

# 嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2020 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）起至 2020 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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>14</b>
6.1 资产负债表	14
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>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51

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 .....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	嘉实中证 500 指数增强	
基金主代码	008778	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	184,309,717.06 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 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	008778	008779
报告期末下属分级基金的份额总额	69,494,790.97 份	114,814,926.09 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金作为增强指数型基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求有效跟踪标的指数，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金作为增强指数型基金，以跟踪中证 500 指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。
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	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人姓名	胡勇钦	王曦

责人	联系电话	(010)65215588	4008-888-108
	电子邮箱	service@jsfund.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95587
传真		(010)65215588	010-85130975
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 27 楼 09-14 单元	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码		100005	100010
法定代表人		经雷	王常青

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 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	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## § 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(2020 年 01 月 20 日（基金合同生效日）-2020 年 06 月 30 日)	
	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	16,245,116.65	19,879,888.00
本期利润	16,941,786.83	29,785,596.58
加权平均基金份额本期利润	0.1339	0.1750
本期加权平均净值利润率	13.10%	17.13%
本期基金份额净值增长率	13.68%	13.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	9,479,050.89	15,437,182.01
期末可供分配基金份额利润	0.1364	0.1345

期末基金资产净值	79,000,873.54	130,289,639.73
期末基金份额净值	1.1368	1.1348
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	13.68%	13.48%

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) 嘉实中证 500 指数增强 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实中证 500 指数增强 C 不收取认（申）购费用但收取赎回费、计提销售服务费；(3) 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；(4) 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；(5) 本基金合同生效日为 2020 年 1 月 20 日，本报告期自 2020 年 1 月 20 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 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 500 指数增强 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	10.90%	0.80%	8.04%	0.84%	2.86%	-0.04%
过去三个月	18.83%	1.02%	15.47%	1.08%	3.36%	-0.06%
自基金合同生效起至今	13.68%	1.46%	6.20%	1.76%	7.48%	-0.30%

嘉实中证 500 指数增强 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	10.86%	0.80%	8.04%	0.84%	2.82%	-0.04%
过去三个月	18.72%	1.02%	15.47%	1.08%	3.25%	-0.06%
自基金合同生效起至今	13.48%	1.46%	6.20%	1.76%	7.28%	-0.30%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

中证 500 指数由中证指数有限公司编制，样本空间内股票是由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征。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)=(中证 500 指数(t)/中证 500 指数(t-1)-1)×95%+银行活期存款税后利率×5%

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 500 指数增强 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

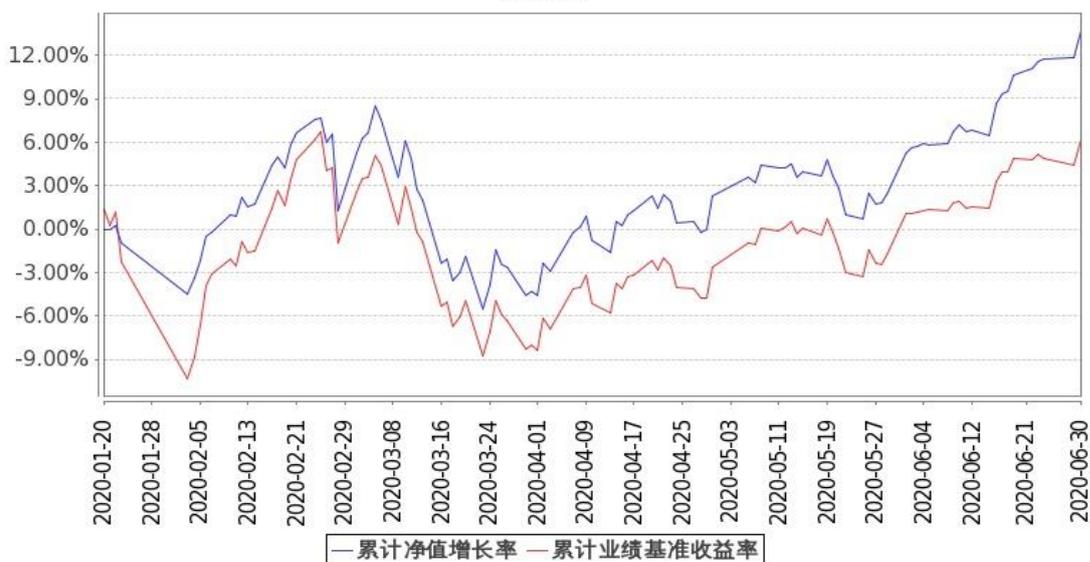


图 1：嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 1 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日)

**嘉实中证500指数增强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**

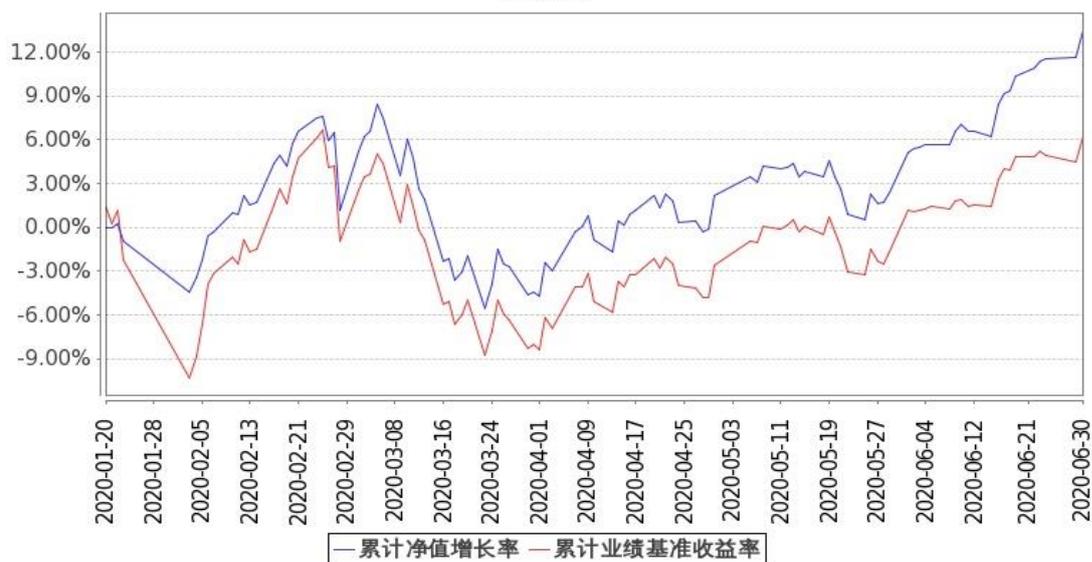


图 2: 嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 1 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日)

注: 本基金基金合同生效日 2020 年 1 月 20 日至报告期末未满足 1 年。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 6 个月为建仓期, 本报告期处于建仓期内。

## § 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, 在北京、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 2020 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金, 具体包括嘉实成长收益混合、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、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、

嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。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		
龙昌伦	本基金、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实长青竞争优势股票基金经理	2020 年 1 月 20 日		6 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期国内股票市场极度分化，上证综指小幅下跌 2.15%，但以成长风格为代表的创业板指数则大幅上涨。前期受新冠肺炎疫情、油价波动冲击和地缘政治影响，金融市场剧烈动荡，后随着疫情逐步得到控制以及出台多种稳经济促就业措施，风险偏好得到有效恢复，市场亦触底回升，但整体来看，市场的核心矛盾仍是局部行业和风格的结构化行情与投资机会，善于个股选择的公募基金超额收益突出。

宏观上看，海外和国内经济受新冠肺炎疫情的冲击而增长放缓，大多数国家实施隔离措施使得经济活动明显下降，甚至出现大萧条以来最严重的经济衰退，也使得逆全球化趋势抬头，地缘政治危机不断，诱发金融市场的巨幅波动。进入 3 月后，全球央行持续推出宽松政策，国内亦出台多项积极的财政和货币措施，包括发行特别国债、降低存款准备金利率和减税降负等，加之严格的疫情控制措施，逐步推动经济缓慢复苏，而随着疫情震中逐渐转移至海外以及控制措施的不到位，海外主要经济体经济前景依旧堪忧。

风格层面上，上半年 A 股市场的主线始终围绕科技、消费和医药，前期集中在医药、在线教育、远程办公、半导体、游戏和 5G 等方向，而后期则体现在新能源、白酒、休闲服务等板块，从因子维度看，成长因子显著占优，而估值因子持续表现较差，新旧经济增长模式的差异巨大。行业方面，医药、休闲服务、电子和食品饮料等涨幅居前，采掘、银行、非银行金融和交通运输则表现靠后。

本基金主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。报告期内，基金保持仓位稳定，以获取超额收益为核心。

#### 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 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.1368 元，本报告期基金份额净值

增长率为 13.68%；截至本报告期末嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1348 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.48%；业绩比较基准收益率为 6.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济上，政策环境友好，一方面稳经济、保就业是下半年逆周期调节政策发力重点方向，包括财政及货币政策的积极可为；与此同时，监管层在资本市场制度建设上持续夯实，包括创业板注册制度的推进，也体现了对 A 股市场的重视程度。经济层面，复工复产推进，经济逐渐修复。在疫情影响下，Q1 经济增速大幅负增。在强力手段控制住疫情后，复工复产稳步推进，国内经济持续复苏。虽然仍对消费心理产生影响，但边际上不断弱化，且欧美复工复产，未来出口不必过分悲观，年内经济有望逐渐修复。在逆周期调节下，市场的流动性预期仍会保持相对宽松，尽管监管层近期释放边际收紧的信号，但考虑到目前经济的初步复苏以及中美摩擦升级，流动性保持宽松的必要性依旧重要。

市场结构方面，预期市场由目前的结构性行业走向全面指数性行情的可能性并不是太大，市场在 7 月初的表现更类似 2014 年风格转换压力释放，但级别和幅度均显著小于 2014 年，更可能是对上半年过于极端和失衡的上涨的短期修复和纠正，鉴于并不强劲的经济复苏很难对周期性资产带来大级别的反弹，进而引发市场走向指数性的全面牛市行情。

综合来看，全球流动性宽裕、无风险利率中枢下移的环境中，以优质股权为代表的高收益愈发稀缺，资产荒问题仍存在，使得 A 股在中期具有很强的投资吸引力，预期下半年股票市场依旧是结构性的机会，风格上相对更看好预期成长和稳定成长，科技、消费板块可能仍是市场主要的投资方向。

本基金将继续在行业中性的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，在控制指数跟踪误差的同时力争为持有人创造更多的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，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

根据本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、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。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## § 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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

		2020 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	21,362,022.38
结算备付金		6,065,896.83
存出保证金		2,489,703.61
交易性金融资产	6.4.7.2	180,101,880.77
其中：股票投资		178,141,242.07
基金投资		-
债券投资		1,960,638.70
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		4,217,130.99
应收利息	6.4.7.5	64,662.08
应收股利		-
应收申购款		244,809.37
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		214,546,106.03
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末 2020 年 6 月 30 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		1,612,723.86
应付赎回款		2,954,199.74
应付管理人报酬		183,650.28
应付托管费		36,730.05
应付销售服务费		45,932.73
应付交易费用	6.4.7.7	307,245.48
应交税费		32,494.20
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	82,616.42
负债合计		5,255,592.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	184,309,717.06
未分配利润	6.4.7.10	24,980,796.21
所有者权益合计		209,290,513.27

负债和所有者权益总计		214,546,106.03
------------	--	----------------

注：本基金合同生效日为 2020 年 1 月 20 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 1 月 20 日起至 2020 年 6 月 30 日止。报告截止日 2020 年 6 月 30 日，嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.1368 元，基金份额总额 69,494,790.97 份；嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.1348 元，基金份额总额 114,814,926.09 份。基金份额总额合计为 184,309,717.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		50,417,579.90
1. 利息收入		410,543.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	211,901.95
债券利息收入		17,865.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		180,775.81
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,203,841.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,470,589.52
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	67,591.82
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	2,663,508.86
股利收益	6.4.7.15	2,002,151.20
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	10,602,378.76
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	200,816.25
减：二、费用		3,690,196.49
1. 管理人报酬		1,355,702.52
2. 托管费		271,140.48
3. 销售服务费		311,598.71
4. 交易费用	6.4.7.18	1,624,021.00
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		9,589.01
7. 其他费用	6.4.7.19	118,144.77

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		46,727,383.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,727,383.41

注：本基金合同生效日为 2020 年 1 月 20 日，本期是指 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 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）	455,702,086.93	-	455,702,086.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,727,383.41	46,727,383.41
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）	-271,392,369.87	-21,746,587.20	-293,138,957.07
其中：1. 基金申购款	99,466,202.04	-348,255.72	99,117,946.32
2. 基金赎回款	-370,858,571.91	-21,398,331.48	-392,256,903.39
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）	184,309,717.06	24,980,796.21	209,290,513.27

注：本基金合同生效日为 2020 年 1 月 20 日，本期是指 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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

罗丽丽

罗丽丽

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 指数增强型证券投资基金（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[2019]2772 号《关于准予嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》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 指数增强型证券投资基金基金合同》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 455,525,209.61 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0065 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 455,702,086.93 份基金份额，其中认购资金利息折合 176,877.32 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，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不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；投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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、创业板及其他依法发行上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权、现金以及法律法规或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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。本基金以标的指数（中证 500 指数）成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金非现金资产的 80%。每一个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低

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；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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<年度报告和中期报告>》、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 指数增强型证券投资基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值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,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳

的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、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、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 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。

### 6.4.5.2 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。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 2020年6月30日
活期存款	21,362,022.38
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	21,362,022.38

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 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	168,367,660.19	178,141,242.07	9,773,581.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,951,187.70	1,960,638.70
	银行间市场	-	-
	合计	1,951,187.70	1,960,638.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	170,318,847.89	180,101,880.77	9,783,032.88

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,418,974.12	-	-	-
其中：股指期货投资	15,418,974.12	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,418,974.12	-	-	-

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
IC2007	IC2007	14	16,238,320.00	819,345.88
总额合计	-	-	-	819,345.88
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	819,345.88
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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	4,413.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,905.96
应收债券利息	57,099.15

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	-
应收出借证券利息	-
其他	243.50
合计	64,662.08

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	307,245.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	307,245.48

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,432.09
应付证券出借违约金	-
预提费用	28,184.33
应付指数使用费	50,000.00
合计	82,616.42

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实中证 500 指数增强 A

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	196,864,056.96	196,864,056.96
本期申购	14,854,153.16	14,854,153.16
本期赎回（以“-”号填列）	-142,223,419.15	-142,223,419.15
本期末	69,494,790.97	69,494,790.97

##### 嘉实中证 500 指数增强 C

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	258,838,029.97	258,838,029.97

本期申购	84,612,048.88	84,612,048.88
本期赎回（以“-”号填列）	-228,635,152.76	-228,635,152.76
本期末	114,814,926.09	114,814,926.09

注：1. 报告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。

2. 本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 1 月 16 日向社会公开募集，截至 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）止，本基金筹集期间认购资金本金折份额为 455,525,209.61 份（嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额为 196,796,078.09 份，嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额为 258,729,131.52 份）；在募集期间利息折份额为 176,877.32 份（其中嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额为 67,978.87 份，嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额为 108,898.45 份），以上实收基金合计 455,702,086.93 元，折合为 455,702,086.93 份嘉实中证 500 指数增强基金份额（嘉实中证 500 指数增强 A 196,864,056.96 份，嘉实中证 500 指数增强 C 258,838,029.97 份）。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	16,245,116.65	696,670.18	16,941,786.83
本期基金份额交易产生的变动数	-6,766,065.76	-669,638.50	-7,435,704.26
其中：基金申购款	857,305.50	-370,665.11	486,640.39
基金赎回款	-7,623,371.26	-298,973.39	-7,922,344.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,479,050.89	27,031.68	9,506,082.57
嘉实中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	19,879,888.00	9,905,708.58	29,785,596.58
本期基金份额交易产生的变动数	-4,442,705.99	-9,868,176.95	-14,310,882.94
其中：基金申购款	5,493,703.02	-6,328,599.13	-834,896.11
基金赎回款	-9,936,409.01	-3,539,577.82	-13,475,986.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,437,182.01	37,531.63	15,474,713.64

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	181,181.82
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	27,942.73
其他	2,777.40
合计	211,901.95

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
卖出股票成交总额	621,198,058.78
减：卖出股票成本总额	586,727,469.26
买卖股票差价收入	34,470,589.52

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	467,260.80
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	399,600.00
减：应收利息总额	68.98
买卖债券差价收入	67,591.82

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.14.2 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 2020年1月20日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
股指期货投资收益	2,663,508.86

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
----	--

股票投资产生的股利收益	2,002,151.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,002,151.20

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至 2020年6月30日
1. 交易性金融资产	9,783,032.88
股票投资	9,773,581.88
债券投资	9,451.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	819,345.88
权证投资	-
期货	819,345.88
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	10,602,378.76

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020 年6月30日
基金赎回费收入	188,139.02
基金转出费收入	12,677.23
合计	200,816.25

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020 年6月30日
交易所市场交易费用	1,624,021.00
银行间市场交易费用	-
合计	1,624,021.00

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	28,184.33
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	89,560.44
其他	400.00
合计	118,144.77

**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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 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
中信建投证券股份有限公司(“中信建投证券”)	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
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

**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
中信建投证券股份有限公司(“中信建投证券”)	基金托管人、基金代销机构
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

**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

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	1,373,556,826.90	100.00

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	2,266,948.50	100.00

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	337,100,000.00	100.00

## 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比 例（%）

中信建投证券股份有限公司	867,138.57	100.00	307,245.48	100.00
--------------	------------	--------	------------	--------

#### 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 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,355,702.52
其中：支付销售机构的客户维护费	151,543.68

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，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 × 1.00% / 当年天数。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	271,140.48

注：支付基金托管人中信建投证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

##### 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 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 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 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	78,946.40	78,946.40
中信建投	-	164,715.64	164,715.64
嘉实财富	-	25.45	25.45

合计	-	243,687.49	243,687.49
----	---	------------	------------

注：(1) 本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×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

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 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 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信建投证券_活期	21,362,022.38	181,181.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本期（2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2020 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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	18,000	90,000.00	117,720.00	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新发未上市	36.18	36.18	2,169	78,474.42	78,474.42	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123055	晨光转债	2020年6月17日	2020年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	925	92,500.00	92,500.00	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**  
无。

**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**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**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**

本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、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采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求有效跟踪标的指数，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为

所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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通过券款对付的方式进行交割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

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**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 2020 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	170,958.20
未评级	-
合计	170,958.20

注：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**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

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

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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%。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 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	21,362,022.38	-	-	-	21,362,022.38
结算备付金	6,065,896.83	-	-	-	6,065,896.83
存出保证金	541,105.21	-	-	1,948,598.40	2,489,703.61
交易性金融资产	1,789,680.50	-	170,958.20	178,141,242.07	180,101,880.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,217,130.99	4,217,130.99
应收利息	-	-	-	64,662.08	64,662.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	244,809.37	244,809.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>29,758,704.92</b>	<b>-</b>	<b>170,958.20</b>	<b>184,616,442.91</b>	<b>214,546,106.03</b>
<b>负债</b>					
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	-	-	-	1,612,723.86	1,612,723.86
应付赎回款	-	-	-	2,954,199.74	2,954,199.74
应付管理人报酬	-	-	-	183,650.28	183,650.28
应付托管费	-	-	-	36,730.05	36,730.05
应付销售服务费	-	-	-	45,932.73	45,932.73
应付交易费用	-	-	-	307,245.48	307,245.48
应付税费	-	-	-	32,494.20	32,494.20
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	82,616.42	82,616.42
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,255,592.76</b>	<b>5,255,592.76</b>

利率敏感度缺口	29,758,704.92	-	170,958.20	179,360,850.15	209,290,513.27
---------	---------------	---	------------	----------------	----------------

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 2020 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.94%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

本基金作为增强指数型基金,以跟踪中证 500 指数为主,一般情况下保持各类资产配置的基本稳定,与此同时,将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析,根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置,在控制基金跟踪误差的前提下,通过对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。

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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	178,141,242.07	85.12
交易性金融资产-基金投资	-	-

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	178,141,242.07	85.12

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 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 178,111,749.03 元，属于第二层次的余额为 1,990,131.74 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。

##### (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	178,141,242.07	83.03
	其中：股票	178,141,242.07	83.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,960,638.70	0.91
	其中：债券	1,960,638.70	0.91
	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	27,427,919.21	12.78
8	其他各项资产	7,016,306.05	3.27
9	合计	214,546,106.03	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	849,150.00	0.41
B	采矿业	2,303,056.00	1.10
C	制造业	85,402,704.92	40.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,850,479.40	1.84
E	建筑业	3,101,523.00	1.48
F	批发和零售业	11,967,757.80	5.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,185,953.00	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,030,223.00	5.27
J	金融业	8,100,805.00	3.87
K	房地产业	6,629,840.00	3.17
L	租赁和商务服务业	276,360.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	924,768.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,242.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,280,555.00	1.57
S	综合	1,598,974.00	0.76
	合计	143,503,391.12	68.57

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	939,120.00	0.45
C	制造业	21,439,303.18	10.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	236,676.00	0.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,210,347.77	4.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	792,880.00	0.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,019,524.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,637,850.95	16.55

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603444	吉比特	7,400	4,062,674.00	1.94
2	600298	安琪酵母	74,000	3,661,520.00	1.75
3	600486	扬农化工	43,400	3,580,500.00	1.71
4	002385	大北农	390,800	3,560,188.00	1.70
5	002028	思源电气	170,600	3,490,476.00	1.67

6	002013	中航机电	439,100	3,468,890.00	1.66
7	000513	丽珠集团	71,400	3,427,914.00	1.64
8	600507	方大特钢	609,768	3,164,695.92	1.51
9	600901	江苏租赁	605,700	3,155,697.00	1.51
10	002653	海思科	118,400	3,150,624.00	1.51
11	601799	星宇股份	24,500	3,111,500.00	1.49
12	002223	鱼跃医疗	77,300	2,813,720.00	1.34
13	600426	华鲁恒升	151,700	2,682,056.00	1.28
14	600657	信达地产	607,800	2,504,136.00	1.20
15	002815	崇达技术	118,000	2,387,140.00	1.14
16	600529	山东药玻	38,500	2,233,000.00	1.07
17	600804	鹏博士	240,900	2,163,282.00	1.03
18	601000	唐山港	962,600	2,146,598.00	1.03
19	002368	太极股份	48,400	2,114,596.00	1.01
20	002353	杰瑞股份	68,200	2,114,200.00	1.01
21	300133	华策影视	287,000	2,080,750.00	0.99
22	002416	爱施德	287,300	2,062,814.00	0.99
23	000090	天健集团	282,900	1,954,839.00	0.93
24	600466	蓝光发展	357,600	1,927,464.00	0.92
25	002807	江阴银行	480,600	1,888,758.00	0.90
26	300618	寒锐钴业	29,800	1,848,196.00	0.88
27	300482	万孚生物	17,600	1,830,400.00	0.87
28	000547	航天发展	132,200	1,807,174.00	0.86
29	603939	益丰药房	19,700	1,792,700.00	0.86
30	002185	华天科技	127,000	1,718,310.00	0.82
31	600557	康缘药业	118,900	1,655,088.00	0.79
32	600380	健康元	100,500	1,632,120.00	0.78
33	300558	贝达药业	11,500	1,609,770.00	0.77
34	600673	东阳光	231,400	1,598,974.00	0.76
35	600058	五矿发展	249,400	1,506,376.00	0.72
36	600549	厦门钨业	123,900	1,466,976.00	0.70
37	600704	物产中大	337,800	1,422,138.00	0.68
38	600782	新钢股份	347,400	1,417,392.00	0.68
39	600060	海信视像	113,300	1,376,595.00	0.66
40	300088	长信科技	118,800	1,330,560.00	0.64
41	002233	塔牌集团	104,800	1,260,744.00	0.60
42	603866	桃李面包	24,200	1,231,538.00	0.59
43	002048	宁波华翔	76,000	1,173,440.00	0.56
44	601717	郑煤机	196,900	1,159,741.00	0.55
45	002273	水晶光电	67,100	1,150,094.00	0.55
46	002375	亚厦股份	112,200	1,146,684.00	0.55
47	600729	重庆百货	36,000	1,123,920.00	0.54

48	002797	第一创业	162,100	1,121,732.00	0.54
49	603659	璞泰来	10,700	1,102,314.00	0.53
50	600845	宝信软件	18,500	1,092,980.00	0.52
51	600125	铁龙物流	179,300	1,000,494.00	0.48
52	603868	飞科电器	20,100	991,533.00	0.47
53	601869	长飞光纤	32,000	985,920.00	0.47
54	300357	我武生物	15,800	983,550.00	0.47
55	002221	东华能源	109,600	963,384.00	0.46
56	002019	亿帆医药	41,500	953,255.00	0.46
57	000488	晨鸣纸业	190,500	941,070.00	0.45
58	300012	华测检测	46,800	924,768.00	0.44
59	600266	城建发展	178,920	907,124.40	0.43
60	600664	哈药股份	291,500	897,820.00	0.43
61	600348	阳泉煤业	212,600	897,172.00	0.43
62	000758	中色股份	210,600	880,308.00	0.42
63	002390	信邦制药	187,800	856,368.00	0.41
64	600748	上实发展	167,200	854,392.00	0.41
65	000998	隆平高科	51,000	849,150.00	0.41
66	600811	东方集团	180,500	797,810.00	0.38
67	600167	联美控股	55,600	797,304.00	0.38
68	300316	晶盛机电	32,100	794,154.00	0.38
69	601598	中国外运	235,700	761,311.00	0.36
70	601966	玲珑轮胎	36,600	739,320.00	0.35
71	600008	首创股份	235,300	708,253.00	0.34
72	000932	华菱钢铁	187,600	707,252.00	0.34
73	601615	明阳智能	56,600	704,670.00	0.34
74	002439	启明星辰	16,600	698,362.00	0.33
75	002317	众生药业	40,400	693,264.00	0.33
76	000598	兴蓉环境	150,400	691,840.00	0.33
77	000401	冀东水泥	43,100	691,324.00	0.33
78	000563	陕国投 A	180,900	671,139.00	0.32
79	600153	建发股份	82,600	669,060.00	0.32
80	603233	大参林	8,040	653,008.80	0.31
81	000807	云铝股份	148,300	646,588.00	0.31
82	002174	游族网络	24,500	638,960.00	0.31
83	600859	王府井	14,000	637,700.00	0.30
84	601811	新华文轩	58,000	589,860.00	0.28
85	002821	凯莱英	2,400	583,200.00	0.28
86	600273	嘉化能源	66,600	582,084.00	0.28
87	000027	深圳能源	118,060	547,798.40	0.26
88	600315	上海家化	11,400	546,060.00	0.26
89	600572	康恩贝	97,000	533,500.00	0.25

90	603328	依顿电子	50,700	528,801.00	0.25
91	601969	海南矿业	107,700	525,576.00	0.25
92	002745	木林森	33,000	508,530.00	0.24
93	002511	中顺洁柔	21,500	479,450.00	0.23
94	600909	华安证券	69,100	471,953.00	0.23
95	001914	招商积余	14,200	436,366.00	0.21
96	000883	湖北能源	116,500	410,080.00	0.20
97	002500	山西证券	62,100	406,134.00	0.19
98	000543	皖能电力	98,200	394,764.00	0.19
99	000800	一汽解放	36,500	392,010.00	0.19
100	000012	南玻A	77,900	391,058.00	0.19
101	000750	国海证券	88,800	385,392.00	0.18
102	002387	维信诺	24,600	351,288.00	0.17
103	600739	辽宁成大	17,900	338,847.00	0.16
104	000623	吉林敖东	20,700	325,611.00	0.16
105	600757	长江传媒	63,000	320,670.00	0.15
106	002648	卫星石化	18,900	307,503.00	0.15
107	600021	上海电力	40,600	300,440.00	0.14
108	300182	捷成股份	72,500	289,275.00	0.14
109	603885	吉祥航空	30,500	277,550.00	0.13
110	600138	中青旅	28,000	276,360.00	0.13
111	600779	水井坊	4,400	274,648.00	0.13
112	300166	东方国信	20,900	259,369.00	0.12
113	600835	上海机电	11,800	199,774.00	0.10
114	600765	中航重机	19,200	196,224.00	0.09
115	603377	东方时尚	75	1,242.00	0.00
116	600823	世茂股份	80	357.60	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300214	日科化学	375,200	3,054,128.00	1.46
2	300036	超图软件	120,700	3,039,226.00	1.45
3	002384	东山精密	101,400	3,036,930.00	1.45
4	600323	瀚蓝环境	92,300	2,019,524.00	0.96
5	002555	三七互娱	40,400	1,890,720.00	0.90
6	300674	宇信科技	38,700	1,669,905.00	0.80
7	002531	天顺风能	278,000	1,662,440.00	0.79
8	002014	永新股份	164,800	1,549,120.00	0.74
9	300124	汇川技术	37,000	1,405,630.00	0.67
10	300607	拓斯达	33,300	1,354,977.00	0.65

11	002869	金溢科技	18,500	1,222,480.00	0.58
12	603611	诺力股份	53,500	1,148,110.00	0.55
13	603238	诺邦股份	26,000	1,097,200.00	0.52
14	002100	天康生物	68,000	1,094,800.00	0.52
15	600583	海油工程	206,400	939,120.00	0.45
16	300638	广和通	15,600	937,560.00	0.45
17	300138	晨光生物	70,700	858,298.00	0.41
18	300770	新媒股份	3,500	782,810.00	0.37
19	300440	运达科技	71,100	711,711.00	0.34
20	603260	合盛硅业	25,300	691,702.00	0.33
21	002609	捷顺科技	44,700	569,925.00	0.27
22	600510	黑牡丹	68,000	535,840.00	0.26
23	300552	万集科技	12,540	533,953.20	0.26
24	300390	天华超净	37,200	518,196.00	0.25
25	600612	老凤祥	10,500	505,995.00	0.24
26	002475	立讯精密	8,539	438,477.65	0.21
27	603186	华正新材	7,200	358,344.00	0.17
28	300179	四方达	48,400	274,428.00	0.13
29	000656	金科股份	31,500	257,040.00	0.12
30	600477	杭萧钢构	65,200	236,676.00	0.11
31	688027	国盾量子	2,169	78,474.42	0.04
32	603087	甘李药业	753	75,525.90	0.04
33	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
34	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
35	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
36	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
37	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
38	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
39	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
40	603538	美诺华	40	2,039.20	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002745	木林森	8,633,543.49	4.13
2	002384	东山精密	8,529,827.96	4.08
3	000027	深圳能源	8,200,363.50	3.92
4	002013	中航机电	8,120,202.07	3.88
5	600486	扬农化工	7,828,299.00	3.74
6	300014	亿纬锂能	7,437,635.00	3.55
7	600763	通策医疗	6,961,492.00	3.33
8	600745	闻泰科技	6,683,605.99	3.19

9	601019	山东出版	6,056,626.48	2.89
10	603444	吉比特	6,051,640.59	2.89
11	002572	索菲亚	6,031,478.66	2.88
12	002028	思源电气	6,024,389.59	2.88
13	000623	吉林敖东	5,803,307.50	2.77
14	600917	重庆燃气	5,761,229.61	2.75
15	300253	卫宁健康	5,755,673.58	2.75
16	600985	淮北矿业	5,728,146.50	2.74
17	600967	内蒙一机	5,672,034.00	2.71
18	600782	新钢股份	5,559,313.00	2.66
19	600728	佳都科技	5,513,270.00	2.63
20	002180	纳思达	5,471,199.02	2.61
21	002221	东华能源	5,368,916.00	2.57
22	600729	重庆百货	5,359,630.91	2.56
23	002048	宁波华翔	5,323,513.00	2.54
24	601168	西部矿业	5,270,796.53	2.52
25	600881	亚泰集团	5,265,284.97	2.52
26	600380	健康元	5,261,264.48	2.51
27	000987	越秀金控	5,173,926.46	2.47
28	600901	江苏租赁	5,167,297.58	2.47
29	601958	金钼股份	5,166,293.00	2.47
30	300207	欣旺达	5,017,000.00	2.40
31	000513	丽珠集团	4,913,235.81	2.35
32	601717	郑煤机	4,829,760.29	2.31
33	300498	温氏股份	4,799,389.70	2.29
34	300543	朗科智能	4,789,174.00	2.29
35	600282	南钢股份	4,774,044.00	2.28
36	002385	大北农	4,677,395.00	2.23
37	300072	三聚环保	4,633,176.30	2.21
38	600466	蓝光发展	4,610,564.47	2.20
39	600335	国机汽车	4,523,539.00	2.16
40	000932	华菱钢铁	4,458,520.18	2.13
41	002475	立讯精密	4,379,461.00	2.09
42	601799	星宇股份	4,353,711.00	2.08
43	600557	康缘药业	4,344,595.38	2.08

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300014	亿纬锂能	9,706,428.22	4.64
2	300253	卫宁健康	8,969,457.04	4.29
3	600763	通策医疗	8,371,427.00	4.00

4	002745	木林森	8,294,103.75	3.96
5	000027	深圳能源	7,592,748.00	3.63
6	600745	闻泰科技	7,229,476.00	3.45
7	002384	东山精密	6,645,232.50	3.18
8	600728	佳都科技	6,280,632.20	3.00
9	002572	索菲亚	6,035,121.24	2.88
10	601019	山东出版	6,023,896.40	2.88
11	600917	重庆燃气	5,964,014.36	2.85
12	002180	纳思达	5,942,815.71	2.84
13	002013	中航机电	5,853,111.50	2.80
14	600967	内蒙一机	5,566,855.79	2.66
15	000623	吉林敖东	5,564,698.28	2.66
16	600985	淮北矿业	5,366,316.02	2.56
17	002221	东华能源	5,231,362.12	2.50
18	000987	越秀金控	5,227,247.69	2.50
19	300543	朗科智能	5,197,642.00	2.48
20	600143	金发科技	5,114,027.00	2.44
21	600881	亚泰集团	5,095,131.30	2.43
22	002475	立讯精密	5,014,182.00	2.40
23	601168	西部矿业	4,965,713.09	2.37
24	600282	南钢股份	4,819,782.40	2.30
25	601958	金钼股份	4,809,957.00	2.30
26	600380	健康元	4,796,317.61	2.29
27	300498	温氏股份	4,735,485.00	2.26
28	600335	国机汽车	4,619,011.02	2.21
29	002048	宁波华翔	4,574,207.00	2.19
30	600486	扬农化工	4,433,407.26	2.12
31	300207	欣旺达	4,385,351.00	2.10
32	600510	黑牡丹	4,330,895.84	2.07
33	002242	九阳股份	4,291,526.59	2.05
34	603766	隆鑫通用	4,198,750.00	2.01

### 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	755,095,129.45
卖出股票收入（成交）总额	621,198,058.78

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,789,680.50	0.86
	其中：政策性金融债	1,789,680.50	0.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	170,958.20	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,960,638.70	0.94

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	17,870	1,789,680.50	0.86
2	123055	晨光转债	925	92,500.00	0.04
3	113583	益丰转债	590	78,458.20	0.04

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 支债券。

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  
无。

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  
无。

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  
无。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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
IC2007	IC2007	14	16,238,320.00	819,345.88	-
公允价值变动总额合计（元）					819,345.88
股指期货投资本期收益（元）					2,663,508.86
股指期货投资本期公允价值变动（元）					819,345.88

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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，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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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) 2019 年 11 月 8 日，方大特钢科技股份有限公司发布《关于公司收到行政处罚决定书的公告》，公司收到南昌市应急管理局下发的《行政处罚决定书》[（洪）应急罚[2019]01 号]，因违反了《中华人民共和国安全生产法》第十七条的规定，南昌市应急管理局依据《中华人民共和国安全生产法》第一百零九条第（二）项和《安全生产行政处罚自由裁量适用规则（试行）》第十五条第七款的规定，决定给予方大特钢人民币 1,000,000 元的行政处罚。

2019 年 9 月 25 日，江苏银保监局发布行政处罚信息公开表（苏银保监罚决字【2019】18 号），对江苏金融租赁股份有限公司以公益性资产作为租赁物、违规提供融资等违法违规事实，于 2019 年 9 月 16 日作出行政处罚决定，罚款人民币 50 万元。

本基金投资于“方大特钢（600507）”、“江苏租赁（600901）”的决策程序说明：基于对方大特钢、江苏租赁基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“方大特钢”、“江苏租赁”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

#### 7.12.2

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。

#### 7.12.3 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	2,489,703.61
2	应收证券清算款	4,217,130.99
3	应收股利	-
4	应收利息	64,662.08
5	应收申购款	244,809.37
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,016,306.05

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 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500指数增强A	1,740	39,939.54	99,255.86	0.14	69,395,535.11	99.86
嘉实中证500指数增强C	1,195	96,079.44	64,722,178.71	56.37	50,092,747.38	43.63
合计	2,890	63,774.99	64,821,434.57	35.17	119,488,282.49	64.83

注：(1) 嘉实中证 500 指数增强 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 500 指数增强 A 份额占嘉实中证 500 指数增强 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证 500 指数增强 A 份额占嘉实中证 500 指数增强 A 总份额比例；

(2) 嘉实中证 500 指数增强 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 500 指数增强 C 份额占嘉实中证 500 指数增强 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实中证 500 指数增强 C 份额占嘉实中证 500 指数增强 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 500 指数增强 A	77,980.01	0.11
	嘉实中证 500 指数增强 C	21,014.23	0.02
	合计	98,994.24	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、 基金投资和研究部门 负责人持有本开放式 基金	嘉实中证 500 指数增强 A	0
	嘉实中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实中证 500 指数增强 A	0
	嘉实中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 500 指数增强 A	嘉实中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020 年 1 月 20 日）基金份额总额	196,864,056.96	258,838,029.97
本报告期基金总申购份额	14,854,153.16	84,612,048.88
减：本报告期基金总赎回 份额	142,223,419.15	228,635,152.76
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	69,494,790.97	114,814,926.09

注：报告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

2020 年 4 月 8 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》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 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》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

## 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、托管人的托管业务部门及其相关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	
中信建投证券股份有限公司	2	1,373,556,826.90	100.00%	867,138.57	100.00%	新增

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。

## 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	
	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
中信建投证券股份有限公司	2,266,948.50	100.00%	337,100,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 21 日
2	关于嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 02 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

							(%)
机构	1	2020/03/19 至 2020/06/30	-	71,121,886.21	6,900,000.00	64,221,886.21	34.84
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- (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 指数增强型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

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

### 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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日