

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

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 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 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 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.....	63
8.7 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.....	63
8.8 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.....	63

8.9 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 .....	63
8.10 期末投资目标基金明细 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.13 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.3 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 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
11.2 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 .....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
12.1 备查文件目录 .....	71
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 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	356,775,373.10 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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-3,853,111.84	155,117,612.96	9,013,770.81
本期利润	-46,082,284.30	137,535,393.11	44,052,658.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1378	0.4969	0.4447
本期加权平均净值利润率	-8.24%	24.63%	34.59%
本期基金份额净值增长率	-14.27%	34.43%	34.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	249,776,346.16	157,465,090.71	34,284,188.60
期末可供分配基金份额利润	0.7001	0.7561	0.1885
期末基金资产净值	606,551,719.26	412,998,055.18	268,330,078.69
期末基金份额净值	1.7001	1.9831	1.4752
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	70.01%	98.31%	47.52%

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
过去三个月	-0.46%	0.77%	-0.95%	0.78%	0.49%	-0.01%
过去六个月	3.32%	0.87%	2.21%	0.88%	1.11%	-0.01%
过去一年	-14.27%	1.74%	-16.77%	1.81%	2.50%	-0.07%
过去三年	55.35%	1.96%	60.94%	1.98%	-5.59%	-0.02%

自基金合同 生效起至今	70.01%	1.84%	72.43%	1.87%	-2.42%	-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

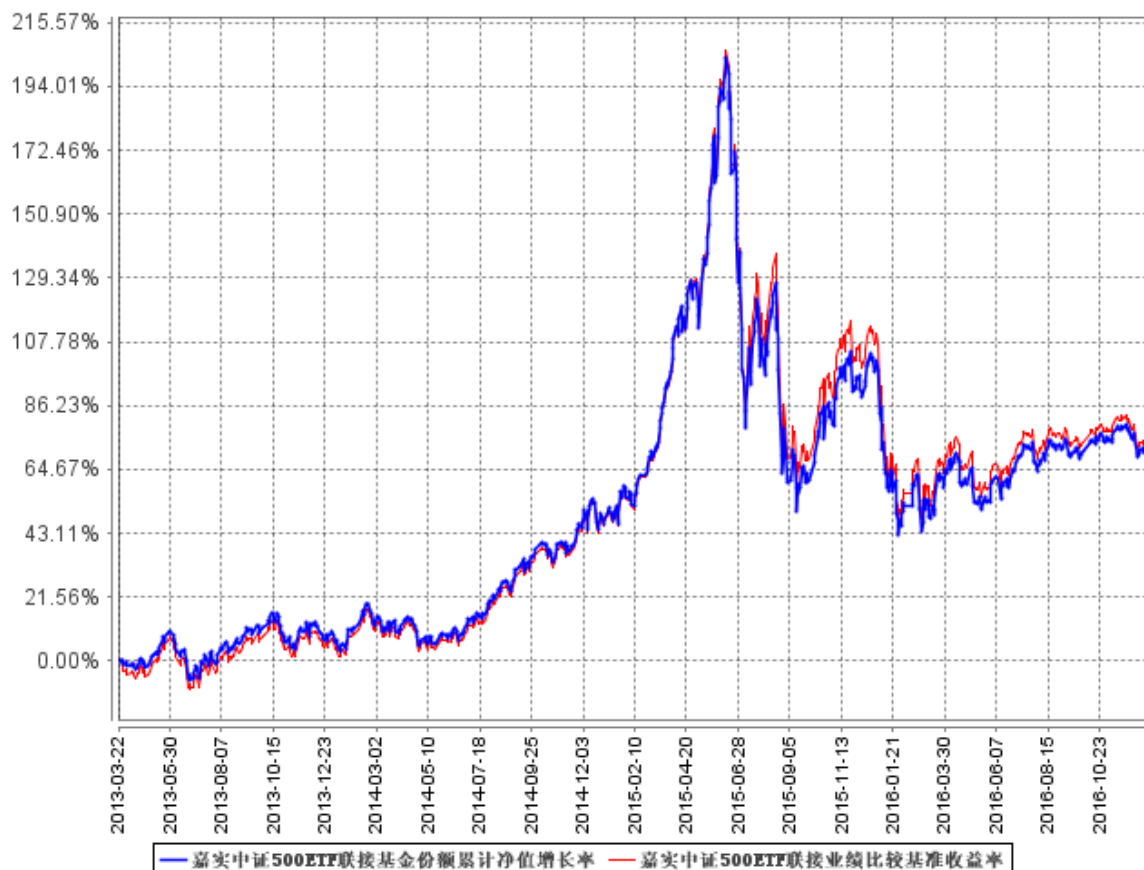
Return(t)=95%×中证 500 指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

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 12 月 31 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

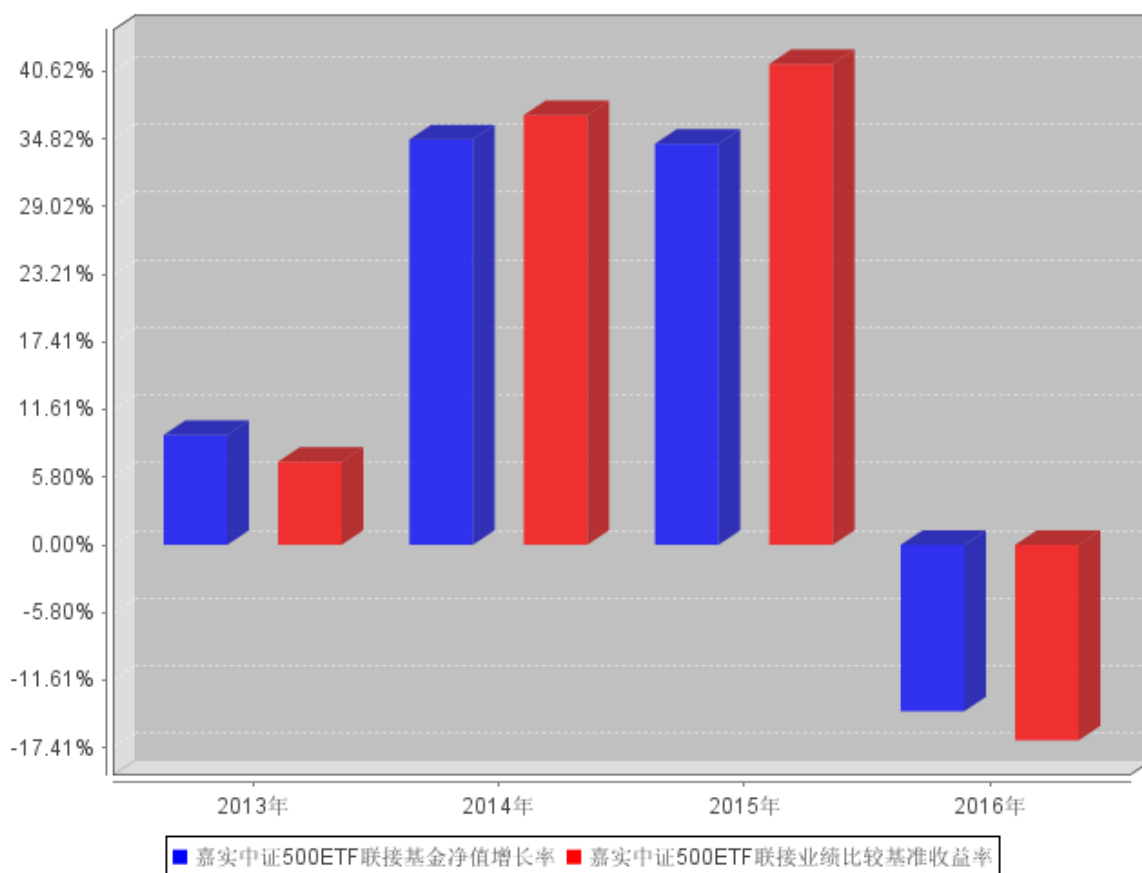


结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证 500ETF 联接自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 3 月 22 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 3 月 22 日至 2013 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

## § 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、111 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、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、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、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券。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 及其联接（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉	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

	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				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) 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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》, 按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定, 从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 杜绝不同投资组合之间进行利益输送, 保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议, 并在投资决策委员会的制度规范下独立决策, 实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离, 任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利, 共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易, 严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素, 交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.3 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 6 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

报告期内，基金日均跟踪误差为 0.09%，年度化拟合偏离度为 1.42%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于本基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红、样本股调整的冲击以及目标 ETF 偏离。

### 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 1.7001 元；本报告期基金份额净值增长率为-14.27%，业绩比较基准收益率为-16.77%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。报告期内，中证 500 指数下跌 17.78%。

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，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：完成大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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

力和相关工作经历。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但不限于上海、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。

#### 4.8 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 -46,082,284.30 元，以及基金合同（十五（三）基金收益分配原则）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。

#### 4.9 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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20615 号

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 联接基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实中证 500ETF 联接基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。



我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 审计意见

我们认为，上述嘉实中证 500ETF 联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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，公允反映了嘉实中证 500ETF 联接基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)  
中国·上海市

注册会计师  
许 康 玮  
张 勇

2017 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	36,752,219.64	23,043,706.58
结算备付金		991,718.04	7,896,429.23
存出保证金		1,339,584.59	2,069,466.22
交易性金融资产	7.4.7.2	568,114,221.71	381,236,188.66
其中：股票投资		5,663,018.40	5,410,766.55
基金投资		562,451,203.31	375,825,422.11
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	575,222.37
应收利息	7.4.7.5	8,809.02	12,217.73
应收股利		-	-
应收申购款		600,811.51	546,974.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	36,065.02	33,863.06
资产总计		607,843,429.53	415,414,067.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10.00	12,145.41
应付赎回款		734,593.27	1,404,360.82
应付管理人报酬		25,398.09	27,963.38
应付托管费		5,079.62	5,592.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	164,656.41	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	7.4.7.8	361,972.88	365,545.29
负债合计		1,291,710.27	2,416,012.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	356,775,373.10	208,255,614.26
未分配利润	7.4.7.10	249,776,346.16	204,742,440.92
所有者权益合计		606,551,719.26	412,998,055.18
负债和所有者权益总计		607,843,429.53	415,414,067.96

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7001 元，基金份额总额 356,775,373.10 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		-44,497,402.64	140,742,676.66
1.利息收入		297,458.55	342,807.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	297,456.43	342,807.92
债券利息收入		2.12	-
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		-3,369,495.84	155,043,862.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,445,057.73	22,572,451.77
基金投资收益	7.4.7.13	-1,796,956.76	130,315,203.01
债券投资收益	7.4.7.14	2,130.48	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	775,018.18	2,035,301.82
股利收益	7.4.7.16	95,369.99	120,905.70
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	-42,229,172.46	-17,582,219.85
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	803,807.11	2,938,226.29
<b>减：二、费用</b>		1,584,881.66	3,207,283.55
1. 管理人报酬		276,115.70	270,651.94

2. 托管费		55,223.15	54,130.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	870,000.80	2,478,111.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	383,542.01	404,390.03
<b>三、利润总额</b>		-46,082,284.30	137,535,393.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-46,082,284.30	137,535,393.11

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-46,082,284.30	-46,082,284.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	148,519,758.84	91,116,189.54	239,635,948.38
其中：1.基金申购款	539,402,905.14	363,776,439.43	903,179,344.57
2.基金赎回款	-390,883,146.30	-272,660,249.89	-663,543,396.19
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）	356,775,373.10	249,776,346.16	606,551,719.26
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	-	137,535,393.11	137,535,393.11

基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	26,361,287.36	-19,228,703.98	7,132,583.38
其中：1.基金申购款	1,165,449,713.91	1,215,094,366.00	2,380,544,079.91
2.基金赎回款	-1,139,088,426.55	-1,234,323,069.98	-2,373,411,496.53
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）	208,255,614.26	204,742,440.92	412,998,055.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

### 7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定

公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。



#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益每年最多分配 6 次，每基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每基金份额可供分配利润的 10%。本基金收益分配方式分为两种，现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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政策的补充通知》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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	36,752,219.64	23,043,706.58

定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	36,752,219.64	23,043,706.58

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,740,224.64	5,663,018.40	-77,206.24
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	582,924,930.68	562,451,203.31	-20,473,727.37
其他	-	-	-
合计	588,665,155.32	568,114,221.71	-20,550,933.61
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,336,311.72	5,410,766.55	74,454.83
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	354,954,896.27	375,825,422.11	20,870,525.84
其他	-	-	-
合计	360,291,207.99	381,236,188.66	20,944,980.67

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	6,406,160.00	-	-	
其中：股指期货投资	6,406,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	6,406,160.00	-	-	

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
IC1701	中证 500 股指期货 IC1701 合约	5	6,217,200.00	-188,960.00
总额合计	-	-	-	-188,960.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-188,960.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

单位：人民币元

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 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	8,334,501.82	-	-	
其中：股指期货投资	8,334,501.82	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	8,334,501.82	-	-	

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
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	6	8,878,800.00	544,298.18
总额合计	-	-	-	544,298.18
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	544,298.18
股指期货投资净额	-	-	-	-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,218.39	6,587.12
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	64.30	971.37
应收债券利息	-	-
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	526.33	4,659.24
合计	8,809.02	12,217.73

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收替代款	36,065.02	33,863.06
待摊费用	-	-
合计	36,065.02	33,863.06

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	164,656.41	600,405.20
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	164,656.41	600,405.20
----	------------	------------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付赎回费	1,972.88	5,545.29
预提费用	360,000.00	360,000.00
合计	361,972.88	365,545.29

#### 7.4.7.9 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12月31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	539,402,905.14	539,402,905.14
本期赎回	-390,883,146.30	-390,883,146.30
本期末	356,775,373.10	356,775,373.10

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	-3,853,111.84	-42,229,172.46	-46,082,284.30
本期基金份额交易产生的变动数	110,973,362.00	-19,857,172.46	91,116,189.54
其中：基金申购款	401,870,898.60	-38,094,459.17	363,776,439.43
基金赎回款	-290,897,536.60	18,237,286.71	-272,660,249.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	264,585,340.87	-14,808,994.71	249,776,346.16

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

	月 31 日	日
活期存款利息收入	246,245.78	263,546.83
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	6,333.77	50,497.59
其他	44,876.88	28,763.50
合计	297,456.43	342,807.92

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-127,474.93	-6,023,357.72
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-2,317,582.80	28,595,809.49
合计	-2,445,057.73	22,572,451.77

##### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	263,278,460.17	848,259,870.49
减：卖出股票成本总额	263,405,935.10	854,283,228.21
买卖股票差价收入	-127,474.93	-6,023,357.72

##### 7.4.7.12.3 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
申购基金份额总额	446,853,330.00	1,259,537,175.00
减：现金支付申购款总额	31,795,606.38	204,063,709.89
减：申购股票成本总额	417,375,306.42	1,026,877,655.62
申购差价收入	-2,317,582.80	28,595,809.49



**7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	217,021,766.08	1,276,410,658.10
减：卖出/赎回基金成本总额	218,818,722.84	1,146,095,455.09
基金投资收益	-1,796,956.76	130,315,203.01

**7.4.7.14 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,532.60	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,400.00	-
减：应收利息总额	2.12	-
买卖债券差价收入	2,130.48	-

注：上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金无债券投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 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12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金无买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月31日
股指期货投资收益	775,018.18	2,035,301.82

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

股票投资产生的股利收益	95,369.99	120,905.70
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	95,369.99	120,905.70

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-41,495,914.28	-18,126,518.03
——股票投资	-151,661.07	9,360.21
——债券投资	-	-
——基金投资	-41,344,253.21	-18,135,878.24
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-733,258.18	544,298.18
——权证投资	-	-
——期货投资	-733,258.18	544,298.18
3. 其他	-	-
合计	-42,229,172.46	-17,582,219.85

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
基金赎回费收入	447,239.20	2,250,881.50
基金转出费收入	356,567.91	687,344.79
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	803,807.11	2,938,226.29

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日

交易所市场交易费用	870,000.80	2,478,111.19
银行间市场交易费用	-	-
合计	870,000.80	2,478,111.19

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	10,500.00	18,000.00
银行划款手续费	12,842.01	26,190.03
指数使用费	-	-
上市年费	-	-
红利手续费	-	-
其他	200.00	200.00
合计	383,542.01	404,390.03

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

### 7.4.9 关联方关系

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
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金

### 7.4.10 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。

#### 7.4.10.1 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	276,115.70	270,651.94
其中：支付销售机构的客户维护费	772,164.59	703,387.69

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。

**7.4.10.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,223.15	54,130.39

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。

**7.4.10.3 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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。

**7.4.10.4.2 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 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

**7.4.10.5 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 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	36,752,219.64	246,245.78	23,043,706.58	263,546.83

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。

**7.4.10.6 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2016 年 12 月 31 日），本基金持有 89,188,780.00 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 59.89%（2015 年 12 月 31 日：43.33%）。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项停牌	13.79	-	-	21,500	294,489.01	296,485.00	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	重大事项停牌	39.40	-	-	3,000	118,200.00	118,200.00	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大事项停牌	20.32	-	-	5,600	114,350.62	113,792.00	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大事项停牌	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	3,400	82,517.90	88,196.00	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项停牌	7.83	-	-	10,200	82,518.27	79,866.00	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项停牌	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	1,700	73,145.81	79,713.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大事项停牌	20.31	-	-	3,900	80,579.58	79,209.00	-

600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项停牌	7.29	-	-	10,600	75,808.19	77,274.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	15.80	-	-	4,500	72,006.16	71,100.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大事项停牌	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	9,100	57,172.16	68,068.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项停牌	23.51	-	-	2,800	63,296.52	65,828.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	18.82	-	-	3,400	65,230.64	63,988.00	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项停牌	11.42	-	-	5,400	60,056.51	61,668.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项停牌	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	17,500	58,348.55	58,975.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事项停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	3,200	49,774.94	52,288.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项停牌	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	3,300	53,626.92	51,282.00	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项停牌	10.97	-	-	4,500	50,014.18	49,365.00	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大事项停牌	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	2,900	48,592.22	47,618.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项停牌	11.28	-	-	3,800	44,555.99	42,864.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大事项停牌	26.80	-	-	1,500	43,677.78	40,200.00	-

002025	航天电 器	2016年9 月12日	重大事 项停牌	25.20	-	-	1,400	34,724.61	35,280.00	-
600171	上海贝 岭	2016年 12月14 日	重大事 项停牌	14.05	2017年2 月16日	14.90	2,500	36,983.02	35,125.00	-
600859	王府井	2016年9 月27日	重大事 项停牌	16.28	-	-	2,080	34,742.96	33,862.40	-
002396	星网锐 捷	2016年9 月12日	重大事 项停牌	19.70	2017年2 月21日	18.35	1,700	33,679.81	33,490.00	-
002635	安洁科 技	2016年 11月8日	重大事 项停牌	36.40	2017年2 月8日	33.50	800	27,865.09	29,120.00	-
603169	兰石重 装	2016年 11月24 日	重大事 项停牌	13.36	2017年3 月21日	14.32	2,000	25,788.35	26,720.00	-
002681	奋达科 技	2016年 12月19 日	重大事 项停牌	12.93	-	-	1,900	25,242.52	24,567.00	-
601005	重庆钢 铁	2016年6 月2日	重大事 项停牌	2.52	-	-	6,100	15,979.86	15,372.00	-
002745	木林森	2016年7 月18日	重大事 项停牌	33.50	-	-	300	9,824.32	10,050.00	-
600537	亿晶光 电	2016年 12月27 日	重大事 项停牌	7.43	2017年1 月13日	8.17	700	5,109.30	5,201.00	-
002727	一心堂	2016年 12月28 日	重大事 项停牌	21.20	2017年1 月5日	21.66	200	4,256.90	4,240.00	-
603555	贵人鸟	2016年 12月12 日	重大事 项停牌	30.76	-	-	100	3,024.00	3,076.00	-

注:根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份



有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》,长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票,以换股比例 1: 0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票,吸收合并长城信息;长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通,当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本期末(2016 年 12 月 31 日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本期末(2016 年 12 月 31 日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	36,752,219.64	-	-	-	36,752,219.64

结算备付金	991,718.04	-	-	-	991,718.04
存出保证金	96,144.59	-	-	1,243,440.00	1,339,584.59
交易性金融资产	-	-	-	568,114,221.71	568,114,221.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,809.02	8,809.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	45,580.34	-	-	555,231.17	600,811.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	36,065.02	36,065.02
资产总计	37,885,662.61	-	-	569,957,766.92	607,843,429.53
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	-	-	-	10.00	10.00
应付赎回款	-	-	-	734,593.27	734,593.27
应付管理人报酬	-	-	-	25,398.09	25,398.09
应付托管费	-	-	-	5,079.62	5,079.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	164,656.41	164,656.41
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	361,972.88	361,972.88
负债总计	-	-	-	1,291,710.27	1,291,710.27
利率敏感度缺口	37,885,662.61	-	-	568,666,056.65	606,551,719.26
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	5,663,018.40	0.93	5,410,766.55	1.31
交易性金融资产—基金投资	562,451,203.31	92.73	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	568,114,221.71	93.66	381,236,188.66	92.31

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	29,160,088.67	20,630,088.93
业绩比较基准下降 5%	-29,160,088.67	-20,630,088.93	

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 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 566,252,139.31 元，属于第二层次的余额为 1,862,082.40 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	5,663,018.40	0.93
	其中：股票	5,663,018.40	0.93
2	基金投资	562,451,203.31	92.53
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	37,743,937.68	6.21
8	其他各项资产	1,985,270.14	0.33
	合计	607,843,429.53	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	46,983.00	0.01
B	采矿业	259,264.00	0.04
C	制造业	3,371,644.00	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,405.00	0.02
E	建筑业	139,931.00	0.02
F	批发和零售业	376,125.40	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	115,625.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-



I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,631.00	0.04
J	金融业	94,355.00	0.02
K	房地产业	263,216.00	0.04
L	租赁和商务服务业	340,175.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	42,959.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	17,760.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,000.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	169,526.00	0.03
S	综合	33,419.00	0.01
	合计	5,663,018.40	0.93

### 8.3 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	002400	省广股份	21,500	296,485.00	0.05
2	600161	天坛生物	3,000	118,200.00	0.02
3	600551	时代出版	5,600	113,792.00	0.02
4	000887	中鼎股份	3,400	88,196.00	0.01
5	601168	西部矿业	10,200	79,866.00	0.01
6	002602	世纪华通	1,700	79,713.00	0.01
7	000748	长城信息	3,900	79,209.00	0.01
8	600673	东阳光科	10,600	77,274.00	0.01
9	300088	长信科技	4,500	71,100.00	0.01
10	000563	陕国投 A	9,100	68,068.00	0.01
11	000697	炼石有色	2,800	65,828.00	0.01
12	000050	深天马 A	3,400	63,988.00	0.01
13	600655	豫园商城	5,400	61,668.00	0.01
14	000727	华东科技	17,500	58,975.00	0.01
15	002440	闰土股份	3,200	52,288.00	0.01
16	002491	通鼎互联	3,300	51,282.00	0.01
17	600151	航天机电	4,500	49,365.00	0.01
18	600687	刚泰控股	2,900	47,618.00	0.01

19	000829	天音控股	3,800	42,864.00	0.01
20	600645	中源协和	1,500	40,200.00	0.01
21	002025	航天电器	1,400	35,280.00	0.01
22	600171	上海贝岭	2,500	35,125.00	0.01
23	600859	王府井	2,080	33,862.40	0.01
24	002396	星网锐捷	1,700	33,490.00	0.01
25	002635	安洁科技	800	29,120.00	0.00
26	603169	兰石重装	2,000	26,720.00	0.00
27	002681	奋达科技	1,900	24,567.00	0.00
28	002663	普邦股份	4,000	24,280.00	0.00
29	600120	浙江东方	800	23,136.00	0.00
30	600201	生物股份	700	22,113.00	0.00
31	600584	长电科技	1,200	21,180.00	0.00
32	600525	长园集团	1,440	20,088.00	0.00
33	600522	中天科技	1,900	20,007.00	0.00
34	300136	信维通信	700	19,950.00	0.00
34	600079	人福医药	1,000	19,950.00	0.00
35	000656	金科股份	3,800	19,912.00	0.00
36	600487	亨通光电	1,000	18,660.00	0.00
37	600643	爱建集团	1,500	18,615.00	0.00
38	600436	片仔癀	400	18,316.00	0.00
39	300156	神雾环保	700	17,507.00	0.00
40	002405	四维图新	900	17,415.00	0.00
41	600219	南山铝业	5,500	16,995.00	0.00
42	002092	中泰化学	1,400	16,940.00	0.00
43	600699	均胜电子	500	16,545.00	0.00
44	600158	中体产业	700	16,499.00	0.00
45	600315	上海家化	600	16,266.00	0.00
46	002572	索菲亚	300	16,248.00	0.00
47	002422	科伦药业	1,000	16,120.00	0.00
48	300244	迪安诊断	500	16,000.00	0.00
49	000581	威孚高科	700	15,708.00	0.00
50	300115	长盈精密	600	15,636.00	0.00
51	002223	鱼跃医疗	500	15,510.00	0.00
52	601005	重庆钢铁	6,100	15,372.00	0.00
53	600682	南京新百	400	14,908.00	0.00
54	601012	隆基股份	1,100	14,729.00	0.00
55	600138	中青旅	700	14,679.00	0.00
56	002439	启明星辰	700	14,553.00	0.00

57	002179	中航光电	400	14,516.00	0.00
58	002176	江特电机	1,200	14,316.00	0.00
59	002168	深圳惠程	900	14,274.00	0.00
60	600166	福田汽车	4,600	14,214.00	0.00
61	600664	哈药股份	1,600	13,728.00	0.00
62	600879	航天电子	900	13,716.00	0.00
63	002004	华邦健康	1,500	13,605.00	0.00
64	300026	红日药业	2,500	13,575.00	0.00
65	300296	利亚德	400	13,488.00	0.00
66	000930	中粮生化	1,000	13,440.00	0.00
67	002460	赣锋锂业	500	13,255.00	0.00
68	600426	华鲁恒升	1,000	13,250.00	0.00
69	002340	格林美	2,000	13,100.00	0.00
70	000690	宝新能源	1,400	12,978.00	0.00
71	002701	奥瑞金	1,500	12,960.00	0.00
72	002657	中科金财	300	12,948.00	0.00
73	603589	口子窖	400	12,852.00	0.00
74	000400	许继电气	700	12,705.00	0.00
75	600198	大唐电信	800	12,696.00	0.00
76	600497	驰宏锌锗	1,800	12,654.00	0.00
77	000961	中南建设	1,200	12,480.00	0.00
78	600143	金发科技	1,600	12,448.00	0.00
79	600503	华丽家族	1,500	12,435.00	0.00
80	300159	新研股份	900	12,222.00	0.00
81	002353	杰瑞股份	600	12,180.00	0.00
82	600635	大众公用	2,000	12,020.00	0.00
83	000970	中科三环	900	12,015.00	0.00
84	600266	北京城建	900	11,997.00	0.00
85	600694	大商股份	300	11,979.00	0.00
86	600565	迪马股份	1,600	11,872.00	0.00
87	600240	华业资本	1,100	11,814.00	0.00
88	600759	洲际油气	1,200	11,784.00	0.00
89	002001	新和成	600	11,760.00	0.00
90	300253	卫宁健康	600	11,754.00	0.00
91	600435	北方导航	900	11,736.00	0.00
92	600978	宜华生活	1,100	11,715.00	0.00
93	600751	天海投资	1,400	11,704.00	0.00
94	600614	鼎立股份	1,000	11,700.00	0.00
95	600500	中化国际	1,000	11,660.00	0.00

96	000997	新大陆	600	11,658.00	0.00
97	300324	旋极信息	600	11,598.00	0.00
98	600418	江淮汽车	1,000	11,560.00	0.00
99	300055	万邦达	700	11,466.00	0.00
100	002250	联化科技	700	11,326.00	0.00
101	002544	杰赛科技	400	11,256.00	0.00
102	000959	首钢股份	1,700	11,254.00	0.00
103	000661	长春高新	100	11,185.00	0.00
104	600388	龙净环保	900	11,133.00	0.00
105	603019	中科曙光	400	11,128.00	0.00
106	600516	方大炭素	1,200	11,112.00	0.00
107	000806	银河生物	700	11,088.00	0.00
108	002048	宁波华翔	500	11,070.00	0.00
109	600521	华海药业	500	11,015.00	0.00
110	600549	厦门钨业	500	11,010.00	0.00
111	600528	中铁二局	800	11,008.00	0.00
112	002408	齐翔腾达	1,000	11,000.00	0.00
113	600122	宏图高科	900	10,998.00	0.00
114	300266	兴源环境	200	10,976.00	0.00
115	002013	中航机电	600	10,974.00	0.00
116	600312	平高电气	700	10,934.00	0.00
117	002407	多氟多	400	10,916.00	0.00
118	600410	华胜天成	1,000	10,870.00	0.00
119	002271	东方雨虹	500	10,845.00	0.00
120	300199	翰宇药业	600	10,788.00	0.00
121	300113	顺网科技	400	10,756.00	0.00
122	002217	合力泰	600	10,740.00	0.00
123	600811	东方集团	1,500	10,725.00	0.00
124	002366	台海核电	200	10,724.00	0.00
125	000998	隆平高科	500	10,715.00	0.00
126	000078	海王生物	1,700	10,710.00	0.00
127	002038	双鹭药业	400	10,684.00	0.00
128	600094	大名城	1,200	10,680.00	0.00
129	600755	厦门国贸	1,300	10,660.00	0.00
130	000878	云南铜业	900	10,629.00	0.00
131	002672	东江环保	600	10,560.00	0.00
132	002311	海大集团	700	10,535.00	0.00
133	000960	锡业股份	800	10,496.00	0.00
134	002573	清新环境	600	10,482.00	0.00

135	000612	焦作万方	900	10,395.00	0.00
136	600881	亚泰集团	1,900	10,393.00	0.00
137	603766	隆鑫通用	500	10,390.00	0.00
138	000598	兴蓉环境	1,800	10,368.00	0.00
139	000488	晨鸣纸业	1,000	10,360.00	0.00
140	600851	海欣股份	800	10,344.00	0.00
141	000939	凯迪生态	800	10,296.00	0.00
142	000786	北新建材	1,000	10,290.00	0.00
143	600325	华发股份	800	10,240.00	0.00
144	300273	和佳股份	600	10,236.00	0.00
145	002410	广联达	700	10,220.00	0.00
146	000012	南玻A	900	10,206.00	0.00
147	000566	海南海药	800	10,168.00	0.00
148	600601	方正科技	2,200	10,120.00	0.00
149	002745	木林森	300	10,050.00	0.00
149	600064	南京高科	600	10,050.00	0.00
150	600587	新华医疗	400	10,044.00	0.00
151	600478	科力远	1,000	10,000.00	0.00
152	600594	益佰制药	600	9,990.00	0.00
153	600787	中储股份	1,100	9,977.00	0.00
154	000667	美好置业	2,700	9,963.00	0.00
155	002273	水晶光电	500	9,950.00	0.00
156	002221	东华能源	800	9,912.00	0.00
157	000999	华润三九	400	9,892.00	0.00
158	300122	智飞生物	600	9,882.00	0.00
159	600176	中国巨石	1,000	9,840.00	0.00
160	600316	洪都航空	500	9,830.00	0.00
161	000031	中粮地产	1,100	9,812.00	0.00
162	002384	东山精密	500	9,805.00	0.00
163	600575	皖江物流	1,700	9,775.00	0.00
164	002589	瑞康医药	300	9,735.00	0.00
165	601699	潞安环能	1,200	9,660.00	0.00
166	002665	首航节能	1,100	9,636.00	0.00
167	601000	唐山港	2,400	9,624.00	0.00
167	600536	中国软件	400	9,624.00	0.00
168	002190	成飞集成	300	9,594.00	0.00
169	600026	中远海能	1,400	9,534.00	0.00
170	600160	巨化股份	900	9,522.00	0.00
171	300287	飞利信	800	9,520.00	0.00

172	600056	中国医药	500	9,515.00	0.00
173	000979	中弘股份	3,600	9,504.00	0.00
174	600572	康恩贝	1,300	9,503.00	0.00
175	600967	北方创业	700	9,499.00	0.00
176	000825	太钢不锈	2,400	9,456.00	0.00
177	000988	华工科技	600	9,390.00	0.00
178	000975	银泰资源	600	9,384.00	0.00
179	002191	劲嘉股份	900	9,369.00	0.00
180	002444	巨星科技	600	9,360.00	0.00
181	600260	凯乐科技	600	9,288.00	0.00
182	600639	浦东金桥	500	9,280.00	0.00
182	002030	达安基因	400	9,280.00	0.00
183	600750	江中药业	300	9,246.00	0.00
184	600267	海正药业	700	9,205.00	0.00
185	002368	太极股份	300	9,183.00	0.00
186	002019	亿帆医药	600	9,174.00	0.00
187	002155	湖南黄金	800	9,160.00	0.00
188	002018	华信国际	900	9,153.00	0.00
189	600108	亚盛集团	1,600	9,152.00	0.00
190	002640	跨境通	500	9,150.00	0.00
191	600597	光明乳业	700	9,142.00	0.00
192	600499	科达洁能	1,200	9,072.00	0.00
192	600717	天津港	900	9,072.00	0.00
193	600511	国药股份	300	9,030.00	0.00
194	002276	万马股份	600	9,018.00	0.00
195	600039	四川路桥	1,900	9,006.00	0.00
196	600098	广州发展	800	8,976.00	0.00
197	601880	大连港	3,200	8,960.00	0.00
198	000777	中核科技	400	8,952.00	0.00
199	600863	内蒙华电	2,900	8,932.00	0.00
200	603188	亚邦股份	500	8,930.00	0.00
201	300291	华录百纳	400	8,912.00	0.00
202	600298	安琪酵母	500	8,910.00	0.00
203	000685	中山公用	800	8,904.00	0.00
204	002390	信邦制药	900	8,901.00	0.00
205	002479	富春环保	600	8,892.00	0.00
206	002122	天马股份	700	8,883.00	0.00
207	600216	浙江医药	700	8,876.00	0.00
208	600600	青岛啤酒	300	8,832.00	0.00

208	002050	三花智控	800	8,832.00	0.00
209	600633	浙报传媒	500	8,830.00	0.00
210	600416	湘电股份	600	8,826.00	0.00
210	601689	拓普集团	300	8,826.00	0.00
211	000860	顺鑫农业	400	8,800.00	0.00
211	000089	深圳机场	1,100	8,800.00	0.00
211	600183	生益科技	800	8,800.00	0.00
212	601929	吉视传媒	2,100	8,799.00	0.00
213	000758	中色股份	1,100	8,789.00	0.00
214	000592	平潭发展	1,300	8,788.00	0.00
215	600808	马钢股份	3,100	8,773.00	0.00
216	000066	长城电脑	700	8,708.00	0.00
217	600466	蓝光发展	900	8,703.00	0.00
218	002078	太阳纸业	1,300	8,684.00	0.00
218	600300	维维股份	1,300	8,684.00	0.00
219	002503	搜于特	600	8,634.00	0.00
220	002603	以岭药业	500	8,620.00	0.00
221	600765	中航重机	600	8,598.00	0.00
222	300257	开山股份	500	8,580.00	0.00
223	000669	金鸿能源	500	8,575.00	0.00
224	600611	大众交通	1,300	8,541.00	0.00
225	002477	雏鹰农牧	1,700	8,534.00	0.00
226	000762	西藏矿业	500	8,515.00	0.00
227	000006	深振业 A	900	8,505.00	0.00
228	600022	山东钢铁	3,400	8,500.00	0.00
229	600259	广晟有色	200	8,498.00	0.00
230	600557	康缘药业	500	8,465.00	0.00
231	002375	亚厦股份	800	8,464.00	0.00
232	600307	酒钢宏兴	3,100	8,463.00	0.00
233	600409	三友化工	900	8,451.00	0.00
234	600884	杉杉股份	600	8,448.00	0.00
234	600872	中炬高新	600	8,448.00	0.00
235	300274	阳光电源	800	8,432.00	0.00
236	002595	豪迈科技	400	8,420.00	0.00
237	000543	皖能电力	1,100	8,371.00	0.00
238	002261	拓维信息	700	8,344.00	0.00
239	000401	冀东水泥	700	8,330.00	0.00
240	002489	浙江永强	1,100	8,327.00	0.00
241	300166	东方国信	400	8,316.00	0.00

242	300010	立思辰	500	8,310.00	0.00
243	002373	千方科技	600	8,280.00	0.00
244	002437	誉衡药业	1,000	8,270.00	0.00
245	002431	棕榈股份	900	8,244.00	0.00
246	601311	骆驼股份	500	8,165.00	0.00
246	002512	达华智能	500	8,165.00	0.00
247	600422	昆药集团	600	8,106.00	0.00
248	600348	阳泉煤业	1,200	8,076.00	0.00
249	002266	浙富控股	1,400	8,064.00	0.00
250	002022	科华生物	400	8,000.00	0.00
251	600392	盛和资源	600	7,998.00	0.00
252	600993	马应龙	400	7,988.00	0.00
253	002371	七星电子	300	7,980.00	0.00
254	600380	健康元	800	7,944.00	0.00
255	600284	浦东建设	600	7,914.00	0.00
256	600366	宁波韵升	400	7,876.00	0.00
257	000848	承德露露	700	7,833.00	0.00
258	000501	鄂武商 A	400	7,808.00	0.00
258	600835	上海机电	400	7,808.00	0.00
259	002707	众信旅游	500	7,775.00	0.00
260	300147	香雪制药	600	7,740.00	0.00
261	600200	江苏吴中	400	7,724.00	0.00
262	600017	日照港	1,900	7,695.00	0.00
263	600291	西水股份	400	7,672.00	0.00
264	000926	福星股份	600	7,644.00	0.00
265	000620	新华联	900	7,632.00	0.00
265	000816	智慧农业	1,200	7,632.00	0.00
266	600086	东方金钰	700	7,616.00	0.00
267	600058	五矿发展	500	7,615.00	0.00
268	300134	大富科技	300	7,608.00	0.00
269	002428	云南锗业	600	7,602.00	0.00
270	600187	国中水务	1,400	7,546.00	0.00
271	000021	深科技	800	7,544.00	0.00
272	002123	梦网荣信	500	7,500.00	0.00
273	300297	蓝盾股份	600	7,464.00	0.00
274	000519	江南红箭	500	7,450.00	0.00
275	000587	金洲慈航	500	7,440.00	0.00
276	600175	美都能源	1,500	7,425.00	0.00
277	002482	广田集团	800	7,400.00	0.00



278	300202	聚龙股份	300	7,380.00	0.00
279	600651	飞乐音响	700	7,371.00	0.00
280	601010	文峰股份	1,400	7,364.00	0.00
281	002508	老板电器	200	7,360.00	0.00
282	002002	鸿达兴业	1,000	7,340.00	0.00
283	600545	新疆城建	600	7,296.00	0.00
284	002581	未名医药	300	7,281.00	0.00
285	600125	铁龙物流	900	7,272.00	0.00
286	600169	太原重工	1,800	7,254.00	0.00
287	600770	综艺股份	700	7,245.00	0.00
288	600736	苏州高新	800	7,224.00	0.00
289	600433	冠豪高新	900	7,218.00	0.00
290	002242	九阳股份	400	7,212.00	0.00
291	002325	洪涛股份	900	7,209.00	0.00
292	002277	友阿股份	500	7,180.00	0.00
293	600067	冠城大通	1,000	7,160.00	0.00
294	000600	建投能源	800	7,104.00	0.00
295	600970	中材国际	1,000	7,090.00	0.00
296	000810	创维数字	500	7,035.00	0.00
297	601717	郑煤机	1,000	7,030.00	0.00
298	601801	皖新传媒	400	7,028.00	0.00
299	300001	特锐德	400	6,936.00	0.00
300	000541	佛山照明	700	6,888.00	0.00
301	002051	中工国际	300	6,876.00	0.00
302	600073	上海梅林	600	6,870.00	0.00
303	600894	广日股份	500	6,835.00	0.00
304	002414	高德红外	300	6,834.00	0.00
305	600517	置信电气	700	6,811.00	0.00
306	002588	史丹利	600	6,810.00	0.00
306	002073	软控股份	600	6,810.00	0.00
307	000090	天健集团	700	6,762.00	0.00
308	002699	美盛文化	200	6,760.00	0.00
309	002106	莱宝高科	600	6,744.00	0.00
310	000937	冀中能源	1,000	6,740.00	0.00
311	000028	国药一致	100	6,690.00	0.00
312	000652	泰达股份	1,200	6,624.00	0.00
313	002028	思源电气	500	6,590.00	0.00
314	001696	宗申动力	700	6,580.00	0.00
315	601678	滨化股份	900	6,561.00	0.00

316	600720	祁连山	800	6,536.00	0.00
317	002269	美邦服饰	1,300	6,513.00	0.00
318	600282	南钢股份	2,100	6,510.00	0.00
318	600220	江苏阳光	1,500	6,510.00	0.00
319	600289	亿阳信通	500	6,475.00	0.00
320	300032	金龙机电	400	6,436.00	0.00
321	000572	海马汽车	1,200	6,432.00	0.00
322	601231	环旭电子	600	6,426.00	0.00
323	000726	鲁泰 A	500	6,405.00	0.00
324	600277	亿利洁能	900	6,399.00	0.00
325	601886	江河集团	600	6,390.00	0.00
326	002690	美亚光电	300	6,348.00	0.00
327	002268	卫士通	200	6,284.00	0.00
328	002244	滨江集团	900	6,282.00	0.00
329	000616	海航投资	1,200	6,264.00	0.00
330	002463	沪电股份	1,300	6,214.00	0.00
331	002254	泰和新材	500	6,180.00	0.00
332	000830	鲁西化工	1,100	6,149.00	0.00
333	603077	和邦生物	1,200	6,144.00	0.00
333	600596	新安股份	600	6,144.00	0.00
334	600880	博瑞传播	700	6,132.00	0.00
335	002029	七匹狼	600	6,126.00	0.00
336	600862	中航高科	500	6,120.00	0.00
337	000680	山推股份	1,100	6,083.00	0.00
338	002285	世联行	800	6,080.00	0.00
339	002345	潮宏基	500	6,040.00	0.00
340	002064	华峰氨纶	1,100	6,039.00	0.00
341	002505	大康农业	1,700	6,018.00	0.00
342	600481	双良节能	800	6,016.00	0.00
343	000703	恒逸石化	400	6,012.00	0.00
344	000897	津滨发展	1,400	5,992.00	0.00
345	600773	西藏城投	500	5,965.00	0.00
346	000513	丽珠集团	100	5,950.00	0.00
347	600805	悦达投资	700	5,943.00	0.00
348	603567	珍宝岛	300	5,928.00	0.00
348	600351	亚宝药业	600	5,928.00	0.00
349	002308	威创股份	400	5,896.00	0.00
350	002416	爱施德	400	5,892.00	0.00
351	000099	中信海直	500	5,855.00	0.00

352	000528	柳工	800	5,848.00	0.00
353	000861	海印股份	1,200	5,820.00	0.00
354	600757	长江传媒	700	5,817.00	0.00
355	002646	青青稞酒	300	5,775.00	0.00
356	002161	远望谷	500	5,765.00	0.00
357	600790	轻纺城	800	5,760.00	0.00
358	002358	森源电气	300	5,754.00	0.00
359	002005	德豪润达	1,000	5,750.00	0.00
360	000681	视觉中国	300	5,718.00	0.00
361	002011	盾安环境	600	5,712.00	0.00
361	601002	晋亿实业	600	5,712.00	0.00
362	002309	中利科技	400	5,684.00	0.00
363	600458	时代新材	400	5,660.00	0.00
363	002344	海宁皮城	500	5,660.00	0.00
364	600628	新世界	400	5,652.00	0.00
365	600395	盘江股份	700	5,649.00	0.00
366	600823	世茂股份	800	5,616.00	0.00
367	600460	士兰微	900	5,598.00	0.00
368	002498	汉缆股份	1,300	5,590.00	0.00
369	002056	横店东磁	400	5,564.00	0.00
370	002093	国脉科技	500	5,535.00	0.00
371	600428	中远海特	900	5,508.00	0.00
372	600006	东风汽车	800	5,504.00	0.00
373	601001	大同煤业	900	5,499.00	0.00
374	600657	信达地产	900	5,490.00	0.00
375	002399	海普瑞	300	5,466.00	0.00
376	600580	卧龙电气	600	5,460.00	0.00
377	600869	智慧能源	700	5,418.00	0.00
378	600180	瑞茂通	400	5,416.00	0.00
379	000919	金陵药业	400	5,412.00	0.00
380	000552	靖远煤电	1,400	5,306.00	0.00
381	000969	安泰科技	500	5,270.00	0.00
382	000973	佛塑科技	700	5,250.00	0.00
383	600329	中新药业	300	5,232.00	0.00
384	600537	亿晶光电	700	5,201.00	0.00
385	000417	合肥百货	600	5,178.00	0.00
386	600280	中央商场	600	5,166.00	0.00
387	002128	露天煤业	600	5,160.00	0.00
388	600496	精工钢构	1,200	5,136.00	0.00

388	600776	东方通信	600	5,136.00	0.00
389	600586	金晶科技	1,100	5,093.00	0.00
390	000931	中关村	600	5,082.00	0.00
391	600809	山西汾酒	200	5,004.00	0.00
392	000158	常山股份	400	5,000.00	0.00
393	601908	京运通	700	4,984.00	0.00
394	600292	远达环保	400	4,948.00	0.00
395	000877	天山股份	700	4,935.00	0.00
396	600748	上实发展	600	4,914.00	0.00
397	000636	风华高科	500	4,880.00	0.00
398	600251	冠农股份	600	4,866.00	0.00
399	600335	国机汽车	400	4,860.00	0.00
400	002342	巨力索具	700	4,837.00	0.00
401	601777	力帆股份	500	4,780.00	0.00
402	002698	博实股份	300	4,671.00	0.00
403	600053	九鼎投资	100	4,606.00	0.00
404	603001	奥康国际	200	4,580.00	0.00
405	600864	哈投股份	400	4,568.00	0.00
406	000723	美锦能源	300	4,536.00	0.00
407	600062	华润双鹤	200	4,446.00	0.00
408	600483	福能股份	400	4,428.00	0.00
409	601016	节能风电	500	4,425.00	0.00
410	002327	富安娜	500	4,400.00	0.00
411	002238	天威视讯	300	4,395.00	0.00
412	600112	天成控股	400	4,392.00	0.00
413	000426	兴业矿业	500	4,360.00	0.00
414	600825	新华传媒	500	4,345.00	0.00
415	600184	光电股份	200	4,316.00	0.00
416	601233	桐昆股份	300	4,308.00	0.00
417	002727	一心堂	200	4,240.00	0.00
418	000049	德赛电池	100	4,205.00	0.00
419	600425	青松建化	900	4,185.00	0.00
420	600059	古越龙山	400	4,096.00	0.00
421	300039	上海凯宝	400	4,092.00	0.00
422	600874	创业环保	500	4,065.00	0.00
423	300043	星辉娱乐	400	4,056.00	0.00
424	002392	北京利尔	700	4,032.00	0.00
425	002642	荣之联	200	4,020.00	0.00
426	600743	华远地产	900	4,005.00	0.00

427	600640	号百控股	200	3,996.00	0.00
428	600917	重庆燃气	300	3,957.00	0.00
429	002063	远光软件	300	3,942.00	0.00
430	603369	今世缘	300	3,936.00	0.00
431	000631	顺发恒业	800	3,920.00	0.00
432	002041	登海种业	200	3,776.00	0.00
433	002317	众生药业	300	3,705.00	0.00
434	600563	法拉电子	100	3,667.00	0.00
435	600397	安源煤业	700	3,612.00	0.00
436	002118	紫鑫药业	500	3,600.00	0.00
436	000869	张裕 A	100	3,600.00	0.00
437	600270	外运发展	200	3,308.00	0.00
438	002251	步步高	200	3,290.00	0.00
439	000517	荣安地产	600	3,156.00	0.00
440	603555	贵人鸟	100	3,076.00	0.00
441	600141	兴发集团	200	3,042.00	0.00
442	600338	西藏珠峰	100	2,898.00	0.00
443	603698	航天工程	100	2,759.00	0.00
444	600831	广电网络	200	2,612.00	0.00
445	002332	仙琚制药	200	2,574.00	0.00
446	600971	恒源煤电	400	2,508.00	0.00
447	600729	重庆百货	100	2,343.00	0.00
448	603568	伟明环保	100	2,330.00	0.00
449	600801	华新水泥	300	2,325.00	0.00
450	600088	中视传媒	100	2,192.00	0.00
451	603198	迎驾贡酒	100	2,155.00	0.00
452	000761	本钢板材	400	2,152.00	0.00
453	002233	塔牌集团	200	1,870.00	0.00
454	002249	大洋电机	200	1,726.00	0.00
455	600981	汇鸿集团	200	1,698.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	2,831,007.80	0.69

2	300072	三聚环保	2,516,040.60	0.61
3	600079	人福医药	2,319,009.09	0.56
4	600201	生物股份	2,264,695.89	0.55
5	600522	中天科技	2,122,943.00	0.51
6	002085	万丰奥威	2,097,614.92	0.51
7	002030	达安基因	2,077,887.86	0.50
8	600521	华海药业	2,034,501.80	0.49
9	600503	华丽家族	1,968,844.00	0.48
10	002701	奥瑞金	1,967,905.85	0.48
11	601012	隆基股份	1,945,713.47	0.47
12	600978	宜华生活	1,944,572.00	0.47
13	002340	格林美	1,912,049.00	0.46
14	600525	长园集团	1,873,406.20	0.45
15	002004	华邦健康	1,870,428.00	0.45
16	002400	省广股份	1,841,708.66	0.45
17	600635	大众公用	1,832,798.10	0.44
18	002508	老板电器	1,811,780.36	0.44
19	600664	哈药股份	1,768,369.64	0.43
20	600498	烽火通信	1,766,483.68	0.43

#### 8.4.2 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	300072	三聚环保	1,790,132.04	0.43
2	002466	天齐锂业	1,667,739.05	0.40
3	600201	生物股份	1,452,528.38	0.35
4	600522	中天科技	1,451,077.68	0.35
5	002085	万丰奥威	1,392,111.00	0.34
6	600584	长电科技	1,366,365.00	0.33
7	300043	星辉娱乐	1,357,105.11	0.33
8	000973	佛塑科技	1,298,121.30	0.31
9	002405	四维图新	1,290,675.00	0.31
10	600079	人福医药	1,282,397.52	0.31
11	002310	东方园林	1,200,625.50	0.29
12	000983	西山煤电	1,154,117.00	0.28

13	600851	海欣股份	1,119,843.00	0.27
14	600521	华海药业	1,109,801.47	0.27
15	600219	南山铝业	1,106,658.45	0.27
16	600503	华丽家族	1,100,998.00	0.27
17	600498	烽火通信	1,090,700.34	0.26
18	002340	格林美	1,087,571.70	0.26
19	002426	胜利精密	1,079,653.00	0.26
20	000656	金科股份	1,073,260.00	0.26

#### 8.4.3 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	476,971,566.44
卖出股票收入（成交）总额	263,278,460.17

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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	562,451,203.31	92.73
---	-------------	-----	--------	------------	----------------	-------

## 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.11.1 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
IC1701	中证 500 股指期货 IC1701 合约	5	6,217,200.00	-188,960.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-188,960.00
股指期货投资本期收益(元)					775,018.18
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-733,258.18

### 8.11.2 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。

## 8.12 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。

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1

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。

### 8.13.2

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。

### 8.13.3 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	1,339,584.59



2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,809.02
5	应收申购款	600,811.51
6	其他应收款	36,065.02
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,985,270.14

### 8.13.4 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。

### 8.13.5 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	002400	省广股份	296,485.00	0.05	重大事项停牌
2	600161	天坛生物	118,200.00	0.02	重大事项停牌
3	600551	时代出版	113,792.00	0.02	重大事项停牌
4	000887	中鼎股份	88,196.00	0.01	重大事项停牌
5	601168	西部矿业	79,866.00	0.01	重大事项停牌
6	002602	世纪华通	79,713.00	0.01	重大事项停牌
7	000748	长城信息	79,209.00	0.01	重大事项停牌
8	600673	东阳光科	77,274.00	0.01	重大事项停牌
9	300088	长信科技	71,100.00	0.01	重大事项停牌
10	000563	陕国投A	68,068.00	0.01	重大事项停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
57,628	6,191.01	33,390,183.69	9.36%	323,385,189.41	90.64%

## 9.2 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	20,439.67	0.01%

## 9.3 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、基金投资和相关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

## § 10 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	539,402,905.14
减：本报告期基金总赎回份额	390,883,146.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	356,775,373.10

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 60,000.00 元，该审计机构已连续 4 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	385,328,473.08	52.06%	269,749.54	52.06%	-
中信建投证券股份有限公司	1	233,885,195.10	31.60%	163,720.80	31.60%	-
广发证券股份有限公司	2	120,944,349.43	16.34%	84,661.44	16.34%	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券有限公司	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：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。

### 11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
国信证券股份有限 公司	8,974.40	66.32%	58,503.90	100.00%
中信建投证券股份 有限公司	4,558.20	33.68%	-	-

### 11.8 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
14	嘉实基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过陆金所资管开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 7 月 1 日
15	关于增加广源达信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 7 月 13 日
16	关于增加金元证券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	2016 年 7 月 14 日

		理人网站	
17	关于增加深圳新兰德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 7 月 27 日
18	关于增加“万得投顾”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 8 月 5 日
19	关于增加民生银行直销银行为嘉实旗下基金代销机构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 8 月 5 日
20	嘉实基金管理有限公司关于对中国银行借记卡持卡人调整基金直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 1 日
21	关于增加华融湘江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	2016 年 9 月 9 日
22	关于增加杭州数米为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及调整部分开放式基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 12 日
23	关于增加昆山农商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	2016 年 9 月 14 日
24	关于增加“凤凰金信”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 9 月 19 日
25	关于增加桂林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	2016 年 11 月 25 日
26	关于增加北京汇成基金销售有限公司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 11 月 29 日
27	嘉实基金管理有限公司关于增加民生证券为嘉实旗下基金代销机构及开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 8 日
28	关于增加东海期货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	2016 年 12 月 28 日
29	关于增加基煜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 12 月 30 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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

### 12.3 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  
2017 年 3 月 29 日