	603001	奥康国际	500	15,610.00	0.00
462	600563	法拉电子	500	15,475.00	0.00
463	603328	依顿电子	500	15,330.00	0.00
464	002648	卫星石化	1,000	15,140.00	0.00
465	000962	东方钨业	1,000	14,800.00	0.00
466	002646	青青稞酒	500	14,590.00	0.00
467	601801	皖新传媒	500	14,585.00	0.00
468	600397	安源煤业	1,500	14,505.00	0.00
469	000951	中国重汽	500	14,410.00	0.00
470	603188	亚邦股份	500	14,330.00	0.00

471	601999	出版传媒	1,000	14,220.00	0.00
472	002225	濮耐股份	1,500	14,190.00	0.00
473	000552	靖远煤电	1,000	14,100.00	0.00
474	600184	光电股份	500	14,080.00	0.00
475	000780	平庄能源	1,500	13,980.00	0.00
476	600618	氯碱化工	1,000	13,580.00	0.00
477	600403	大有能源	1,500	13,410.00	0.00
478	002430	杭氧股份	1,000	13,220.00	0.00
479	601965	中国汽研	1,000	13,010.00	0.00
480	002275	桂林三金	500	12,780.00	0.00
481	002635	安洁科技	500	12,175.00	0.00
482	002490	山东墨龙	1,000	12,010.00	0.00
483	600468	百利电气	500	11,655.00	0.00
484	600645	中源协和	139	11,303.48	0.00
485	000719	大地传媒	500	11,160.00	0.00
486	000582	北部湾港	500	10,635.00	0.00
487	600801	华新水泥	1,000	10,570.00	0.00
488	600387	海越股份	400	10,208.00	0.00
489	002705	新宝股份	500	9,400.00	0.00
490	002276	万马股份	200	6,830.00	0.00
491	600917	重庆燃气	500	6,320.00	0.00
492	600078	澄星股份	400	6,092.00	0.00
493	002226	江南化工	400	5,272.00	0.00
494	600482	风帆股份	100	4,238.00	0.00
495	002269	美邦服饰	250	2,965.00	0.00
496	600333	长春燃气	200	2,394.00	0.00
497	600737	中粮屯河	100	2,081.00	0.00
498	000979	中弘股份	320	1,932.80	0.00
499	600805	悦达投资	100	1,563.00	0.00
500	601717	郑煤机	100	1,091.00	0.00
501	600747	大连控股	100	793.00	0.00
502	601666	平煤股份	100	757.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	601099	太平洋	4,930,950.49	1.84
2	300059	东方财富	3,759,715.50	1.40
3	600219	南山铝业	3,599,485.00	1.34
4	600601	方正科技	3,371,131.60	1.26
5	300253	卫宁软件	3,166,357.50	1.18
6	600881	亚泰集团	3,043,203.54	1.13
7	300168	万达信息	2,945,034.00	1.10
8	002183	怡亚通	2,924,254.00	1.09
9	600895	张江高科	2,915,222.76	1.09
10	000712	锦龙股份	2,783,600.00	1.04
11	600158	中体产业	2,774,845.32	1.03
12	000748	长城信息	2,773,130.58	1.03
13	600820	隧道股份	2,734,562.00	1.02
14	000540	中天城投	2,695,433.00	1.00
15	600410	华胜天成	2,672,580.00	1.00
16	600635	大众公用	2,656,437.00	0.99
17	002030	达安基因	2,624,357.36	0.98
18	000998	隆平高科	2,599,535.00	0.97
19	600694	大商股份	2,570,493.00	0.96
20	600755	厦门国贸	2,539,934.00	0.95

#### 7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601099	太平洋	1,406,281.24	0.52
2	300059	东方财富	1,371,478.70	0.51
3	600219	南山铝业	1,170,508.72	0.44
4	600601	方正科技	1,128,752.42	0.42
5	600881	亚泰集团	1,097,891.62	0.41
6	600635	大众公用	1,032,671.37	0.38
7	600895	张江高科	1,028,931.89	0.38
8	002030	达安基因	1,028,440.11	0.38
9	600158	中体产业	976,844.61	0.36
10	600525	长园集团	972,024.63	0.36

11	000997	新大陆	952,654.02	0.36
12	300253	卫宁软件	942,984.31	0.35
13	600811	东方集团	940,987.63	0.35
14	600643	爱建股份	935,680.13	0.35
15	600201	金宇集团	906,841.64	0.34
16	600169	太原重工	894,051.37	0.33
17	600037	歌华有线	874,593.06	0.33
18	600435	北方导航	869,390.61	0.32
19	600755	厦门国贸	865,276.38	0.32
20	000998	隆平高科	852,961.62	0.32

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	580,547,280.62
卖出股票收入（成交）总额	208,615,612.17

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.6 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

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

### 7.9 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

报告期末，本基金未持有权证。

### 7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产
----	------	------	------	-----	------	-------

						净值比例 (%)
1	嘉实中证 500ETF	股票型	交易型开 放式	嘉实基金 管理有限 公司	587,657,801.70	91.77

### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

#### 7.13.2

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。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	189,586.90
2	应收证券清算款	22,069,287.86
3	应收股利	-
4	应收利息	10,872.10
5	应收申购款	10,262,745.94
6	其他应收款	278,029.02
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	32,810,521.82

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600312	平高电气	212,252.00	0.03	重大事项停牌
2	600654	中安消	173,096.00	0.03	重大事项停牌
3	000592	平潭发展	160,704.00	0.03	重大事项停牌
4	002325	洪涛股份	149,520.00	0.02	重大事项停牌
5	600416	湘电股份	144,896.00	0.02	重大事项停牌
6	600790	轻纺城	128,448.00	0.02	重大事项停牌
7	002223	鱼跃医疗	127,050.00	0.02	重大事项停牌
8	002727	一心堂	125,184.00	0.02	重大事项停牌
9	000519	江南红箭	125,088.00	0.02	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
29,270	9,182.57	47,483,726.63	17.67%	221,290,088.87	82.33%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	531,444.93	0.20%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2013 年 3 月 22 日 ) 基金份额总额	292, 915, 388. 83
本报告期期初基金份额总额	181, 894, 326. 90
本报告期基金总申购份额	661, 423, 293. 08
减: 本报告期基金总赎回份额	574, 543, 804. 48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	268, 773, 815. 50

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	376,648,931.69	47.73%	263,671.53	47.73%	-
北京高华证券有限责任公司	1	204,339,599.18	25.89%	143,038.66	25.89%	-
华泰证券股份有限公司	1	126,200,992.32	15.99%	88,341.20	15.99%	-
广发证券股份有限公司	2	53,823,873.73	6.82%	37,676.83	6.82%	-
申万宏源证券有限责任公司	1	28,146,044.07	3.57%	19,702.18	3.57%	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	322,030,631.41	100.00%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加江南农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 1 月 21 日
2	关于增加天风证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 1 月 26 日
3	嘉实基金管理有限公司关于对华	中国证券报、上海证	2015 年 2 月 2 日

	夏银行借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易在线支付业务的公告	券报、证券时报、管理人网站	
4	关于增加众禄基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 2 月 10 日
5	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金电话交易申购、赎回单笔最低要求及最低账面份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 2 月 12 日
6	关于对上海银行借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易在线支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 5 日
7	嘉实基金管理有限公司关于在淘宝店铺、京东店铺降低旗下部分开放式基金网上直销申购的单笔最低要求的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 5 日
8	关于增加南海农商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 19 日
9	关于增加中金公司为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 30 日
10	关于增加河北银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加河北银行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 19 日
11	关于增加江苏银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 21 日
12	中国农业银行关于开放式基金网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 6 月 1 日
13	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换及最低账面份额单笔最低要求的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 6 月 25 日
14	嘉实基金管理有限公司关于在直销自有平台（含电话交易）开展转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 6 月 29 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

- (1) 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司
- (2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

### 11.3 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  
2015 年 8 月 29 日