

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 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：2019 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
<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 .....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	54

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	54
7.10 期末投资目标基金明细 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
11.1 备查文件目录 .....	61
11.2 存放地点 .....	62
11.3 查阅方式 .....	62

## § 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	1,365,372,350.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	000008	070039
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,241,436,864.87 份	123,935,486.02 份

#### 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
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	(010) 67595096
传真	(010) 65215588	(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	经雷	田国立

### 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》
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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	-19,890,788.09	-1,218,620.61
本期利润	188,667,712.54	-6,533,098.80
加权平均基金份额本期利润	0.1768	-0.0997
本期加权平均净值利润率	13.16%	-9.11%
本期基金份额净值增长率	17.77%	17.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
期末可供分配利润	414,310,166.60	-5,105,524.96
期末可供分配基金份额利润	0.3337	-0.0412
期末基金资产净值	1,655,747,031.47	130,795,672.17
期末基金份额净值	1.3337	1.0554
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	40.22%	5.54%

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) 自 2018 年 9 月 13 日起对本基金增加 C 类基金份额类别；自 2018 年 9 月 13 日起开放嘉实中证 500ETF 联接 C 的申赎业务；(4) 嘉实中证 500ETF 联接 A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实中证 500ETF 联接 C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；(5) 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

嘉实中证 500ETF 联接 A

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	0.79%	1.33%	0.75%	1.32%	0.04%	0.01%
过去三个月	-9.90%	1.72%	-10.21%	1.72%	0.31%	0.00%
过去六个月	17.77%	1.69%	17.87%	1.70%	-0.10%	-0.01%
过去一年	-3.67%	1.60%	-4.70%	1.60%	1.03%	0.00%
过去三年	-14.78%	1.24%	-18.00%	1.25%	3.22%	-0.01%
自基金合同生效起至今	40.22%	1.65%	38.34%	1.67%	1.88%	-0.02%

嘉实中证 500ETF 联接 C

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	0.76%	1.33%	0.75%	1.32%	0.01%	0.01%
过去三个月	-9.97%	1.72%	-10.21%	1.72%	0.24%	0.00%
过去六个月	17.66%	1.69%	17.87%	1.70%	-0.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.54%	1.68%	4.77%	1.69%	0.77%	-0.01%

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



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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

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

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

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**嘉实中证 500ETF 联接 A 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**

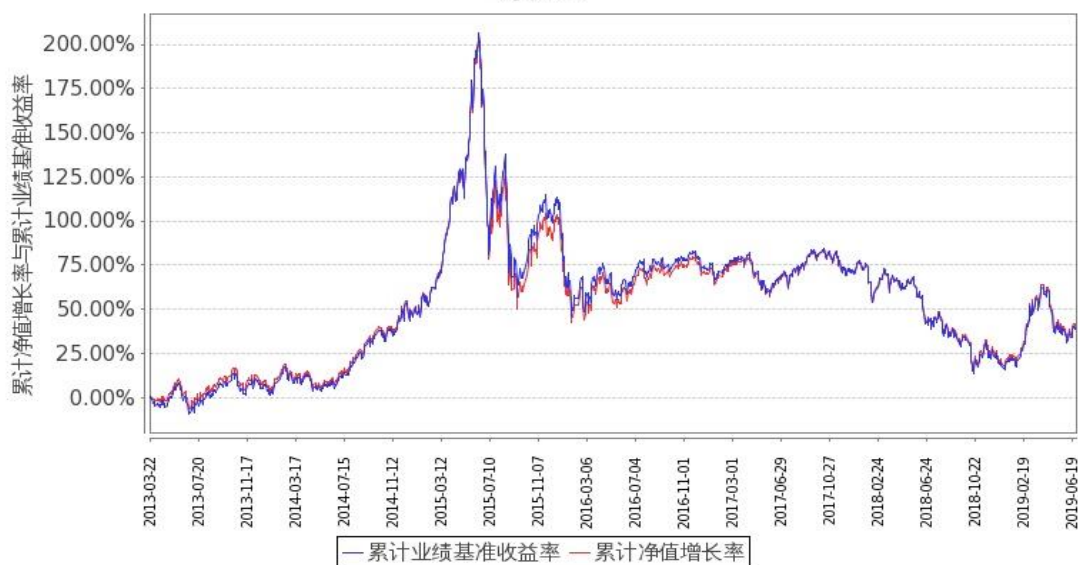


图 1：嘉实中证 500ETF 联接 A 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013 年 3 月 22 日至 2019 年 6 月 30 日)

**嘉实中证500ETF联接C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 2：嘉实中证 500ETF 联接 C 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  
(2018 年 9 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、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 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、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）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、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 400ETF 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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、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、嘉实快线货币、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、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、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、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混

合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实基本面 50ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日		14 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。
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实基本面 50ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日		13 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。

注：（1）任职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 4 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.05%，年化跟踪误差为 0.80%，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

截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值为 1.3337 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.77%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0554 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.66%；业绩比较基准收益率为 17.87%。

### 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，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。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。

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、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。

#### 4.7 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) 根据嘉实中证 500ETF 联接 C 本报告 3.1.1 “本期利润”为-6,533,098.80 元 3.1.2 “期末可供分配利润”为-5,105,524.96 元，以及本基金基金合同（十六（三）收益分配原则）的约定，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合规守信情况声明

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合规守信、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	103,322,320.87	58,795,033.51
结算备付金		3,201,027.45	1,199,438.77
存出保证金		1,791,939.12	568,652.62
交易性金融资产	6.4.7.2	1,684,815,041.55	996,494,983.54
其中：股票投资		41,098,544.64	45,442,712.52
基金投资		1,643,716,496.91	951,051,271.02
债券投资		-	1,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	27,557.62	13,739.52
应收股利		-	-
应收申购款		3,342,695.94	1,154,684.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,796,500,582.55	1,058,226,532.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,682,520.29	2,167,210.41
应付赎回款		5,508,568.33	959,661.69
应付管理人报酬		41,478.25	44,918.27
应付托管费		9,409.74	8,983.65
应付销售服务费		42,123.56	921.87
应付交易费用	6.4.7.7	551,586.30	144,555.10
应交税费		-	0.83
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	122,192.44	402,560.26
负债合计		9,957,878.91	3,728,812.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,365,372,350.89	931,894,026.69
未分配利润	6.4.7.10	421,170,352.75	122,603,693.80
所有者权益合计		1,786,542,703.64	1,054,497,720.49
负债和所有者权益总计		1,796,500,582.55	1,058,226,532.57

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值 1.3337 元，基金份额总额 1,241,436,864.87 份；嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值 1.0554 元，基金份额总额 123,935,486.02 份。基金份额总额合计为 1,365,372,350.89 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		184,741,790.91	-115,255,468.17
1. 利息收入		402,047.25	173,952.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	390,063.86	173,946.41
债券利息收入		634.33	5.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,349.06	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,560,907.77	-6,839,306.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,903,501.12	-3,327,715.53
基金投资收益	6.4.7.13	-31,066,941.88	-3,675,857.15
债券投资收益	6.4.7.14	157,353.90	1,768.50
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	78,403.11	-50,520.00
股利收益	6.4.7.16	366,775.98	213,018.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	203,244,022.44	-108,914,543.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填		-	-



列)			
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	1, 656, 628. 99	324, 429. 01
减: 二、费用		2, 607, 177. 17	989, 047. 81
1. 管理人报酬		327, 408. 92	187, 089. 72
2. 托管费		66, 595. 87	37, 417. 98
3. 销售服务费		139, 398. 49	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	1, 936, 965. 72	568, 481. 16
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		10, 989. 66	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	125, 818. 51	196, 058. 95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		182, 134, 613. 74	-116, 244, 515. 98
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		182, 134, 613. 74	-116, 244, 515. 98

### 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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	931, 894, 026. 69	122, 603, 693. 80	1, 054, 497, 720. 49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	182, 134, 613. 74	182, 134, 613. 74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	433, 478, 324. 20	116, 432, 045. 21	549, 910, 369. 41
其中: 1. 基金申购款	1, 391, 682, 299. 96	430, 862, 230. 20	1, 822, 544, 530. 16
2. 基金赎回款	-958, 203, 975. 76	-314, 430, 184. 99	-1, 272, 634, 160. 75
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,365,372,350.89	421,170,352.75	1,786,542,703.64
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	410,017,051.38	294,882,986.44	704,900,037.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-116,244,515.98	-116,244,515.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	195,229,543.21	97,167,538.76	292,397,081.97
其中：1. 基金申购款	362,519,150.27	209,062,817.67	571,581,967.94
2. 基金赎回款	-167,289,607.06	-111,895,278.91	-279,184,885.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	605,246,594.59	275,806,009.22	881,052,603.81

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：

经雷

王红

张公允

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

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。

根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》,自 2018 年 9 月 13 日起,对本基金增加 C 类基金份额类别,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类基金资产中计提销售服务费,并不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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×95% + 银行活期存款税后利率×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[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》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	103,322,320.87
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	103,322,320.87

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,252,933.18	41,098,544.64	-154,388.54
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	1,724,063,173.78	1,643,716,496.91	-80,346,676.87
其他	-	-	-
合计	1,765,316,106.96	1,684,815,041.55	-80,501,065.41

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 2019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	10,308,600.00	-	-	-
其中：股指期货投资	10,308,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,308,600.00	-	-	-

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）：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1909	IC1909	11	10,589,920.00	281,320.00
总额合计	-	-	-	281,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	281,320.00
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（2019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(2019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 2019年6月30日
应收活期存款利息	21,138.59
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	5,394.59
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	1,024.44
合计	27,557.62

**6.4.7.6 其他资产**

本期末(2019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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	551,586.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	551,586.30

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,744.01
预提费用	108,448.43
合计	122,192.44

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

嘉实中证 500ETF 联接 A

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	928,118,368.03	928,118,368.03
本期申购	1,134,478,133.11	1,134,478,133.11
本期赎回 (以“-”号填列)	-821,159,636.27	-821,159,636.27
本期末	1,241,436,864.87	1,241,436,864.87

## 嘉实中证 500ETF 联接 C

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,775,658.66	3,775,658.66
本期申购	257,204,166.85	257,204,166.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-137,044,339.49	-137,044,339.49
本期末	123,935,486.02	123,935,486.02

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。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

嘉实中证 500ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	570,303,262.34	-447,310,684.65	122,992,577.69
本期利润	-19,890,788.09	208,558,500.63	188,667,712.54
本期基金份额 交易产生的变 动数	189,605,243.68	-86,955,367.31	102,649,876.37
其中: 基金申 购款	685,644,992.56	-285,570,957.87	400,074,034.69
基金赎 回款	-496,039,748.88	198,615,590.56	-297,424,158.32
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	740,017,717.93	-325,707,551.33	414,310,166.60
嘉实中证 500ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-96,957.80	-291,926.09	-388,883.89
本期利润	-1,218,620.61	-5,314,478.19	-6,533,098.80
本期基金份额 交易产生的变 动数	-3,789,946.55	17,572,115.39	13,782,168.84
其中: 基金申 购款	-8,091,578.80	38,879,774.31	30,788,195.51
基金赎 回款	4,301,632.25	-21,307,658.92	-17,006,026.67



本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,105,524.96	11,965,711.11	6,860,186.15

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入	316,089.16	
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	60,994.88	
其他	12,979.82	
合计	390,063.86	

#### 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,698,081.01	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	5,205,420.11	
合计	9,903,501.12	

##### 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出股票成交总额	366,461,499.33	
减：卖出股票成本总额	361,763,418.32	
买卖股票差价收入	4,698,081.01	

##### 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
申购基金份额总额	1,463,602,275.00	
减：现金支付申购款总额	-8,302,144.43	

减：申购股票成本总额	1,466,698,999.32
申购差价收入	5,205,420.11

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	941,153,463.00
减：卖出/赎回基金成本总额	972,131,631.93
减：基金投资收益应缴纳增值税额	88,772.95
基金投资收益	-31,066,941.88

#### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,475,404.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,317,400.00
减：应收利息总额	650.65
买卖债券差价收入	157,353.90

#### 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（2019年1月1日至2019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 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	78,403.11

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	366,775.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	366,775.98

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	202,809,782.44
股票投资	1,607,249.83
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	201,202,532.61
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	434,240.00
权证投资	-
期货	434,240.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	203,244,022.44

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,544,005.36
基金转出费收入	112,623.63
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	1,656,628.99

## 6.4.7.19 交易费用

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,819,626.63
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	117,339.09
其中：申购费	70,900.16
赎回费	15,372.90
交易费	31,066.03
合计	1,936,965.72

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

审计费用	49,588.57
信息披露费	58,859.86
银行划款手续费	17,370.08
合计	125,818.51

#### 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（“目标 ETF”）	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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	327,408.92	187,089.72
其中：支付销售机构的客户维护费	693,286.00	487,705.59

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 0.50%/0.15%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)×该日适用费率/当年天数。

(2)根据《嘉实基金管理有限公司关于调低旗下嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金费率并修订基金合同及托管协议的公告》,自 2019 年 6 月 18 日起,基金管理费率由 0.50% 调整为 0.15%。

(3)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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,595.87	37,417.98

注:(1)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%/0.05%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)×该日适用费率 / 当年天数。

(2)根据《嘉实基金管理有限公司关于调低旗下嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金费率并修订基金合同及托管协议的公告》,自 2019 年 6 月 18 日起,基金托管费率由 0.1% 调整为 0.05%。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	18,623.92	18,623.92

中国建设银行	-	-	-
合计	-	18,623.92	18,623.92

注：(1) 本基金 C 类份额销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。(2) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年6月30日)及上年度末(2018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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国建设银行股份有限公司_活期	103,322,320.87	316,089.16	49,624,075.50	157,419.03

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年6月30日)，本基金持有 316,592,480.00 份目标 ETF 基金份额(2018年12月31日：218,476,780.00 份)，占其总份额的比例为 67.39%(2018年12月31日：74.81%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019 年 06 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2019 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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（2019 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（2019 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工作流程、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。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用



评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	1,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	1,000.00

注：1. 本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金未持有按长期信用评级的债券投资。2. 长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 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。

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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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 2019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	103,322,320.87	-	-	-	103,322,320.87
结算备付金	3,201,027.45	-	-	-	3,201,027.45
存出保证金	521,148.72	-	-	1,270,790.40	1,791,939.12
交易性金融资产	-	-	-	1,684,815,041.55	1,684,815,041.55
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	-	-	-	27,557.62	27,557.62
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,342,695.94	3,342,695.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	107,044,497.04	-	-	1,689,456,085.51	1,796,500,582.55
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	-	-	-	3,682,520.29	3,682,520.29
应付赎回款	-	-	-	5,508,568.33	5,508,568.33
应付管理人报酬	-	-	-	41,478.25	41,478.25
应付托管费	-	-	-	9,409.74	9,409.74
应付销售服务费	-	-	-	42,123.56	42,123.56
应付交易费用	-	-	-	551,586.30	551,586.30
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	122,192.44	122,192.44
负债总计	-	-	-	9,957,878.91	9,957,878.91
利率敏感度缺口	107,044,497.04	-	-	-1,679,498,206.60	1,786,542,703.64
上年度末 2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	58,795,033.51	-	-	-	58,795,033.51
结算备付金	1,199,438.77	-	-	-	1,199,438.77
存出保证金	200,642.62	-	-	368,010.00	568,652.62
交易性金融资产	-	-	1,000.00	996,493,983.54	996,494,983.54
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	-	-	-	13,739.52	13,739.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	196,805.08	-	-	957,879.53	1,154,684.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,391,919.98	-	1,000.00	997,833,612.59	1,058,226,532.57
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	-	-	-	2,167,210.41	2,167,210.41
应付赎回款	-	-	-	959,661.69	959,661.69
应付管理人报酬	-	-	-	44,918.27	44,918.27

应付托管费	-	-	-	8,983.65	8,983.65
应付销售服务费	-	-	-	921.87	921.87
应付交易费用	-	-	-	144,555.10	144,555.10
应付税费	-	-	-	0.83	0.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	402,560.26	402,560.26
负债总计	-	-	-	3,728,812.08	3,728,812.08
利率敏感度缺口	60,391,919.98	-	1,000.00	994,104,800.51	1,054,497,720.49

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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：0.00%）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	41,098,544.64	2.30	45,442,712.52	4.31
交易性金融资产—基金投资	1,643,716,496.91	92.01	951,051,271.02	90.19
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	1,684,815,041.55	94.31	996,493,983.54	94.50

## 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		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	88,756,182.11	52,638,222.08
	业绩比较基准下降 5%	-88,756,182.11	-52,638,222.08

## 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 1,684,758,065.01 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 996,256,550.54 元 第二层次 238,433.00 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

## (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	41,098,544.64	2.29
	其中：股票	41,098,544.64	2.29
2	基金投资	1,643,716,496.91	91.50
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	106,523,348.32	5.93
8	其他各项资产	5,162,192.68	0.29
9	合计	1,796,500,582.55	100.00

## 7.2 报告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	452,070.24	0.03
B	采矿业	1,671,763.06	0.09
C	制造业	22,661,533.76	1.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,297,464.40	0.07
E	建筑业	732,606.72	0.04
F	批发和零售业	2,220,598.74	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,385,839.87	0.08
H	住宿和餐饮业	156,534.40	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,960,057.11	0.22
J	金融业	1,870,350.74	0.10
K	房地产业	1,895,710.10	0.11
L	租赁和商务服务业	561,519.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	56,430.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	361,668.50	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	136,139.20	0.01
Q	卫生和社会工作	243,402.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	875,326.60	0.05
S	综合	559,529.60	0.03
	合计	41,098,544.64	2.30

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
2	002405	四维图新	16,800	270,480.00	0.02
3	000860	顺鑫农业	5,480	255,642.00	0.01
4	600872	中炬高新	5,900	252,697.00	0.01
5	002157	正邦科技	12,700	211,582.00	0.01
6	002049	紫光国微	4,500	198,495.00	0.01
7	300253	卫宁健康	13,910	197,243.80	0.01



8	000066	中国长城	18,900	194,292.00	0.01
9	600201	生物股份	12,362	193,959.78	0.01
10	002195	二三四五	49,468	192,430.52	0.01
11	600739	辽宁成大	13,100	190,474.00	0.01
12	300450	先导智能	5,600	188,160.00	0.01
13	002506	协鑫集成	27,100	181,028.00	0.01
14	600426	华鲁恒升	12,165	180,771.90	0.01
15	002439	启明星辰	6,700	180,230.00	0.01
16	002507	涪陵榨菜	5,900	179,950.00	0.01
17	000401	冀东水泥	10,100	177,861.00	0.01
18	002127	南极电商	15,800	177,592.00	0.01
19	600763	通策医疗	2,000	177,180.00	0.01
20	600642	申能股份	29,300	176,093.00	0.01
21	002129	中环股份	17,900	174,704.00	0.01
22	600183	生益科技	11,370	171,118.50	0.01
23	600895	张江高科	8,300	170,316.00	0.01
24	603444	吉比特	800	167,968.00	0.01
25	000975	银泰资源	12,720	167,776.80	0.01
26	002340	格林美	35,560	167,487.60	0.01
27	600536	中国软件	3,101	166,430.67	0.01
28	300383	光环新网	9,900	166,023.00	0.01
29	600298	安琪酵母	5,237	165,646.31	0.01
30	002465	海格通信	17,300	165,042.00	0.01
31	000623	吉林敖东	9,900	162,261.00	0.01
32	000750	国海证券	31,600	158,948.00	0.01
33	002223	鱼跃医疗	6,400	157,568.00	0.01
34	002268	卫士通	6,235	152,445.75	0.01
35	002384	东山精密	10,300	150,071.00	0.01
36	002075	沙钢股份	18,900	148,176.00	0.01
37	600801	华新水泥	7,300	147,825.00	0.01
38	603369	今世缘	5,300	147,817.00	0.01
39	002500	山西证券	18,200	147,420.00	0.01
40	002926	华西证券	14,000	147,000.00	0.01
41	002385	大北农	27,300	144,417.00	0.01
42	600879	航天电子	23,300	143,528.00	0.01
43	002797	第一创业	22,500	142,650.00	0.01
44	000998	隆平高科	9,800	141,904.00	0.01
45	600325	华发股份	18,122	141,532.82	0.01
46	600161	天坛生物	5,566	140,541.50	0.01
47	600460	士兰微	8,400	139,440.00	0.01
48	600497	驰宏锌锗	27,300	138,684.00	0.01
49	600528	中铁工业	11,900	137,683.00	0.01

50	002821	凯莱英	1,400	137,312.00	0.01
51	000723	美锦能源	13,100	136,895.00	0.01
52	600745	闻泰科技	4,100	136,202.00	0.01
53	000988	华工科技	8,600	136,052.00	0.01
54	601128	常熟银行	17,615	135,987.80	0.01
55	002373	千方科技	7,900	135,090.00	0.01
56	002299	圣农发展	5,307	134,373.24	0.01
57	600848	上海临港	4,300	133,859.00	0.01
58	000778	新兴铸管	29,900	132,756.00	0.01
59	600584	长电科技	10,306	132,432.10	0.01
60	000686	东北证券	15,000	132,150.00	0.01
61	600779	水井坊	2,600	132,132.00	0.01
62	000997	新大陆	7,800	131,742.00	0.01
63	000009	中国宝安	23,060	131,672.60	0.01
64	002371	北方华创	1,900	131,575.00	0.01
65	601168	西部矿业	20,442	130,419.96	0.01
66	600699	均胜电子	6,100	130,296.00	0.01
67	600549	厦门钨业	9,000	128,790.00	0.01
68	002572	索菲亚	6,900	128,064.00	0.01
69	600572	康恩贝	19,991	127,942.40	0.01
70	002092	中泰化学	16,050	127,758.00	0.01
71	600820	隧道股份	20,200	127,462.00	0.01
72	600909	华安证券	19,400	126,876.00	0.01
73	600410	华胜天成	11,800	126,614.00	0.01
74	601005	重庆钢铁	62,900	126,429.00	0.01
75	600673	东阳光	16,100	126,385.00	0.01
76	000060	中金岭南	26,800	125,692.00	0.01
77	600875	东方电气	11,800	125,316.00	0.01
78	600392	盛和资源	11,230	124,203.80	0.01
79	000999	华润三九	4,200	123,228.00	0.01
80	000039	中集集团	11,520	123,033.60	0.01
81	600376	首开股份	13,771	122,975.03	0.01
82	300168	万达信息	9,400	121,918.00	0.01
83	000690	宝新能源	18,600	119,784.00	0.01
84	000830	鲁西化工	11,000	119,680.00	0.01
85	000960	锡业股份	10,700	119,519.00	0.01
86	600718	东软集团	9,300	119,226.00	0.01
87	600166	福田汽车	50,100	118,737.00	0.01
88	002191	劲嘉股份	9,563	118,676.83	0.01
89	600811	东方集团	31,800	118,296.00	0.01
90	002353	杰瑞股份	5,100	117,810.00	0.01
91	600022	山东钢铁	70,390	117,551.30	0.01

92	600959	江苏有线	26,400	117,480.00	0.01
93	600755	厦门国贸	13,600	117,368.00	0.01
94	601333	广深铁路	36,300	117,249.00	0.01
95	600839	四川长虹	39,600	116,820.00	0.01
96	002372	伟星新材	6,680	116,232.00	0.01
97	600567	山鹰纸业	34,400	115,928.00	0.01
98	600885	宏发股份	4,760	115,668.00	0.01
99	601866	中远海发	42,500	115,600.00	0.01
100	600804	鹏博士	15,300	115,056.00	0.01
101	000581	威孚高科	6,191	114,904.96	0.01
102	002387	维信诺	8,800	114,840.00	0.01
103	000547	航天发展	12,000	114,720.00	0.01
104	002281	光迅科技	4,300	113,864.00	0.01
105	601872	招商轮船	25,989	113,312.04	0.01
106	002078	太阳纸业	16,627	113,229.87	0.01
107	600881	亚泰集团	34,800	113,100.00	0.01
108	600521	华海药业	8,000	112,800.00	0.01
109	603939	益丰药房	1,600	111,984.00	0.01
110	002074	国轩高科	8,500	111,435.00	0.01
111	002217	合力泰	20,000	110,600.00	0.01
112	600315	上海家化	3,524	109,772.60	0.01
113	600808	马钢股份	32,000	109,120.00	0.01
114	603077	和邦生物	56,840	107,996.00	0.01
115	600094	大名城	17,100	107,559.00	0.01
116	600037	歌华有线	10,400	106,600.00	0.01
117	300009	安科生物	6,700	106,530.00	0.01
118	002273	水晶光电	9,180	106,304.40	0.01
119	600079	人福医药	10,101	106,060.50	0.01
120	002221	东华能源	12,300	105,903.00	0.01
121	600260	凯乐科技	5,300	105,894.00	0.01
122	603000	人民网	5,900	105,197.00	0.01
123	002670	国盛金控	8,257	104,038.20	0.01
124	600160	巨化股份	14,630	104,019.30	0.01
125	600486	扬农化工	1,900	103,930.00	0.01
126	300274	阳光电源	11,100	103,785.00	0.01
127	600845	宝信软件	3,640	103,667.20	0.01
128	002038	双鹭药业	4,400	103,664.00	0.01
129	000970	中科三环	9,100	103,285.00	0.01
130	002002	鸿达兴业	16,600	102,754.00	0.01
131	300027	华谊兄弟	20,900	102,619.00	0.01
132	000983	西山煤电	16,900	102,414.00	0.01
133	002085	万丰奥威	14,000	101,920.00	0.01

134	300315	掌趣科技	29,500	101,775.00	0.01
135	601699	潞安环能	12,800	101,632.00	0.01
136	600967	内蒙一机	9,000	100,800.00	0.01
137	000729	燕京啤酒	15,100	100,264.00	0.01
138	600143	金发科技	20,400	99,960.00	0.01
139	600435	北方导航	11,100	99,789.00	0.01
140	300088	长信科技	19,700	99,682.00	0.01
141	600643	爱建集团	10,400	99,632.00	0.01
142	600282	南钢股份	28,400	99,400.00	0.01
143	000513	丽珠集团	2,990	99,357.70	0.01
144	600466	蓝光发展	15,940	99,146.80	0.01
145	600064	南京高科	9,240	98,960.40	0.01
146	600737	中粮糖业	11,400	98,952.00	0.01
147	002607	中公教育	7,200	98,856.00	0.01
148	600388	龙净环保	7,950	98,500.50	0.01
149	000089	深圳机场	11,000	97,790.00	0.01
150	600863	内蒙华电	31,100	97,654.00	0.01
151	002589	瑞康医药	12,860	97,607.40	0.01
152	600266	北京城建	12,100	97,526.00	0.01
153	600171	上海贝岭	6,000	97,500.00	0.01
154	601098	中南传媒	7,700	97,328.00	0.01
155	600021	上海电力	11,200	97,216.00	0.01
156	002110	三钢闽光	10,450	97,185.00	0.01
157	300166	东方国信	7,880	96,845.20	0.01
158	000878	云南铜业	9,100	96,733.00	0.01
159	600026	中远海能	14,890	96,636.10	0.01
160	002174	游族网络	5,700	96,216.00	0.01
161	300207	欣旺达	8,300	95,616.00	0.01
162	300001	特锐德	5,300	95,506.00	0.01
163	002131	利欧股份	49,900	95,309.00	0.01
164	600258	首旅酒店	5,280	94,934.40	0.01
165	002019	亿帆医药	7,700	94,325.00	0.01
166	000563	陕国投 A	21,230	94,261.20	0.01
167	601118	海南橡胶	18,300	94,245.00	0.01
168	603517	绝味食品	2,400	93,384.00	0.01
169	002690	美亚光电	2,848	92,844.80	0.01
170	601106	中国一重	29,400	92,316.00	0.01
171	002440	闰土股份	7,400	92,204.00	0.01
172	000636	风华高科	7,600	91,960.00	0.01
173	601718	际华集团	23,500	91,885.00	0.01
174	600373	中文传媒	7,300	91,688.00	0.01
175	000883	湖北能源	20,900	90,706.00	0.01

176	002155	湖南黄金	9,000	90,630.00	0.01
177	000826	启迪桑德	7,600	89,604.00	0.01
178	600380	健康元	10,300	89,095.00	0.00
179	002233	塔牌集团	7,600	88,768.00	0.00
180	000930	中粮生化	11,800	88,736.00	0.00
181	002152	广电运通	12,900	88,365.00	0.00
182	000559	万向钱潮	14,700	87,906.00	0.00
183	601100	恒立液压	2,800	87,864.00	0.00
184	002250	联化科技	7,900	87,611.00	0.00
185	000732	泰禾集团	5,300	87,450.00	0.00
186	000598	兴蓉环境	19,200	87,360.00	0.00
187	600649	城投控股	13,500	87,345.00	0.00
188	000681	视觉中国	4,500	87,210.00	0.00
189	601000	唐山港	31,700	87,175.00	0.00
190	601966	玲珑轮胎	5,100	86,700.00	0.00
191	600782	新钢股份	17,300	86,500.00	0.00
192	000932	华菱钢铁	18,120	86,432.40	0.00
193	300316	晶盛机电	6,800	86,292.00	0.00
194	600008	首创股份	24,400	85,888.00	0.00
195	300182	捷成股份	19,300	85,113.00	0.00
196	600039	四川路桥	23,200	84,448.00	0.00
197	600827	百联股份	8,600	84,366.00	0.00
198	601231	环旭电子	7,000	84,350.00	0.00
199	002399	海普瑞	3,960	83,120.40	0.00
200	000738	航发控制	6,200	83,080.00	0.00
201	600500	中化国际	11,100	82,917.00	0.00
202	600515	海航基础	16,700	82,665.00	0.00
203	600648	外高桥	3,920	82,241.60	0.00
204	002583	海能达	9,800	82,222.00	0.00
205	002004	华邦健康	16,900	82,134.00	0.00
206	600598	北大荒	7,600	81,548.00	0.00
207	601179	中国西电	22,000	81,400.00	0.00
208	600748	上实发展	9,800	81,242.00	0.00
209	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
210	000031	大悦城	12,600	80,892.00	0.00
211	000758	中色股份	14,700	80,703.00	0.00
212	601608	中信重工	18,600	80,352.00	0.00
213	002266	浙富控股	16,901	80,279.75	0.00
214	000685	中山公用	9,400	80,276.00	0.00
215	000008	神州高铁	21,200	79,924.00	0.00
216	002368	太极股份	2,600	78,780.00	0.00
217	000027	深圳能源	12,700	78,740.00	0.00

218	600138	中青旅	6,200	78,678.00	0.00
219	300058	蓝色光标	18,400	78,568.00	0.00
220	300418	昆仑万维	6,101	78,519.87	0.00
221	000807	云铝股份	16,700	78,323.00	0.00
222	600729	重庆百货	2,589	78,291.36	0.00
223	601678	滨化股份	11,560	78,145.60	0.00
224	000877	天山股份	6,700	77,854.00	0.00
225	600633	浙数文化	8,300	77,605.00	0.00
226	600167	联美控股	7,330	77,551.40	0.00
227	600120	浙江东方	6,047	77,038.78	0.00
228	603501	韦尔股份	1,400	76,874.00	0.00
229	002414	高德红外	4,000	76,800.00	0.00
230	300133	华策影视	11,400	76,722.00	0.00
231	000488	晨鸣纸业	14,250	76,380.00	0.00
232	600056	中国医药	5,646	76,164.54	0.00
233	002183	怡亚通	15,900	75,843.00	0.00
234	600777	新潮能源	36,400	75,712.00	0.00
235	600507	方大特钢	7,700	75,306.00	0.00
236	600155	华创阳安	5,600	75,208.00	0.00
237	603885	吉祥航空	5,740	75,194.00	0.00
238	600348	阳泉煤业	12,900	74,949.00	0.00
239	000887	中鼎股份	7,800	74,802.00	0.00
240	002603	以岭药业	6,456	74,760.48	0.00
241	600409	三友化工	13,200	74,712.00	0.00
242	600823	世茂股份	16,090	74,174.90	0.00
243	600216	浙江医药	7,200	73,728.00	0.00
244	600158	中体产业	7,200	73,656.00	0.00
245	002408	齐翔腾达	9,500	73,625.00	0.00
246	603228	景旺电子	1,840	73,618.40	0.00
247	600511	国药股份	3,200	73,504.00	0.00
248	600418	江淮汽车	14,200	73,272.00	0.00
249	000528	柳工	10,990	73,193.40	0.00
250	000813	德展健康	9,522	72,557.64	0.00
251	600060	海信电器	8,367	72,123.54	0.00
252	600970	中材国际	11,200	72,016.00	0.00
253	600525	长园集团	11,300	71,416.00	0.00
254	600277	亿利洁能	14,600	71,102.00	0.00
255	000301	东方盛虹	12,900	70,821.00	0.00
256	601880	大连港	33,200	70,716.00	0.00
257	002701	奥瑞金	15,092	70,479.64	0.00
258	603883	老百姓	1,200	70,176.00	0.00
259	002812	恩捷股份	1,500	70,125.00	0.00

260	600597	光明乳业	6,500	69,875.00	0.00
261	600580	卧龙电驱	8,300	69,803.00	0.00
262	600062	华润双鹤	5,532	69,758.52	0.00
263	300010	立思辰	7,400	69,486.00	0.00
264	600478	科力远	12,400	69,316.00	0.00
265	002244	滨江集团	16,677	69,209.55	0.00
266	002640	跨境通	8,300	69,139.00	0.00
267	601958	金钼股份	10,300	69,010.00	0.00
268	300113	顺网科技	4,400	68,992.00	0.00
269	000090	天健集团	13,948	68,903.12	0.00
270	600717	天津港	10,725	68,854.50	0.00
271	002407	多氟多	5,800	68,672.00	0.00
272	600307	酒钢宏兴	33,600	68,208.00	0.00
273	000156	华数传媒	6,100	67,161.00	0.00
274	002212	南洋股份	4,900	67,130.00	0.00
275	600312	平高电气	8,727	67,110.63	0.00
276	600664	哈药股份	16,200	67,068.00	0.00
277	300002	神州泰岳	16,808	66,895.84	0.00
278	002056	横店东磁	8,800	66,880.00	0.00
279	601200	上海环境	4,900	66,689.00	0.00
280	002242	九阳股份	3,202	66,633.62	0.00
281	002419	天虹股份	5,100	66,606.00	0.00
282	300026	红日药业	19,300	66,585.00	0.00
283	300244	迪安诊断	3,900	66,222.00	0.00
284	002426	胜利精密	25,800	66,048.00	0.00
285	600316	洪都航空	4,600	65,826.00	0.00
286	002128	露天煤业	7,601	65,748.65	0.00
287	600759	洲际油气	17,000	65,620.00	0.00
288	002491	通鼎互联	8,100	65,529.00	0.00
289	600557	康缘药业	4,400	65,384.00	0.00
290	601928	凤凰传媒	8,100	65,367.00	0.00
291	601611	中国核建	8,400	65,352.00	0.00
292	000028	国药一致	1,546	64,669.18	0.00
293	600259	广晟有色	1,600	64,480.00	0.00
294	002665	首航节能	19,000	64,410.00	0.00
295	600073	上海梅林	7,000	64,400.00	0.00
296	002470	金正大	17,600	64,064.00	0.00
297	600884	杉杉股份	6,000	63,900.00	0.00
298	002030	达安基因	5,942	63,757.66	0.00
299	300134	大富科技	4,100	63,673.00	0.00
300	600859	王府井	4,180	63,494.20	0.00
301	000021	深科技	7,800	63,414.00	0.00

302	601717	郑煤机	11,100	63,381.00	0.00
303	600125	铁龙物流	9,800	63,210.00	0.00
304	300197	铁汉生态	17,550	63,004.50	0.00
305	002064	华峰氨纶	12,500	62,750.00	0.00
306	600017	日照港	19,800	62,370.00	0.00
307	002176	江特电机	12,800	62,336.00	0.00
308	600267	海正药业	6,200	62,000.00	0.00
309	000078	海王生物	17,750	61,770.00	0.00
310	000712	锦龙股份	4,800	61,632.00	0.00
311	600754	锦江股份	2,500	61,600.00	0.00
312	600751	海航科技	19,300	61,374.00	0.00
313	603816	顾家家居	1,920	61,286.40	0.00
314	603659	璞泰来	1,300	61,126.00	0.00
315	600582	天地科技	17,700	61,065.00	0.00
316	600575	皖江物流	20,800	60,944.00	0.00
317	300115	长盈精密	5,800	60,842.00	0.00
318	000727	华东科技	29,100	60,819.00	0.00
319	002051	中工国际	5,280	60,561.60	0.00
320	002302	西部建设	5,400	60,156.00	0.00
321	002358	森源电气	5,900	59,885.00	0.00
322	000959	首钢股份	17,000	59,840.00	0.00
323	002280	联络互动	16,300	59,658.00	0.00
324	002424	贵州百灵	6,000	59,280.00	0.00
325	600499	科达洁能	13,500	59,130.00	0.00
326	002285	世联行	13,100	59,081.00	0.00
327	002317	众生药业	6,900	58,719.00	0.00
328	600901	江苏租赁	9,600	58,464.00	0.00
329	600291	西水股份	5,800	58,348.00	0.00
330	600565	迪马股份	15,600	58,188.00	0.00
331	000400	许继电气	6,400	57,984.00	0.00
332	002505	大康农业	29,349	57,817.53	0.00
333	600563	法拉电子	1,400	57,638.00	0.00
334	000158	常山北明	10,620	57,560.40	0.00
335	600317	营口港	20,800	57,408.00	0.00
336	000519	中兵红箭	7,400	57,202.00	0.00
337	000717	韶钢松山	12,900	57,147.00	0.00
338	002444	巨星科技	5,700	56,886.00	0.00
339	002028	思源电气	5,700	56,772.00	0.00
340	000926	福星股份	8,200	56,744.00	0.00
341	600993	马应龙	3,200	56,480.00	0.00
342	600835	上海机电	3,400	56,440.00	0.00
343	600645	中源协和	3,260	56,430.60	0.00



344	002390	信邦制药	10,700	56,389.00	0.00
345	000718	苏宁环球	16,260	56,259.60	0.00
346	600908	无锡银行	9,900	55,836.00	0.00
347	002573	清新环境	6,900	55,545.00	0.00
348	601326	秦港股份	15,300	55,539.00	0.00
349	600770	综艺股份	8,300	55,444.00	0.00
350	002249	大洋电机	12,700	55,118.00	0.00
351	600151	航天机电	10,700	55,105.00	0.00
352	000006	深振业 A	10,100	55,045.00	0.00
353	603866	桃李面包	1,320	54,978.00	0.00
354	000980	众泰汽车	13,000	54,730.00	0.00
355	000012	南玻 A	13,104	54,512.64	0.00
356	600611	大众交通	11,700	54,405.00	0.00
357	002807	江阴银行	11,620	54,381.60	0.00
358	000543	皖能电力	11,500	54,165.00	0.00
359	002839	张家港行	9,600	54,048.00	0.00
360	600787	中储股份	9,411	53,925.03	0.00
361	600765	中航重机	5,800	53,534.00	0.00
362	600862	中航高科	5,900	53,041.00	0.00
363	600458	时代新材	5,100	52,989.00	0.00
364	002831	裕同科技	2,760	52,909.20	0.00
365	300055	万邦达	7,400	52,762.00	0.00
366	002332	仙琚制药	7,800	52,728.00	0.00
367	000848	承德露露	6,300	52,479.00	0.00
368	601019	山东出版	6,700	52,126.00	0.00
369	002366	台海核电	5,500	51,480.00	0.00
370	600338	西藏珠峰	2,940	51,391.20	0.00
371	600169	太原重工	19,200	51,264.00	0.00
372	603712	七一二	2,400	50,952.00	0.00
373	000600	建投能源	7,600	50,920.00	0.00
374	002048	宁波华翔	4,700	50,854.00	0.00
375	000564	供销大集	19,300	50,373.00	0.00
376	600393	粤泰股份	10,800	50,220.00	0.00
377	002093	国脉科技	5,400	50,166.00	0.00
378	002431	棕榈股份	12,700	50,165.00	0.00
379	002635	安洁科技	3,700	49,913.00	0.00
380	601311	骆驼股份	4,600	49,910.00	0.00
381	002672	东江环保	4,400	49,896.00	0.00
382	300308	中际旭创	1,460	49,625.40	0.00
383	603233	大参林	1,100	49,500.00	0.00
384	603515	欧普照明	1,530	49,342.50	0.00
385	300287	飞利信	12,300	48,831.00	0.00

386	300376	易事特	9,900	48,807.00	0.00
387	002254	泰和新材	4,600	48,668.00	0.00
388	300297	蓝盾股份	8,000	48,240.00	0.00
389	002745	木林森	4,100	48,052.00	0.00
390	600978	宜华生活	12,700	47,752.00	0.00
391	601689	拓普集团	3,100	47,492.00	0.00
392	601016	节能风电	17,800	47,348.00	0.00
393	300159	新研股份	9,500	47,310.00	0.00
394	002544	杰赛科技	3,599	46,787.00	0.00
395	603198	迎驾贡酒	2,570	46,028.70	0.00
396	603766	隆鑫通用	10,950	45,880.50	0.00
397	600640	号百控股	3,400	45,492.00	0.00
398	300266	兴源环境	10,000	45,400.00	0.00
399	002503	搜于特	16,500	45,375.00	0.00
400	600006	东风汽车	8,500	45,305.00	0.00
401	600623	华谊集团	5,900	45,076.00	0.00
402	000869	张裕 A	1,400	44,968.00	0.00
403	300199	翰宇药业	4,900	44,933.00	0.00
404	600195	中牧股份	3,215	44,527.75	0.00
405	600757	长江传媒	6,500	44,265.00	0.00
406	600750	江中药业	3,375	43,908.75	0.00
407	000062	深圳华强	3,295	43,790.55	0.00
408	600639	浦东金桥	2,700	43,659.00	0.00
409	603056	德邦股份	3,100	43,648.00	0.00
410	000937	冀中能源	11,300	43,618.00	0.00
411	002709	天赐材料	1,800	43,560.00	0.00
412	600545	卓郎智能	6,100	43,371.00	0.00
413	000501	鄂武商 A	4,030	43,322.50	0.00
414	000426	兴业矿业	8,000	42,960.00	0.00
415	600869	智慧能源	9,500	42,940.00	0.00
416	603888	新华网	2,150	42,914.00	0.00
417	600329	中新药业	3,000	42,870.00	0.00
418	002382	蓝帆医疗	3,100	42,842.00	0.00
419	600416	湘电股份	7,100	42,742.00	0.00
420	000990	诚志股份	2,600	42,666.00	0.00
421	600694	大商股份	1,500	41,865.00	0.00
422	603568	伟明环保	1,925	41,426.00	0.00
423	000537	广宇发展	5,900	40,828.00	0.00
424	601001	大同煤业	8,900	40,673.00	0.00
425	002815	崇达技术	2,600	40,534.00	0.00
426	603806	福斯特	1,100	40,403.00	0.00
427	002707	众信旅游	6,600	40,062.00	0.00

428	300257	开山股份	3,600	39,888.00	0.00
429	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
430	601127	小康股份	3,015	39,496.50	0.00
431	603868	飞科电器	1,000	39,150.00	0.00
432	000061	农产品	7,200	39,024.00	0.00
433	600058	五矿发展	4,600	38,870.00	0.00
434	002489	浙江永强	11,600	38,744.00	0.00
435	002434	万里扬	5,700	38,703.00	0.00
436	600707	彩虹股份	7,700	38,577.00	0.00
437	002509	天广中茂	18,700	38,522.00	0.00
438	601801	皖新传媒	6,400	38,464.00	0.00
439	000829	天音控股	6,600	38,412.00	0.00
440	600874	创业环保	4,600	38,134.00	0.00
441	002920	德赛西威	1,700	38,080.00	0.00
442	002437	誉衡药业	9,500	37,525.00	0.00
443	600657	信达地产	9,100	37,492.00	0.00
444	600971	恒源煤电	6,404	37,463.40	0.00
445	002251	步步高	4,680	37,299.60	0.00
446	000536	华映科技	14,800	37,296.00	0.00
447	002948	青岛银行	5,800	37,294.00	0.00
448	603377	东方时尚	2,440	37,283.20	0.00
449	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
450	002681	奋达科技	8,770	37,184.80	0.00
451	002512	达华智能	8,200	37,064.00	0.00
452	002517	恺英网络	11,450	36,525.50	0.00
453	002941	新疆交建	1,400	36,400.00	0.00
454	002118	紫鑫药业	5,400	36,396.00	0.00
455	000541	佛山照明	6,862	35,956.88	0.00
456	300459	金科文化	6,300	35,847.00	0.00
457	600098	广州发展	5,800	35,728.00	0.00
458	600996	贵广网络	3,300	35,574.00	0.00
459	601139	深圳燃气	6,100	34,709.00	0.00
460	000766	通化金马	5,100	34,680.00	0.00
461	600350	山东高速	7,200	34,560.00	0.00
462	600428	中远海特	9,200	34,040.00	0.00
463	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
464	002936	郑州银行	6,600	33,528.00	0.00
465	000552	靖远煤电	12,200	33,062.00	0.00
466	603486	科沃斯	1,080	32,670.00	0.00
467	600053	九鼎投资	1,400	32,620.00	0.00
468	002375	亚厦股份	5,500	32,505.00	0.00
469	603328	依顿电子	3,113	31,970.51	0.00

470	601003	柳钢股份	5,500	31,845.00	0.00
471	600335	国机汽车	4,600	31,832.00	0.00
472	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
473	002344	海宁皮城	6,800	31,688.00	0.00
474	002482	广田集团	6,500	31,590.00	0.00
475	601615	明阳智能	2,900	31,436.00	0.00
476	600903	贵州燃气	2,400	31,272.00	0.00
477	002818	富森美	2,400	30,792.00	0.00
478	601777	力帆股份	7,000	30,030.00	0.00
479	601869	长飞光纤	800	30,000.00	0.00
480	000587	金洲慈航	11,300	29,154.00	0.00
481	603556	海兴电力	2,090	28,883.80	0.00
482	603650	彤程新材	1,300	28,392.00	0.00
483	600939	重庆建工	5,800	28,362.00	0.00
484	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
485	000987	越秀金控	2,900	26,158.00	0.00
486	002416	爱施德	3,960	24,750.00	0.00
487	600126	杭钢股份	5,370	24,487.20	0.00
488	000025	特力A	1,200	24,264.00	0.00
489	601969	海南矿业	4,100	24,108.00	0.00
490	002699	美盛文化	3,900	23,400.00	0.00
491	600179	ST 安通	7,940	23,264.20	0.00
492	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
493	600985	淮北矿业	2,000	22,680.00	0.00
494	600280	中央商场	6,156	22,100.04	0.00
495	601068	中铝国际	3,200	22,080.00	0.00
496	603225	新凤鸣	1,712	21,382.88	0.00
497	601811	新华文轩	1,700	20,757.00	0.00
498	000761	本钢板材	4,100	17,630.00	0.00
499	603355	莱克电气	800	17,216.00	0.00
500	603877	太平鸟	1,100	17,072.00	0.00
501	002946	新乳业	1,000	15,140.00	0.00
502	600917	重庆燃气	2,000	13,920.00	0.00
503	603025	大豪科技	1,100	11,264.00	0.00
504	603569	长久物流	800	9,272.00	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	000860	顺鑫农业	8,956,904.34	0.85
2	600872	中炬高新	8,243,906.80	0.78

3	600201	生物股份	7,990,448.74	0.76
4	002049	紫光国微	7,194,138.18	0.68
5	002268	卫士通	6,648,747.52	0.63
6	002129	中环股份	6,647,376.68	0.63
7	002195	二三四五	6,448,886.00	0.61
8	300383	光环新网	6,432,074.85	0.61
9	000750	国海证券	6,420,415.00	0.61
10	000623	吉林敖东	6,408,970.72	0.61
11	300146	汤臣倍健	6,390,897.80	0.61
12	600426	华鲁恒升	6,381,316.25	0.61
13	600642	申能股份	6,292,245.55	0.60
14	300450	先导智能	6,253,449.41	0.59
15	600895	张江高科	6,236,230.49	0.59
16	002465	海格通信	6,171,703.39	0.59
17	002439	启明星辰	6,125,754.21	0.58
18	300347	泰格医药	6,121,058.80	0.58
19	000401	冀东水泥	6,042,302.00	0.57
20	300253	卫宁健康	5,989,900.75	0.57

#### 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	300347	泰格医药	2,024,319.90	0.19
2	300146	汤臣倍健	1,985,152.00	0.19
3	600872	中炬高新	1,962,817.00	0.19
4	000860	顺鑫农业	1,957,815.00	0.19
5	002410	广联达	1,925,049.00	0.18
6	600201	生物股份	1,914,346.00	0.18
7	000656	金科股份	1,778,277.00	0.17
8	600256	广汇能源	1,767,603.20	0.17
9	000623	吉林敖东	1,623,726.00	0.15
10	000750	国海证券	1,615,039.00	0.15
11	002129	中环股份	1,613,908.25	0.15
12	002465	海格通信	1,567,377.00	0.15
13	300383	光环新网	1,560,850.00	0.15
14	600426	华鲁恒升	1,555,263.00	0.15
15	600642	申能股份	1,514,779.00	0.14
16	000401	冀东水泥	1,496,713.00	0.14
17	002439	启明星辰	1,480,625.00	0.14
18	002268	卫士通	1,473,996.00	0.14
19	002195	二三四五	1,472,656.00	0.14
20	600600	青岛啤酒	1,459,178.00	0.14

### 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	1,514,370,831.93
卖出股票收入（成交）总额	366,461,499.33

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

### 7.10 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	嘉实中证 500ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	1,643,716,496.91	92.01

### 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
IC1909	IC1909	11	10,589,920.00	281,320.00	-
公允价值变动总额合计（元）					281,320.00
股指期货投资本期收益（元）					78,403.11
股指期货投资本期公允价值变动（元）					434,240.00

#### 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 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1) 2018 年 7 月 20 日，江西正邦科技股份有限公司发布关于公司下属分子公司收到《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》的公告，公告披露江西正邦科技股份有限公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司因环保不达标收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕180506 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0608 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0608 号）以及江西正邦科技股份有限公司子公司的其他处罚决定，受处罚金额累计为 205 万元。

本基金投资于“正邦科技（002157）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，正邦科技为标的指数的成份股，本基金投资于“正邦科技”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 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	1,791,939.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,557.62
5	应收申购款	3,342,695.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,162,192.68

### 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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

份额级别	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 (%)
嘉实中证 500ETF 联接 A	90,792	13,673.42	315,992,607.25	25.45	925,444,257.62	74.55
嘉实中证 500ETF 联接 C	29,420	4,212.63	-	-	123,935,486.02	100.00
合计	118,942	11,479.31	315,992,607.25	23.14	1,049,379,743.64	76.86

注：(1) 嘉实中证 500ETF 联接 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证 500ETF 联接 A 份额占嘉实中证 500ETF 联接 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证 500ETF 联接 A 份额占嘉实中证 500ETF 联接 A 总份额比例；

(2) 嘉实中证 500ETF 联接 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实中证 500ETF 联接 C 份额占嘉实中证 500ETF 联接 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证 500ETF 联接 C 份额占嘉实中证 500ETF 联接 C 总份额比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实中证 500ETF 联接 A	669,019.27	0.05
	嘉实中证 500ETF 联接 C	15,748.90	0.01
	合计	684,768.17	0.05

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	0
	嘉实中证 500ETF 联接 C	0



	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	0
	嘉实中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
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	928,118,368.03	3,775,658.66
本报告期基金总申购份额	1,134,478,133.11	257,204,166.85
减：本报告期基金总赎回份额	821,159,636.27	137,044,339.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,241,436,864.87	123,935,486.02

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

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019 年 6 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
国信证券股份有限公司	1	1,003,778,667.46	53.41%	702,676.78	54.65%	-
兴业证券股份有限公司	2	325,008,061.13	17.29%	205,206.01	15.96%	-
华泰证券股份有限公司	1	267,435,690.72	14.23%	187,315.91	14.57%	-
申万宏源证券有限	2	127,900,940.69	6.81%	89,530.80	6.96%	-

公司						
光大证券 股份有限 公司	1	110,490,063.88	5.88%	69,754.45	5.43%	新增
中信建投 证券股份 有限公司	2	44,718,530.04	2.38%	31,303.03	2.43%	新增 1 个
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
财富证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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。

## 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。

### 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
光大证券股份有限公司	904,468.40	20.21%	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1,434,609.15	32.06%	-	-	-	-	637,866,942.10	100.00%
华泰证券股份有限公司	1,112,824.50	24.87%	40,000,000.00	24.54%	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1,023,502.50	22.87%	43,000,000.00	26.38%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	80,000,000.00	49.08%	-	-	-	-

## 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	嘉实基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换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	2019 年 1 月 4 日
3	关于增加日照银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 1 月 25 日
4	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 1 月 28 日
5	关于增加中信证券等为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 2 月 19 日
6	关于增加上海天天为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 2 月 26 日
7	关于增加唐鼎耀华为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 2 月 28 日
8	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 3 月 8 日
9	关于增加青岛农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 3 月 26 日
10	关于增加包商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 4 月 11 日
11	关于调低旗下嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金费率并修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 15 日
12	关于增加植信基金为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 19 日
13	关于增加通华财富为嘉实旗下基金代销机构并开展转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2019 年 6 月 21 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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 08 月 29 日