

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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
§5 托管人报告	12
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	54
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
§8 基金份额持有人信息.....	56
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
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	60
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	60
11.3 查阅方式.....	60

§ 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	340,755,253.81 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		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 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		邓红国	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	http://www.jsfund.cn
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,237,934.13
本期利润	-67,144,701.79
加权平均基金份额本期利润	-0.2391
本期加权平均净值利润率	-15.00%
本期基金份额净值增长率	-17.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	219,945,903.12
期末可供分配基金份额利润	0.6455
期末基金资产净值	560,701,156.93
期末基金份额净值	1.6455
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	64.55%

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	3.19%	1.43%	2.82%	1.47%	0.37%	-0.04%
过去三个月	0.07%	1.55%	-0.46%	1.57%	0.53%	-0.02%
过去六个月	-17.02%	2.33%	-18.57%	2.43%	1.55%	-0.10%
过去一年	-30.93%	2.73%	-29.57%	2.77%	-1.36%	-0.04%
过去三年	74.81%	2.00%	84.89%	2.03%	-10.08%	-0.03%

自基金合同 生效起至今	64.55%	1.95%	68.71%	1.98%	-4.16%	-0.03%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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：

Benchmark(0)=1000

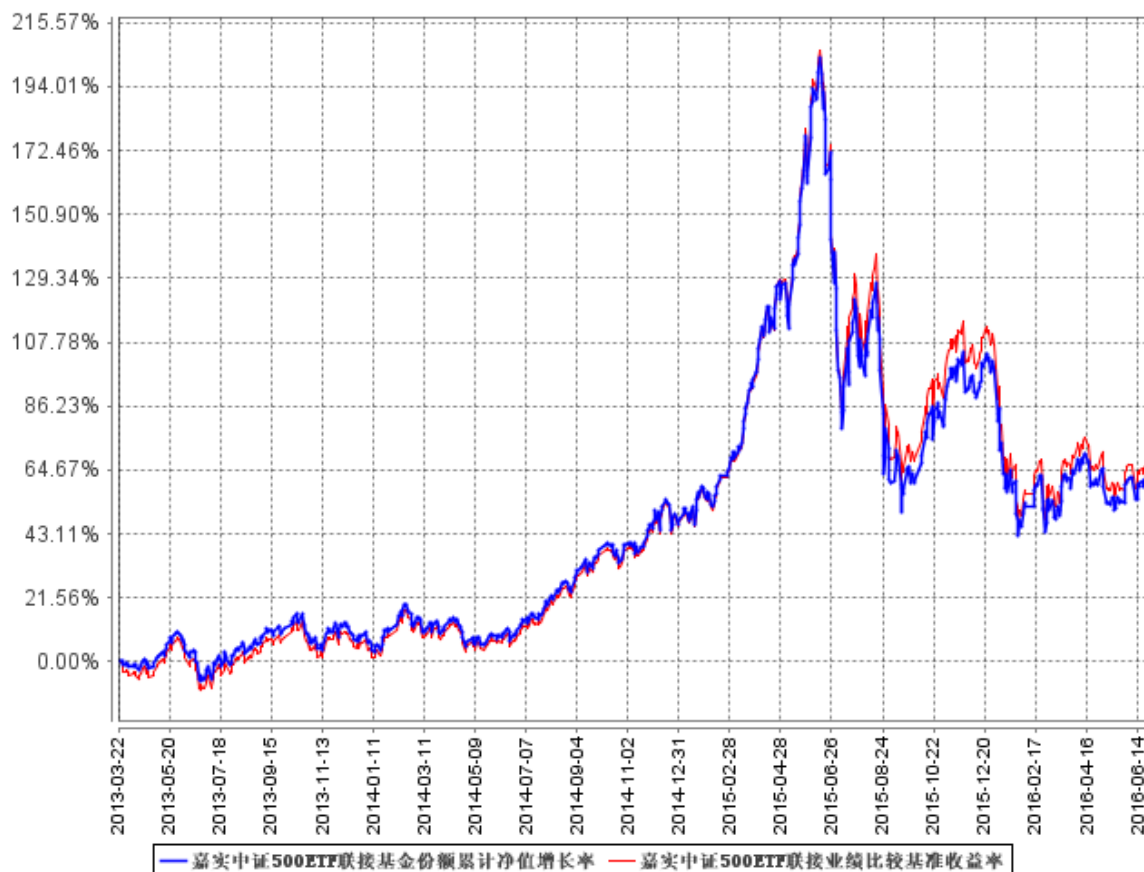
Return(t)=95%×中证 500 指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中 t=1, 2, 3, …。

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 2016 年 6 月 30 日)

注 1：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。

注 2：2016 年 1 月 5 日，本基金管理人发布《关于嘉实中证 500ETF 联接基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理职务，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 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、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。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		
何如	本基金、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 及其联接、嘉实沪深 300ETF 及其联接、嘉实中证 500ETF、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	10 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，现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实基本面 50（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实沪深 300ETF 及其联接、嘉实中创 400ETF 及其联接基金基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	11 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，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。
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	2013 年 3 月 22 日	2016 年 1 月 5 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。

	部总监				
--	-----	--	--	--	--

注：（1）基金经理杨宇的任职日期是指本基金基金合同生效之日；基金经理何如、陈正宪的任职日期是指公司作出决定后公告之日，离任日期是指公司作出决定后公告之日；（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 1 次，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 0.12%，年度化拟合偏离度为 1.97%，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 1.6455 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.02%，业绩比较基准收益率为-18.57%。

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、合规部等部门负责人组成，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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为 -67,144,701.79 元，以及基金合同（十六（三）收益分配原则）约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	35,807,395.93	23,043,706.58
结算备付金		1,881,899.80	7,896,429.23
存出保证金		1,373,609.28	2,069,466.22
交易性金融资产	6.4.7.2	525,168,138.39	381,236,188.66
其中：股票投资		9,703,010.50	5,410,766.55
基金投资		515,462,827.89	375,825,422.11
债券投资		2,300.00	-
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		1,404,415.89	575,222.37
应收利息	6.4.7.5	7,834.38	12,217.73
应收股利		-	-
应收申购款		1,626,069.02	546,974.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	33,863.06
资产总计		567,269,362.69	415,414,067.96

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	12,145.41
应付赎回款		6,122,434.36	1,404,360.82
应付管理人报酬		21,225.22	27,963.38
应付托管费		4,245.08	5,592.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	120,975.20	600,405.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	299,325.90	365,545.29
负债合计		6,568,205.76	2,416,012.78
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	340,755,253.81	208,255,614.26
未分配利润	6.4.7.10	219,945,903.12	204,742,440.92
所有者权益合计		560,701,156.93	412,998,055.18
负债和所有者权益总计		567,269,362.69	415,414,067.96

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6455 元，基金份额总额 340,755,253.81 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-66,542,741.87	205,395,686.30
1.利息收入		129,079.86	146,021.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	129,078.92	146,021.56
债券利息收入		0.94	-
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		-3,013,463.94	125,899,728.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-972,794.89	7,640,410.34

基金投资收益	6.4.7.13	-1,842,766.35	118,196,117.20
债券投资收益	6.4.7.14	557.84	-
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	-274,861.82	-
股利收益	6.4.7.16	76,401.28	63,200.55
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	-63,906,767.66	77,792,696.38
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	248,409.87	1,557,240.27
减：二、费用		601,959.92	1,229,091.03
1. 管理人报酬		109,760.01	112,554.97
2. 托管费		21,952.04	22,511.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	272,997.36	890,852.57
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	197,250.51	203,172.47
三、利润总额		-67,144,701.79	204,166,595.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-67,144,701.79	204,166,595.27

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	208,255,614.26	204,742,440.92	412,998,055.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-67,144,701.79	-67,144,701.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	132,499,639.55	82,348,163.99	214,847,803.54
其中：1. 基金申购款	259,165,880.62	157,986,345.71	417,152,226.33
2. 基金赎回款	-126,666,241.07	-75,638,181.72	-202,304,422.79
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）	340,755,253.81	219,945,903.12	560,701,156.93
项目	上年度可比期间 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（基金净值）	181,894,326.90	86,435,751.79	268,330,078.69
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

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 王红 常旭
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协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本报告期末的财务状况以及本报告期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

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	35,807,395.93
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	35,807,395.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,352,775.10	9,703,010.50	350,235.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,300.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	2,300.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	558,427,312.10	515,462,827.89	-42,964,484.21
其他	-	-	-
合计	567,782,387.20	525,168,138.39	-42,614,248.81

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	5,846,640.00	-	-	

其中：股指期货投资	5,846,640.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,846,640.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1607	中证 500 股指期货 IC1607 合约	5	6,043,400.00	196,760.00
总额合计	-	-	-	196,760.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	196,760.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

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（2016 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（2016 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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,831.98
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	88.09
应收债券利息	0.58
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	913.73
合计	7,834.38

6.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	120,975.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	120,975.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,312.52
预提费用	279,013.38
可退替代款	-
应付替代款	-
应付指数使用费	-
其他	-
合计	299,325.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	208,255,614.26	208,255,614.26
本期申购	259,165,880.62	259,165,880.62
本期赎回	-126,666,241.07	-126,666,241.07
本期末	340,755,253.81	340,755,253.81

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	157,465,090.71	47,277,350.21	204,742,440.92

本期利润	-3,237,934.13	-63,906,767.66	-67,144,701.79
本期基金份额交易产生的变动数	98,866,091.10	-16,517,927.11	82,348,163.99
其中：基金申购款	193,243,785.29	-35,257,439.58	157,986,345.71
基金赎回款	-94,377,694.19	18,739,512.47	-75,638,181.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	253,093,247.68	-33,147,344.56	219,945,903.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	100,499.38
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	2,982.71
其他	25,596.83
合计	129,078.92

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-394,601.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-578,193.42
合计	-972,794.89

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	44,053,782.55
减：卖出股票成本总额	44,448,384.02
买卖股票差价收入	-394,601.47

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	218,776,140.00
减：现金支付申购款总额	19,905,248.31
减：申购股票成本总额	199,449,085.11
申购差价收入	-578,193.42

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	13,398,132.91
减：卖出/赎回基金成本总额	15,240,899.26
基金投资收益	-1,842,766.35

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,558.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应收利息总额	0.36
买卖债券差价收入	557.84

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-274,861.82

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	76,401.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	76,401.28

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-63,559,229.48
——股票投资	275,780.57
——债券投资	-
——基金投资	-63,835,010.05
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-347,538.18
——权证投资	-
——期货投资	-347,538.18
3. 其他	-
合计	-63,906,767.66

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	112,186.45
基金转出费收入	136,223.42
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
替代损益	-
证管费退还	-
其他	-
合计	248,409.87

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	272,997.36
银行间市场交易费用	-
合计	272,997.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	10,500.00
银行划款手续费	7,537.13
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	200.00
合计	197,250.51

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	109,760.01	112,554.97
其中：支付销售机构的客户维护费	332,928.04	358,196.91

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	21,952.04	22,511.02

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 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2015 年 1 月 1 日至 2015 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 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2015 年 1 月 1 日至 2015 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 (2016 年 6 月 30 日) 及上年度末 (2015 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	35,807,395.93	100,499.38	59,298,039.33	116,064.98

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按适用利率计息。

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 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日) 及上年度可比期间 (2015 年 1 月 1 日至 2015 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 (2016 年 6 月 30 日), 本基金持有 84,697,880.00 份目标 ETF 基金份额 (2015 年 12 月 31 日: 50,497,880.00 份), 占其总份额的比例为 57.57% (2015 年 12 月 31 日: 43.33%)。

6.4.11 利润分配情况

本期 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 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**

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月8日	2016年7月1日	未上市	100.00	100.00	23	2,300.00	2,300.00	网上申购

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而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
000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大事项停牌	10.60	2016年7月14日	11.32	1,600	16,226.30	16,960.00	-
000511	*ST 烯碳	2016年4月26日	重大事项停牌	8.92	-	-	5,000	44,927.07	44,600.00	-
000517	荣安地产	2016年6月14日	重大事项停牌	4.84	2016年7月14日	4.98	3,800	18,783.61	18,392.00	-
000636	风华高科	2016年3月15日	重大事项停牌	8.84	2016年7月13日	9.72	1,200	10,163.40	10,608.00	-
002190	成飞集成	2016年4月21日	重大事项停牌	35.44	2016年7月12日	38.98	500	18,636.83	17,720.00	-
002249	大洋电机	2016年6月8日	重大事项停牌	11.97	2016年7月28日	10.77	1,100	11,276.72	13,167.00	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	重大事项	5.35	-	-	7,100	39,703.28	37,985.00	-

		日	停牌								
002373	千方科技	2016年5月12日	重大事项停牌	14.94	2016年8月16日	16.43	2,100	33,529.26	31,374.00	-	
002512	达华智能	2016年6月21日	重大事项停牌	20.28	2016年7月21日	19.38	1,400	27,447.86	28,392.00	-	
002663	普邦园林	2016年4月27日	重大事项停牌	7.36	-	-	2,900	19,809.46	21,344.00	-	
002672	东江环保	2016年5月23日	重大事项停牌	17.33	2016年7月15日	19.06	1,900	31,629.77	32,927.00	-	
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项停牌	20.10	2016年7月7日	19.80	1,400	24,714.60	28,140.00	-	
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项停牌	27.47	-	-	2,100	55,835.22	57,687.00	-	
600166	福田汽车	2016年6月30日	重大事项停牌	5.52	2016年7月1日	5.62	6,700	36,769.24	36,984.00	-	
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项停牌	9.97	2016年7月11日	10.97	4,200	41,458.17	41,874.00	-	
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项停牌	27.44	2016年8月4日	30.16	500	13,406.69	13,720.00	-	
600545	新疆城建	2016年5月31日	重大事项停牌	6.91	-	-	2,900	21,301.10	20,039.00	-	
600614	鼎立股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.14	-	-	2,500	18,813.44	20,350.00	-	
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项停牌	18.54	2016年8月8日	20.39	3,400	75,522.61	63,036.00	-	
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大事项停牌	7.58	2016年7月11日	8.10	5,100	40,444.48	38,658.00	-	
600773	西藏城投	2016年6月30日	重大事项停牌	15.67	-	-	1,300	20,561.51	20,371.00	-	
601005	重庆	2016年	重大	2.52	-	-	6,100	15,979.86	15,372.00	-	

	钢铁	6月2日	事项停牌							
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项停牌	5.93	2016年7月22日	6.52	1,700	10,262.23	10,081.00	-

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（2016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（2016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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (上年度末：无)。

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于开放日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于开放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。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	35,807,395.93	-	-	-	35,807,395.93
结算备付金	1,881,899.80	-	-	-	1,881,899.80
存出保证金	164,929.28	-	-	1,208,680.00	1,373,609.28
交易性金融资产	-	-	2,300.00	525,165,838.39	525,168,138.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,404,415.89	1,404,415.89
应收利息	-	-	-	7,834.38	7,834.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	64,774.82	-	-	1,561,294.20	1,626,069.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,918,999.83	-	2,300.00	529,348,062.86	567,269,362.69
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	-	-	-	6,122,434.36	6,122,434.36
应付管理人报酬	-	-	-	21,225.22	21,225.22
应付托管费	-	-	-	4,245.08	4,245.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用				120,975.20	120,975.20
应交税费				-	-
应付利息				-	-
应付利润				-	-
递延所得税负债				-	-
其他负债				299,325.90	299,325.90
负债总计				6,568,205.76	6,568,205.76
利率敏感度缺口	37,918,999.83		2,300.00	522,779,857.10	560,701,156.93
上年度末 2015 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	23,043,706.58				23,043,706.58
结算备付金	7,896,429.23				7,896,429.23
存出保证金	293,706.22			1,775,760.00	2,069,466.22
交易性金融资产				381,236,188.66	381,236,188.66
衍生金融资产					
买入返售金融资产					
应收证券清算款				575,222.37	575,222.37
应收利息				12,217.73	12,217.73
应收股利					
应收申购款				546,974.11	546,974.11
递延所得税资产					
其他资产				33,863.06	33,863.06
资产总计	31,233,842.03			384,180,225.93	415,414,067.96
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				12,145.41	12,145.41
应付赎回款				1,404,360.82	1,404,360.82
应付管理人报酬				27,963.38	27,963.38
应付托管费				5,592.68	5,592.68
应付销售服务费					
应付交易费用				600,405.20	600,405.20
应交税费					
应付利息					
应付利润					
递延所得税负债					
其他负债				365,545.29	365,545.29
负债总计				2,416,012.78	2,416,012.78
利率敏感度缺口	31,233,842.03			381,764,213.15	412,998,055.18

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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资的公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2015 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 (2015 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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	9,703,010.50	1.73	5,410,766.55	1.31
交易性金融资产-基金投资	515,462,827.89	91.93	375,825,422.11	91.00
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	525,165,838.39	93.66	381,236,188.66	92.31

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	27,614,531.98	20,630,088.93
	业绩比较基准下降 5%	-27,614,531.98	-20,630,088.93

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

于本报告期末，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次的余额为 524,526,057.39 元，属于第二层次的余额为 642,081.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 375,857,189.11 元，第二层次 5,378,999.55 元，无属于第三层次的余额）。

(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和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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和债券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，确定相关股票和债券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，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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

(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	9,703,010.50	1.71
	其中：股票	9,703,010.50	1.71
2	基金投资	515,462,827.89	90.87
3	固定收益投资	2,300.00	0.00
	其中：债券	2,300.00	0.00
	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	37,689,295.73	6.64
8	其他各项资产	4,411,928.57	0.78
	合计	567,269,362.69	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	181,792.00	0.03
B	采矿业	344,282.00	0.06
C	制造业	5,737,798.22	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	268,039.00	0.05
E	建筑业	299,946.10	0.05
F	批发和零售业	593,940.20	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	245,557.60	0.04
H	住宿和餐饮业	16,730.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	773,991.40	0.14
J	金融业	45,352.00	0.01
K	房地产业	634,184.28	0.11
L	租赁和商务服务业	126,285.50	0.02
M	科学研究和技术服务业	47,341.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	77,289.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,703.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	168,261.00	0.03
S	综合	114,518.00	0.02
	合计	9,703,010.50	1.73

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	002466	天齐锂业	1,520	64,888.80	0.01

2	600654	中安消	3,400	63,036.00	0.01
3	300166	东方国信	2,100	57,687.00	0.01
4	600584	长电科技	2,600	52,754.00	0.01
5	002405	四维图新	2,100	51,660.00	0.01
6	000511	*ST 烯碳	5,000	44,600.00	0.01
7	600522	中天科技	4,550	44,590.00	0.01
8	002340	格林美	5,000	43,850.00	0.01
9	300072	三聚环保	1,528	42,233.92	0.01
10	600497	驰宏锌锗	4,200	41,874.00	0.01
11	300113	顺网科技	1,100	41,756.00	0.01
12	600201	生物股份	1,500	40,995.00	0.01
13	002049	紫光国芯	900	39,555.00	0.01
14	002085	万丰奥威	2,300	39,537.00	0.01
15	002572	索菲亚	700	39,214.00	0.01
16	600759	洲际油气	5,100	38,658.00	0.01
17	600079	人福医药	2,300	38,571.00	0.01
18	600521	华海药业	1,580	38,425.60	0.01
19	000661	长春高新	360	38,404.80	0.01
20	002266	浙富控股	7,100	37,985.00	0.01
21	002030	达安基因	1,340	37,252.00	0.01
22	600682	南京新百	1,300	37,011.00	0.01
23	600166	福田汽车	6,700	36,984.00	0.01
24	600503	华丽家族	4,000	36,680.00	0.01
25	600525	长园集团	2,640	36,564.00	0.01
26	300253	卫宁健康	1,480	36,556.00	0.01
27	600219	南山铝业	4,900	36,260.00	0.01
28	002426	胜利精密	3,600	35,460.00	0.01
29	601012	隆基股份	2,700	35,235.00	0.01
30	002179	中航光电	800	34,656.00	0.01
31	600699	均胜电子	900	34,470.00	0.01
32	000997	新大陆	1,700	34,068.00	0.01
33	600436	片仔癀	750	33,757.50	0.01
34	002273	水晶光电	1,200	33,588.00	0.01
35	002439	启明星辰	1,300	33,579.00	0.01
36	600978	宜华生活	3,000	33,420.00	0.01
37	002400	省广股份	2,350	33,205.50	0.01
38	002038	双鹭药业	1,100	33,198.00	0.01
39	000887	中鼎股份	1,500	33,165.00	0.01
40	002508	老板电器	900	33,093.00	0.01

41	002672	东江环保	1,900	32,927.00	0.01
42	600482	中国动力	1,000	32,770.00	0.01
43	600879	航天电子	2,100	32,718.00	0.01
44	002131	利欧股份	1,900	32,471.00	0.01
45	000988	华工科技	1,600	32,080.00	0.01
46	002004	华邦健康	3,500	31,955.00	0.01
47	603019	中科曙光	800	31,856.00	0.01
48	000983	西山煤电	3,900	31,785.00	0.01
49	600498	烽火通信	1,300	31,564.00	0.01
50	000748	长城信息	1,600	31,392.00	0.01
51	002373	千方科技	2,100	31,374.00	0.01
52	002310	东方园林	1,300	31,096.00	0.01
53	002701	奥瑞金	3,520	31,081.60	0.01
54	600122	宏图高科	2,300	30,774.00	0.01
55	600664	哈药股份	3,690	30,590.10	0.01
56	000970	中科三环	2,100	30,471.00	0.01
57	000998	隆平高科	1,600	30,368.00	0.01
58	002714	牧原股份	600	30,318.00	0.01
59	600158	中体产业	1,700	30,175.00	0.01
60	600266	北京城建	2,400	29,976.00	0.01
61	300088	长信科技	2,000	29,740.00	0.01
62	002001	新 和 成	1,400	29,582.00	0.01
63	600635	大众公用	4,900	29,547.00	0.01
64	000050	深天马 A	1,400	29,218.00	0.01
65	600138	中青旅	1,500	28,980.00	0.01
66	000078	海王生物	3,900	28,977.00	0.01
67	600478	科力远	2,400	28,968.00	0.01
68	000656	金科股份	7,500	28,650.00	0.01
69	002223	鱼跃医疗	900	28,548.00	0.01
70	002299	圣农发展	1,100	28,490.00	0.01
71	002512	达华智能	1,400	28,392.00	0.01
72	600143	金发科技	4,400	28,336.00	0.01
73	600643	爱建集团	2,900	28,333.00	0.01
74	002168	深圳惠程	2,000	28,160.00	0.01
75	300032	金龙机电	1,400	28,140.00	0.01
76	600645	中源协和	800	28,112.00	0.01
77	600418	江淮汽车	2,200	27,896.00	0.00
78	002276	万马股份	1,400	27,734.00	0.00
79	300244	迪安诊断	840	27,703.20	0.00

80	600487	亨通光电	2,200	27,676.00	0.00
81	002074	国轩高科	700	27,629.00	0.00
82	002657	中科金财	500	27,470.00	0.00
83	300055	万邦达	1,500	27,315.00	0.00
84	000762	西藏矿业	1,100	27,192.00	0.00
85	600200	江苏吴中	1,400	27,118.00	0.00
86	600655	豫园商城	2,500	27,100.00	0.00
87	002573	清新环境	1,600	27,072.00	0.00
88	600673	东阳光科	4,300	26,875.00	0.00
89	002191	劲嘉股份	2,300	26,657.00	0.00
90	002366	台海核电	500	26,655.00	0.00
91	600312	平高电气	1,700	26,622.00	0.00
92	600388	龙净环保	2,100	26,376.00	0.00
93	000012	南玻A	2,300	26,358.00	0.00
94	000930	中粮生化	2,400	26,352.00	0.00
95	000581	威孚高科	1,300	26,208.00	0.00
96	002354	天神娱乐	300	26,184.00	0.00
97	000028	国药一致	400	26,040.00	0.00
98	600198	大唐电信	1,300	25,844.00	0.00
99	600410	华胜天成	2,300	25,806.00	0.00
100	600094	大名城	2,700	25,650.00	0.00
101	002595	豪迈科技	1,200	25,644.00	0.00
102	002221	东华能源	2,100	25,599.00	0.00
103	600594	益佰制药	1,600	25,568.00	0.00
104	000031	中粮地产	2,700	25,461.00	0.00
105	600851	海欣股份	1,900	25,289.00	0.00
106	600435	北方导航	1,900	25,289.00	0.00
107	002311	海大集团	1,600	25,232.00	0.00
108	300010	立思辰	1,200	25,176.00	0.00
109	002048	宁波华翔	1,100	25,157.00	0.00
110	000697	炼石有色	1,100	25,135.00	0.00
111	600240	华业资本	2,500	25,050.00	0.00
112	002268	卫士通	700	25,018.00	0.00
113	600770	综艺股份	2,000	24,920.00	0.00
114	600151	航天机电	2,200	24,860.00	0.00
115	002308	威创股份	1,500	24,645.00	0.00
116	600160	巨化股份	2,300	24,449.00	0.00
117	300274	阳光电源	1,000	24,400.00	0.00
118	600687	刚泰控股	1,500	24,390.00	0.00

119	000979	中弘股份	8,900	24,386.00	0.00
120	600171	上海贝岭	1,400	24,318.00	0.00
121	002410	广联达	1,700	24,310.00	0.00
122	600884	杉杉股份	1,400	24,094.00	0.00
123	000566	海南海药	2,200	24,002.00	0.00
124	600811	东方集团	3,600	23,976.00	0.00
125	600366	宁波韵升	1,000	23,870.00	0.00
126	601127	小康股份	1,000	23,870.00	0.00
127	000860	顺鑫农业	1,000	23,780.00	0.00
128	600516	方大炭素	2,600	23,764.00	0.00
129	000671	阳光城	4,000	23,760.00	0.00
130	600499	科达洁能	1,400	23,674.00	0.00
131	600176	中国巨石	2,460	23,542.20	0.00
132	600500	中化国际	2,600	23,504.00	0.00
133	002022	科华生物	1,100	23,441.00	0.00
134	002477	雏鹰农牧	3,900	23,283.00	0.00
135	000598	兴蓉环境	4,400	23,232.00	0.00
136	600601	方正科技	5,400	23,220.00	0.00
137	000400	许继电气	1,500	23,160.00	0.00
138	002353	杰瑞股份	1,200	23,136.00	0.00
139	002665	首航节能	2,930	23,117.70	0.00
140	600755	厦门国贸	2,900	23,055.00	0.00
141	300273	和佳股份	1,200	22,980.00	0.00
142	600392	盛和资源	1,400	22,932.00	0.00
143	600259	广晟有色	400	22,904.00	0.00
144	000008	神州高铁	2,100	22,869.00	0.00
145	002092	中泰化学	2,700	22,842.00	0.00
146	002051	中工国际	1,160	22,817.20	0.00
147	300043	互动娱乐	1,600	22,672.00	0.00
148	300115	长盈精密	1,100	22,660.00	0.00
149	600565	迪马股份	3,500	22,610.00	0.00
150	300026	红日药业	1,300	22,607.00	0.00
151	600633	浙报传媒	1,500	22,560.00	0.00
152	000758	中色股份	2,900	22,475.00	0.00
153	600216	浙江医药	1,700	22,423.00	0.00
154	002271	东方雨虹	1,300	22,399.00	0.00
155	002155	湖南黄金	1,700	22,389.00	0.00
156	300199	翰宇药业	1,100	22,385.00	0.00
157	002444	巨星科技	1,100	22,352.00	0.00

158	300182	捷成股份	1,300	22,243.00	0.00
159	603766	隆鑫通用	1,100	22,242.00	0.00
160	000727	华东科技	6,700	22,110.00	0.00
161	601311	骆驼股份	1,100	21,835.00	0.00
162	601929	吉视传媒	5,400	21,762.00	0.00
163	000690	宝新能源	3,200	21,696.00	0.00
164	300001	特锐德	1,000	21,690.00	0.00
165	600881	亚泰集团	4,500	21,690.00	0.00
166	000066	长城电脑	1,700	21,675.00	0.00
167	002013	中航机电	1,600	21,568.00	0.00
168	600651	飞乐音响	1,700	21,522.00	0.00
169	002250	联化科技	1,500	21,480.00	0.00
170	600316	洪都航空	1,100	21,461.00	0.00
171	002217	合力泰	1,400	21,420.00	0.00
172	002489	浙江永强	2,700	21,384.00	0.00
173	000878	云南铜业	2,100	21,378.00	0.00
174	002663	普邦园林	2,900	21,344.00	0.00
175	002368	太极股份	600	21,318.00	0.00
176	300291	华录百纳	900	21,177.00	0.00
177	600611	大众交通	3,100	21,111.00	0.00
178	300134	大富科技	700	20,972.00	0.00
179	600064	南京高科	1,400	20,930.00	0.00
180	000021	深科技	1,900	20,919.00	0.00
181	002371	七星电子	500	20,910.00	0.00
182	600528	中铁二局	1,800	20,898.00	0.00
183	600058	五矿发展	1,100	20,647.00	0.00
184	600056	中国医药	1,300	20,618.00	0.00
185	002428	云南锗业	1,200	20,616.00	0.00
186	002073	软控股份	1,700	20,485.00	0.00
187	600572	康恩贝	3,150	20,412.00	0.00
188	601155	新城控股	2,200	20,372.00	0.00
189	600773	西藏城投	1,300	20,371.00	0.00
190	600614	鼎立股份	2,500	20,350.00	0.00
191	600597	光明乳业	1,600	20,288.00	0.00
192	300287	飞利信	1,500	20,100.00	0.00
193	600787	中储股份	2,700	20,061.00	0.00
194	600026	中海发展	3,400	20,060.00	0.00
195	600545	新疆城建	2,900	20,039.00	0.00
196	002699	美盛文化	600	20,034.00	0.00

197	000829	天音控股	1,500	20,025.00	0.00
198	600536	中国软件	800	19,936.00	0.00
199	600325	华发股份	1,800	19,926.00	0.00
200	002325	洪涛股份	2,160	19,850.40	0.00
201	000973	佛塑科技	1,900	19,836.00	0.00
202	000685	中山公用	1,900	19,722.00	0.00
203	600108	亚盛集团	3,900	19,695.00	0.00
204	000592	平潭发展	2,900	19,662.00	0.00
205	600260	凯乐科技	1,200	19,632.00	0.00
206	600298	安琪酵母	1,100	19,624.00	0.00
207	601699	潞安环能	3,000	19,620.00	0.00
208	000418	小天鹅 A	600	19,572.00	0.00
209	002431	棕榈股份	1,700	19,550.00	0.00
210	601880	大连港	3,300	19,503.00	0.00
211	600073	上海梅林	1,700	19,465.00	0.00
212	600161	天坛生物	700	19,453.00	0.00
213	600426	华鲁恒升	2,200	19,382.00	0.00
214	002161	远望谷	1,300	19,357.00	0.00
215	000543	皖能电力	2,700	19,278.00	0.00
216	600694	大商股份	500	19,260.00	0.00
217	002281	光迅科技	300	19,260.00	0.00
218	000616	海航投资	3,600	19,224.00	0.00
219	002375	亚厦股份	1,700	19,210.00	0.00
220	002437	誉衡药业	2,200	19,140.00	0.00
221	600348	阳泉煤业	3,000	19,110.00	0.00
222	600422	昆药集团	1,400	19,096.00	0.00
223	002603	以岭药业	1,200	19,092.00	0.00
224	000786	北新建材	2,100	19,068.00	0.00
225	002624	完美环球	500	18,875.00	0.00
226	000777	中核科技	800	18,848.00	0.00
227	601777	力帆股份	1,600	18,832.00	0.00
228	002002	鸿达兴业	1,000	18,800.00	0.00
229	600067	冠城大通	2,600	18,746.00	0.00
230	002056	横店东磁	1,100	18,700.00	0.00
231	600017	日照港	4,600	18,630.00	0.00
232	001696	宗申动力	1,700	18,564.00	0.00
233	002063	远光软件	1,200	18,540.00	0.00
234	000513	丽珠集团	400	18,444.00	0.00
235	002589	瑞康医药	600	18,426.00	0.00

236	000517	荣安地产	3,800	18,392.00	0.00
237	600380	健康元	2,000	18,360.00	0.00
238	600717	天津港	2,100	18,249.00	0.00
239	000969	安泰科技	1,300	18,239.00	0.00
240	600267	海正药业	1,500	18,225.00	0.00
241	600563	法拉电子	400	18,208.00	0.00
242	000667	美好集团	5,100	18,207.00	0.00
243	000848	承德露露	1,520	18,164.00	0.00
244	600967	北方创业	1,700	18,071.00	0.00
245	000810	创维数字	1,000	18,070.00	0.00
246	600557	康缘药业	1,100	17,963.00	0.00
247	600580	卧龙电气	1,600	17,936.00	0.00
248	002384	东山精密	900	17,874.00	0.00
249	600808	马钢股份	7,400	17,834.00	0.00
250	002440	闰土股份	1,200	17,820.00	0.00
251	600006	东风汽车	2,000	17,740.00	0.00
252	600039	四川路桥	4,500	17,730.00	0.00
253	002190	成飞集成	500	17,720.00	0.00
254	000006	深振业 A	2,400	17,688.00	0.00
255	300147	香雪制药	1,200	17,676.00	0.00
256	002640	跨境通	1,000	17,620.00	0.00
257	600850	华东电脑	610	17,500.90	0.00
258	600765	中航重机	1,200	17,496.00	0.00
259	600639	浦东金桥	700	17,486.00	0.00
260	000488	晨鸣纸业	2,200	17,468.00	0.00
261	600320	振华重工	4,100	17,425.00	0.00
262	002050	三花股份	1,800	17,370.00	0.00
263	600120	浙江东方	800	17,368.00	0.00
264	002025	航天电器	700	17,283.00	0.00
265	600872	中炬高新	1,400	17,276.00	0.00
266	002642	荣之联	650	17,101.50	0.00
267	000563	陕国投 A	3,100	17,019.00	0.00
268	000939	凯迪生态	1,900	17,005.00	0.00
269	000587	金洲慈航	1,100	16,973.00	0.00
270	000401	冀东水泥	1,600	16,960.00	0.00
271	300202	聚龙股份	700	16,947.00	0.00
272	600175	美都能源	3,600	16,920.00	0.00
273	002681	奋达科技	1,000	16,880.00	0.00
274	600289	亿阳信通	1,200	16,788.00	0.00

275	000049	德赛电池	400	16,776.00	0.00
276	600754	锦江股份	500	16,730.00	0.00
277	600970	中材国际	2,650	16,695.00	0.00
278	600183	生益科技	1,800	16,686.00	0.00
279	600993	马应龙	800	16,664.00	0.00
280	601010	文峰股份	3,200	16,608.00	0.00
281	000681	视觉中国	700	16,555.00	0.00
282	000816	智慧农业	2,800	16,548.00	0.00
283	600869	智慧能源	1,600	16,480.00	0.00
284	600086	东方金钰	1,700	16,456.00	0.00
285	600736	苏州高新	1,800	16,434.00	0.00
286	000926	福星股份	1,400	16,422.00	0.00
287	600433	冠豪高新	1,900	16,416.00	0.00
288	600062	华润双鹤	900	16,398.00	0.00
289	600169	太原重工	4,200	16,380.00	0.00
290	000519	江南红箭	1,280	16,268.80	0.00
291	600416	湘电股份	1,300	16,211.00	0.00
292	000062	深圳华强	600	16,200.00	0.00
293	600537	亿晶光电	2,100	16,191.00	0.00
294	002414	高德红外	600	16,182.00	0.00
295	600880	博瑞传播	1,900	16,169.00	0.00
296	600517	置信电气	1,700	16,167.00	0.00
297	603188	亚邦股份	900	16,164.00	0.00
298	600587	新华医疗	700	16,163.00	0.00
299	000869	张裕 A	400	16,072.00	0.00
300	600187	国中水务	3,600	16,056.00	0.00
301	002505	大康农业	4,100	15,990.00	0.00
302	600220	江苏阳光	3,500	15,960.00	0.00
303	600750	江中药业	500	15,900.00	0.00
304	002011	盾安环境	1,400	15,792.00	0.00
305	002396	星网锐捷	800	15,760.00	0.00
306	600270	外运发展	900	15,741.00	0.00
307	002285	世联行	2,020	15,735.80	0.00
308	000600	建投能源	1,800	15,714.00	0.00
309	600826	兰生股份	600	15,708.00	0.00
310	002390	信邦制药	1,700	15,708.00	0.00
311	002078	太阳纸业	3,200	15,616.00	0.00
312	601000	唐山港	4,020	15,597.60	0.00
313	600575	皖江物流	3,600	15,588.00	0.00

314	600458	时代新材	1,000	15,580.00	0.00
315	600809	山西汾酒	700	15,526.00	0.00
316	600409	三友化工	2,300	15,502.00	0.00
317	600277	亿利洁能	2,600	15,470.00	0.00
318	002106	莱宝高科	1,300	15,444.00	0.00
319	000541	佛山照明	1,500	15,435.00	0.00
320	002358	森源电气	1,000	15,430.00	0.00
321	000961	中南建设	2,750	15,427.50	0.00
322	002244	滨江集团	2,300	15,410.00	0.00
323	601005	重庆钢铁	6,100	15,372.00	0.00
324	600835	上海机电	800	15,352.00	0.00
325	002635	安洁科技	400	15,352.00	0.00
326	002261	拓维信息	1,100	15,213.00	0.00
327	002254	泰和新材	1,100	15,092.00	0.00
328	600460	士兰微	1,900	15,067.00	0.00
329	000572	海马汽车	2,900	15,051.00	0.00
330	000669	金鸿能源	900	15,030.00	0.00
331	002727	一心堂	600	15,000.00	0.00
332	600859	王府井	980	14,935.20	0.00
333	002028	思源电气	1,360	14,892.00	0.00
334	600729	重庆百货	600	14,880.00	0.00
335	300257	开山股份	900	14,868.00	0.00
336	002588	史丹利	1,200	14,820.00	0.00
337	600805	悦达投资	1,700	14,756.00	0.00
338	600004	白云机场	1,200	14,712.00	0.00
339	600894	广日股份	1,100	14,663.00	0.00
340	600125	铁龙物流	2,300	14,651.00	0.00
341	000550	江铃汽车	600	14,616.00	0.00
342	600284	浦东建设	1,400	14,616.00	0.00
343	002242	九阳股份	800	14,544.00	0.00
344	600112	天成控股	1,300	14,508.00	0.00
345	000596	古井贡酒	300	14,385.00	0.00
346	002309	中利科技	800	14,328.00	0.00
347	002498	汉缆股份	3,300	14,322.00	0.00
348	000099	中信海直	1,100	14,300.00	0.00
349	002005	德豪润达	2,400	14,184.00	0.00
350	600395	盘江股份	1,700	14,042.00	0.00
351	600351	亚宝药业	1,400	14,042.00	0.00
352	002551	尚荣医疗	600	14,028.00	0.00

353	002041	登海种业	900	13,986.00	0.00
354	000158	常山股份	1,000	13,890.00	0.00
355	600053	九鼎投资	400	13,852.00	0.00
356	000937	冀中能源	2,600	13,832.00	0.00
357	000861	海印股份	2,800	13,832.00	0.00
358	600511	国药股份	500	13,720.00	0.00
359	601717	郑煤机	2,400	13,680.00	0.00
360	002093	国脉科技	1,100	13,651.00	0.00
361	002344	海宁皮城	1,400	13,650.00	0.00
362	002269	美邦服饰	3,100	13,640.00	0.00
363	002315	焦点科技	200	13,492.00	0.00
364	002479	富春环保	1,200	13,476.00	0.00
365	600823	世茂股份	1,980	13,444.20	0.00
366	000726	鲁泰 A	1,200	13,332.00	0.00
367	300039	上海凯宝	1,300	13,221.00	0.00
368	000090	天健集团	1,500	13,200.00	0.00
369	002463	沪电股份	2,500	13,200.00	0.00
370	002317	众生药业	1,100	13,189.00	0.00
371	002249	大洋电机	1,100	13,167.00	0.00
372	600628	新世界	1,100	12,980.00	0.00
373	600831	广电网络	1,000	12,960.00	0.00
374	000528	柳工	2,000	12,960.00	0.00
375	000088	盐田港	2,000	12,880.00	0.00
376	000620	新华联	1,400	12,810.00	0.00
377	600496	精工钢构	3,000	12,780.00	0.00
378	002128	露天煤业	1,700	12,767.00	0.00
379	002277	友阿股份	1,100	12,672.00	0.00
380	600292	远达环保	1,000	12,670.00	0.00
381	600757	长江传媒	1,500	12,585.00	0.00
382	000501	鄂武商 A	800	12,552.00	0.00
383	600300	维维股份	2,100	12,474.00	0.00
384	002503	搜于特	1,000	12,420.00	0.00
385	600812	华北制药	2,000	12,420.00	0.00
386	000897	津滨发展	3,200	12,384.00	0.00
387	600059	古越龙山	1,200	12,348.00	0.00
388	600428	中远航运	2,200	12,342.00	0.00
389	000680	山推股份	2,500	12,325.00	0.00
390	601886	江河集团	1,200	12,324.00	0.00
391	603077	和邦生物	2,500	12,300.00	0.00

392	002029	七匹狼	1,200	12,180.00	0.00
393	000900	现代投资	1,800	12,132.00	0.00
394	600236	桂冠电力	1,800	12,096.00	0.00
395	600180	瑞茂通	800	12,088.00	0.00
396	600456	宝钛股份	600	12,072.00	0.00
397	002064	华峰氨纶	2,500	12,000.00	0.00
398	000552	靖远煤电	3,400	11,968.00	0.00
399	000652	泰达股份	2,600	11,960.00	0.00
400	601666	平煤股份	2,900	11,861.00	0.00
401	603328	依顿电子	400	11,816.00	0.00
402	600509	天富能源	1,600	11,760.00	0.00
403	002118	紫鑫药业	800	11,760.00	0.00
404	000830	鲁西化工	2,600	11,752.00	0.00
405	002482	广田集团	1,550	11,749.00	0.00
406	002698	博实股份	600	11,556.00	0.00
407	002267	陕天然气	1,100	11,550.00	0.00
408	600282	南钢股份	4,900	11,515.00	0.00
409	601908	京运通	1,500	11,505.00	0.00
410	600481	双良节能	2,000	11,460.00	0.00
411	603005	晶方科技	300	11,361.00	0.00
412	000417	合肥百货	1,400	11,326.00	0.00
413	000426	兴业矿业	1,500	11,280.00	0.00
414	601001	大同煤业	2,100	11,277.00	0.00
415	600586	金晶科技	2,600	11,180.00	0.00
416	000931	中关村	1,400	11,172.00	0.00
417	002602	世纪华通	600	11,118.00	0.00
418	600761	安徽合力	1,100	11,099.00	0.00
419	600195	中牧股份	600	10,980.00	0.00
420	603698	航天工程	400	10,976.00	0.00
421	603567	珍宝岛	500	10,925.00	0.00
422	601233	桐昆股份	1,000	10,860.00	0.00
423	601369	陕鼓动力	1,700	10,846.00	0.00
424	601678	滨化股份	2,120	10,790.80	0.00
425	002345	潮宏基	1,100	10,758.00	0.00
426	600720	祁连山	1,600	10,736.00	0.00
427	603699	纽威股份	600	10,644.00	0.00
428	000636	风华高科	1,200	10,608.00	0.00
429	600748	上实发展	1,100	10,604.00	0.00
430	600790	轻纺城	1,800	10,566.00	0.00

431	601126	四方股份	1,000	10,530.00	0.00
432	601801	皖新传媒	900	10,503.00	0.00
433	000919	金陵药业	800	10,472.00	0.00
434	601002	晋亿实业	1,200	10,440.00	0.00
435	603806	福斯特	200	10,438.00	0.00
436	002251	步步高	800	10,376.00	0.00
437	600329	中新药业	600	10,362.00	0.00
438	600825	新华传媒	1,300	10,335.00	0.00
439	002646	青青稞酒	500	10,305.00	0.00
440	600596	新安股份	1,400	10,206.00	0.00
441	601515	东风股份	900	10,170.00	0.00
442	600280	中央商场	1,500	10,140.00	0.00
443	600864	哈投股份	900	10,107.00	0.00
444	601168	西部矿业	1,700	10,081.00	0.00
445	002332	仙琚制药	900	10,080.00	0.00
446	600776	东方通信	1,200	10,068.00	0.00
447	600551	时代出版	500	9,980.00	0.00
448	603555	贵人鸟	400	9,972.00	0.00
449	603169	兰石重装	800	9,968.00	0.00
450	603883	老百姓	200	9,948.00	0.00
451	000877	天山股份	1,600	9,888.00	0.00
452	000703	恒逸石化	1,000	9,870.00	0.00
453	002342	巨力索具	1,700	9,860.00	0.00
454	002181	粤传媒	1,200	9,852.00	0.00
455	002408	齐翔腾达	1,760	9,662.40	0.00
456	601965	中国汽研	1,000	9,610.00	0.00
457	600251	冠农股份	1,200	9,600.00	0.00
458	002293	罗莱生活	700	9,590.00	0.00
459	600088	中视传媒	400	9,488.00	0.00
460	600657	信达地产	1,900	9,462.00	0.00
461	600466	蓝光发展	1,100	9,416.00	0.00
462	002327	富安娜	1,100	9,361.00	0.00
463	002122	天马股份	1,500	9,330.00	0.00
464	000030	富奥股份	1,300	9,321.00	0.00
465	600141	兴发集团	800	9,216.00	0.00
466	600617	国新能源	800	9,168.00	0.00
467	600132	重庆啤酒	600	9,114.00	0.00
468	600483	福能股份	800	9,080.00	0.00
469	600184	光电股份	400	9,056.00	0.00

470	000631	顺发恒业	1,844	8,980.28	0.00
471	002194	武汉凡谷	700	8,946.00	0.00
472	600425	青松建化	2,100	8,925.00	0.00
473	600874	创业环保	1,100	8,547.00	0.00
474	600743	华远地产	1,800	8,514.00	0.00
475	603001	奥康国际	400	8,504.00	0.00
476	600468	百利电气	600	8,490.00	0.00
477	601226	华电重工	900	8,253.00	0.00
478	600618	氯碱化工	600	7,878.00	0.00
479	600335	国机汽车	700	7,847.00	0.00
480	603355	莱克电气	200	7,620.00	0.00
481	600801	华新水泥	1,200	7,572.00	0.00
482	600397	安源煤业	1,700	7,514.00	0.00
483	002392	北京利尔	1,500	7,410.00	0.00
484	603589	口子窖	200	7,242.00	0.00
485	002238	天威视讯	500	7,235.00	0.00
486	002233	塔牌集团	900	7,227.00	0.00
487	600971	恒源煤电	1,300	7,176.00	0.00
488	600510	黑牡丹	800	6,976.00	0.00
489	002216	三全食品	800	6,880.00	0.00
490	002745	木林森	200	6,798.00	0.00
491	603025	大豪科技	200	6,714.00	0.00
492	600507	方大特钢	1,300	6,240.00	0.00
493	002678	珠江钢琴	500	6,135.00	0.00
494	002461	珠江啤酒	500	5,810.00	0.00
495	600917	重庆燃气	500	4,975.00	0.00
496	603198	迎驾贡酒	200	4,782.00	0.00
497	603568	伟明环保	200	4,620.00	0.00
498	600623	华谊集团	200	3,962.00	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	002466	天齐锂业	1,533,973.80	0.37
2	002085	万丰奥威	1,177,310.92	0.29

3	600201	生物股份	1,149,128.28	0.28
4	002030	达安基因	1,143,932.16	0.28
5	600079	人福医药	1,142,124.00	0.28
6	002701	奥瑞金	1,077,511.89	0.26
7	002400	省广股份	1,036,295.99	0.25
8	600525	长园集团	1,016,174.34	0.25
9	600521	华海药业	1,005,878.00	0.24
10	600673	东阳光科	1,004,292.00	0.24
11	300072	三聚环保	1,002,137.80	0.24
12	600978	宜华生活	1,001,740.00	0.24
13	600816	安信信托	1,001,306.00	0.24
14	600635	大众公用	993,223.10	0.24
15	002004	华邦健康	965,153.00	0.23
16	000887	中鼎股份	953,859.43	0.23
17	600482	中国动力	952,802.00	0.23
18	601012	隆基股份	950,948.11	0.23
19	600138	中青旅	939,405.84	0.23
20	600436	片仔癀	937,260.00	0.23

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	000973	佛塑科技	898,816.00	0.22
2	300043	互动娱乐	886,687.11	0.21
3	600851	海欣股份	550,698.00	0.13
4	601717	郑煤机	435,493.00	0.11
5	002568	百润股份	332,015.00	0.08
6	002466	天齐锂业	298,838.00	0.07
7	600859	王府井	261,296.00	0.06
8	002405	四维图新	226,143.00	0.05
9	002340	格林美	211,284.00	0.05
10	002437	誉衡药业	210,026.00	0.05
11	600522	中天科技	203,288.00	0.05
12	600201	生物股份	200,313.00	0.05
13	600079	人福医药	189,163.00	0.05

14	600143	金发科技	180,086.00	0.04
15	600521	华海药业	179,906.37	0.04
16	002085	万丰奥威	178,413.00	0.04
17	600584	长电科技	177,855.00	0.04
18	601012	隆基股份	176,885.00	0.04
19	600978	宜华生活	176,879.00	0.04
20	600503	华丽家族	175,739.00	0.04

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	235,633,487.51
卖出股票收入（成交）总额	44,053,782.55

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,300.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	2,300.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	23	2,300.00	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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	515,462,827.89	91.93

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.11.1 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
IC1607	中证 500 股指期货 IC1607 合约	5	6,043,400.00	196,760.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					196,760.00
股指期货投资本期收益 (元)					-274,861.82
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-347,538.18

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。本基金投资于股指期货的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。

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	1,373,609.28
2	应收证券清算款	1,404,415.89
3	应收股利	-
4	应收利息	7,834.38
5	应收申购款	1,626,069.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	4,411,928.57

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	600654	中安消	63,036.00	0.01	重大事项停牌
2	300166	东方国信	57,687.00	0.01	重大事项停牌
3	000511	*ST 烯碳	44,600.00	0.01	重大事项停牌
4	600497	驰宏锌锗	41,874.00	0.01	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
55,246	6,167.96	45,415,837.27	13.33%	295,339,416.54	86.67%

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	16,126.72	0.00%

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	0
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	208,255,614.26
本报告期基金总申购份额	259,165,880.62
减:本报告期基金总赎回份额	126,666,241.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	340,755,253.81

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

2016 年 1 月 5 日, 本基金管理人发布《关于嘉实中证 500ETF 联接基金经理变更的公告》, 杨宇先生不再担任本基金基金经理职务, 聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告, 戴京焦女士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

本报告期内, 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

报告期内, 本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1	142,963,805.97	51.12%	100,081.48	51.12%	-

有限公司						
中信建投证券股份有限公司	1	136,701,209.29	48.88%	95,691.74	48.88%	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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
中信建投证券股份有限公司	4,558.20	100.00%	-	-	-	-	-	-

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，能及时提供准确地信息资讯服务。

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：宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

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	关于嘉实中证 500ETF 联接基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 5 日
2	关于增加福建海峡银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 2 月 24 日
3	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司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	2016 年 3 月 18 日
4	关于增加大泰金石为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 6 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司申购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	2016 年 4 月 8 日
6	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与平安证券定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 3 日
7	关于增加联讯证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 6 日
8	关于增加北京葱次方嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 10 日
9	关于增加利得基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 5 月 30 日
10	关于增加徽商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 1 日

11	关于增加中正达广为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 8 日
12	关于增加天津银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 6 月 27 日
13	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展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	2016 年 6 月 30 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
2016 年 8 月 27 日