嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年半年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§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 2017 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

§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	416,919,122.53份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实

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

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	（010）65215588	（010）67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	（010）67595096
传真		（010）65182266	（010）66275853

2.4 信息披露方式

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

§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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-10,477,123.13
本期利润	-11,107,930.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0273
本期加权平均净值利润率	-1.60%
本期基金份额净值增长率	-0.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	286,087,213.54
期末可供分配基金份额利润	0.6862
期末基金资产净值	703,006,336.07
期末基金份额净值	1.6862
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	68.62%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.40%	0.88%	5.12%	0.89%	0.28%	-0.01%
过去三个月	-3.48%	0.96%	-3.90%	0.97%	0.42%	-0.01%

过去六个月	-0.82%	0.84%	-1.87%	0.85%	1.05%	-0.01%
过去一年	2.47%	0.85%	0.29%	0.86%	2.18%	-0.01%
过去三年	50.86%	1.93%	54.18%	1.96%	-3.32%	-0.03%
自基金合同生效起至今	68.62%	1.76%	69.20%	1.79%	-0.58%	-0.03%

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

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

Benchmark(0)=1000

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

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

其中 t=1,2,3,…。

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

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

（2013 年 3 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日）

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2017年6月30日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、129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、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债、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、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉

实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、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、嘉实稳康纯债债券、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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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H股指数（QDII-LOF）、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、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基金经理	2016年1月5日	-	12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）、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、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、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	-	11年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-ClaringtonInvestmentsInc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(FranklinTempletonInvestmentsCorp.)。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）基金经理的任职日期是指公司作出决定后公告之日，离任日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、

严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的，合计6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0.03%，年化跟踪误差为0.41%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

本基金为目标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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.6862元；本报告期基金份额净值增长率为-0.82%，业绩比较基准收益率为-1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将继续秉承指数化投资管理策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

（1）报告期内本基金未实施利润分配；

（2）根据本报告3.1.1“本期利润”为-11,107,930.17元，以及基金合同（十五（三）基金收益分配原则）约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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： 2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	39,913,202.24	36,752,219.64
结算备付金		1,815,257.50	991,718.04
存出保证金		864,528.60	1,339,584.59
交易性金融资产	6.4.7.2	663,612,963.96	568,114,221.71
其中：股票投资		24,402,836.60	5,663,018.40
基金投资		639,210,127.36	562,451,203.31
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,822.28	8,809.02
应收股利		-	-
应收申购款		600,809.65	600,811.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	36,065.02
资产总计		706,815,584.23	607,843,429.53
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017年6月30日**	**上年度末 2016年12月31日**

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,011.85	10.00
应付赎回款		3,232,606.10	734,593.27
应付管理人报酬		27,595.45	25,398.09
应付托管费		5,519.09	5,079.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	257,037.20	164,656.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	285,478.47	361,972.88
负债合计		3,809,248.16	1,291,710.27
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	416,919,122.53	356,775,373.10
未分配利润	6.4.7.10	286,087,213.54	249,776,346.16
所有者权益合计		703,006,336.07	606,551,719.26
负债和所有者权益总计		706,815,584.23	607,843,429.53

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.6862元，基金份额总额416,919,122.53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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		-9,969,230.35	-66,542,741.87
1.利息收入		158,602.72	129,079.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	158,602.31	129,078.92
债券利息收入		0.41	0.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,113,264.88	-3,013,463.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,507,160.84	-972,794.89
基金投资收益	6.4.7.13	- 8,701,542.04	-1,842,766.35
债券投资收益	6.4.7.14	309.79	557.84
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-66,480.00	-274,861.82
股利收益	6.4.7.16	161,608.21	76,401.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-630,807.04	-63,906,767.66
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	616,238.85	248,409.87
减：二、费用		1,138,699.82	601,959.92
1．管理人报酬		173,745.96	109,760.01
2．托管费		34,749.19	21,952.04
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	743,685.36	272,997.36

5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	186,519.31	197,250.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,107,930.17	-67,144,701.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,107,930.17	-67,144,701.79

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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	356,775,373.10	249,776,346.16	606,551,719.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,107,930.17	-11,107,930.17
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）	60,143,749.43	47,418,797.55	107,562,546.98
其中：1.基金申购款	362,032,857.09	262,861,129.39	624,893,986.48
2.基金赎回款	-301,889,107.66	-215,442,331.84	-517,331,439.50
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）	416,919,122.53	286,087,213.54	703,006,336.07
项目	**上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	208,255,614.26	204,742,440.92	412,998,055.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-67,144,701.79	-67,144,701.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	132,499,639.55	82,348,163.99	214,847,803.54
其中：1.基金申购款	259,165,880.62	157,986,345.71	417,152,226.33
2.基金赎回款	-126,666,241.07	-75,638,181.72	-202,304,422.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	340,755,253.81	219,945,903.12	560,701,156.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵学军	王红	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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
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

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	173,745.96	109,760.01
其中：支付销售机构的客户维护费	450,702.27	332,928.04

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

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

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,749.19	21,952.04

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

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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。

6.4.4.4.2 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（2017年6月30日）及上年度末（2016年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	39,913,202.24	138,198.04	35,807,395.93	100,499.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

报告期末（2017年6月30日），本基金持有101,914,880.00份目标ETF基金份额（2016年12月31日：89,188,780.00份），占其总份额的比例为62.92%（2016年12月31日59.89%）。

6.4.5 期末（ 2017年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2017年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代	股票	停牌日	停牌原	期末	复牌日期	复牌	数量	期末	期末估值	备注

码	名称	期	因	估值单价		开盘单价	（股）	成本总额	总额	
000061	农产品	2017年6月28日	重大事项停牌	9.06	-	-	4,500	40,541.24	40,770.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事项停牌	11.26	-	-	3,800	43,876.61	42,788.00	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事项停牌	6.54	2017年7月5日	5.92	63,300	403,238.07	413,982.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事项停牌	10.33	2017年8月2日	11.36	5,700	59,793.91	58,881.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	24.95	2017年7月4日	22.46	1,400	34,724.61	34,930.00	-
002122	天马股份	2017年4月24日	重大事项停牌	10.30	2017年7月24日	11.15	11,200	115,933.66	115,360.00	-
002127	南极电商	2017年6月29日	重大事项停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	4,800	59,736.41	57,984.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事项停牌	8.70	2017年8月14日	9.57	4,000	36,008.80	34,800.00	-
002168	深圳惠程	2017年1月23日	重大事项停牌	16.99	-	-	5,100	82,817.20	86,649.00	-

002358	森源电气	2017年5月12日	重大事项停牌	17.02	2017年7月12日	16.68	1,300	23,184.68	22,126.00	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事项停牌	20.23	-	-	4,300	89,847.52	86,989.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项停牌	3.50	-	-	8,400	29,779.99	29,400.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事项停牌	25.06	2017年7月7日	22.54	3,800	94,947.62	95,228.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项停牌	12.59	2017年7月3日	12.70	2,200	28,281.43	27,698.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项停牌	15.75	2017年8月9日	14.50	4,500	72,006.16	70,875.00	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事项停牌	23.36	-	-	2,100	49,355.93	49,056.00	-
300291	华录百纳	2017年4月19日	重大事项停牌	20.02	-	-	2,800	55,729.96	56,056.00	-
600277	亿利洁能	2017年3月6日	重大事项停牌	7.83	-	-	5,900	45,340.12	46,197.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月	重大事项停牌	10.94	2017年8月18日	12.03	7,500	82,746.45	82,050.00	-

		10日								
600460	士兰微	2017年5月12日	重大事项停牌	6.07	2017年8月15日	6.68	4,400	27,438.77	26,708.00	-
600468	百利电气	2017年5月16日	重大事项停牌	6.50	-	-	1,500	10,486.81	9,750.00	-
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事项停牌	11.96	2017年7月3日	12.44	3,700	42,639.03	44,252.00	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项停牌	16.30	2017年8月2日	16.48	7,600	107,578.81	123,880.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项停牌	11.32	-	-	5,400	60,056.51	61,128.00	-
600657	信达地产	2017年2月20日	重大事项停牌	5.76	2017年8月10日	6.19	4,300	25,257.90	24,768.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事项停牌	7.29	-	-	10,600	75,808.19	77,274.00	-
601001	大同煤业	2017年6月22日	重大事项停牌	5.25	2017年7月21日	5.78	5,800	29,179.67	30,450.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事项停牌	7.79	-	-	21,000	169,617.36	163,590.00	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2017年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	24,402,836.60	3.45
	其中：股票	24,402,836.60	3.45
2	基金投资	639,210,127.36	90.44
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,728,459.74	5.90
8	其他各项资产	1,474,160.53	0.21
9	合计	706,815,584.23	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	289,326.00	0.04
B	采矿业	675,615.00	0.10
C	制造业	15,062,642.70	2.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	800,052.00	0.11

E	建筑业	541,485.40	0.08
F	批发和零售业	1,289,570.80	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	642,512.00	0.09
H	住宿和餐饮业	27,100.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,767,727.70	0.25
J	金融业	342,885.00	0.05
K	房地产业	1,743,963.00	0.25
L	租赁和商务服务业	454,693.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	60,877.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	207,928.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,072.00	0.00
Q	卫生和社会工作	62,920.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	294,687.00	0.04
S	综合	108,780.00	0.02
	合计	24,402,836.60	3.47

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	63,300	413,982.00	0.06
2	300136	信维通信	4,600	184,092.00	0.03
3	601717	郑煤机	21,000	163,590.00	0.02
4	002460	赣锋锂业	3,100	143,375.00	0.02
5	600487	亨通光电	5,100	143,055.00	0.02
6	002572	索菲亚	3,300	135,300.00	0.02

7	600201	生物股份	3,600	128,052.00	0.02
8	600643	爱建集团	7,600	123,880.00	0.02
9	601012	隆基股份	7,000	119,700.00	0.02
10	300156	神雾环保	3,600	117,936.00	0.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（http://www.jsfund.cn）的半年度报告正文。

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	300136	信维通信	2,183,687.15	0.36
2	600201	生物股份	1,963,505.15	0.32
3	002460	赣锋锂业	1,959,113.00	0.32
4	600487	亨通光电	1,903,319.56	0.31
5	600525	长园集团	1,845,065.60	0.30
6	000066	长城电脑	1,844,526.30	0.30
7	600522	中天科技	1,840,042.00	0.30
8	600584	长电科技	1,801,717.37	0.30
9	601012	隆基股份	1,794,945.00	0.30
10	300156	神雾环保	1,760,551.30	0.29
11	600219	南山铝业	1,747,674.00	0.29
12	600079	人福医药	1,733,615.57	0.29
13	002572	索菲亚	1,718,108.85	0.28
14	002405	四维图新	1,692,562.76	0.28
15	000656	金科股份	1,665,038.98	0.27

16	002508	老板电器	1,569,032.01	0.26
17	300296	利亚德	1,489,060.00	0.25
18	600315	上海家化	1,486,572.89	0.25
19	002340	格林美	1,475,154.00	0.24
20	002092	中泰化学	1,470,397.00	0.24

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	300136	信维通信	1,626,411.80	0.27
2	002460	赣锋锂业	1,451,044.90	0.24
3	000066	长城电脑	1,374,659.30	0.23
4	600487	亨通光电	1,361,981.19	0.22
5	600522	中天科技	1,350,767.00	0.22
6	601012	隆基股份	1,346,359.00	0.22
7	600525	长园集团	1,323,387.00	0.22
8	002508	老板电器	1,307,897.91	0.22
9	002572	索菲亚	1,289,116.92	0.21
10	600219	南山铝业	1,282,153.00	0.21
11	600079	人福医药	1,281,745.00	0.21
12	300156	神雾环保	1,279,363.44	0.21
13	600584	长电科技	1,250,578.03	0.21
14	600201	生物股份	1,207,266.00	0.20
15	002405	四维图新	1,176,364.90	0.19
16	300296	利亚德	1,081,035.51	0.18
17	600315	上海家化	1,068,074.00	0.18

18	002092	中泰化学	1,058,090.21	0.17
19	002271	东方雨虹	1,052,416.00	0.17
20	600635	大众公用	1,035,238.88	0.17

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	350,021,282.01
卖出股票收入（成交）总额	250,430,173.85

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前十名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	639,210,127.36	90.93

				公司		

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
IC1709	中证500股指期货IC1709合约	3	3,613,080.00	79,080.00	-
公允价值变动总额合计（元）					79,080.00
股指期货投资本期收益（元）					-66,480.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					268,040.00

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

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

7.13.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	864,528.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,822.28
5	应收申购款	600,809.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,474,160.53

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000656	金科股份	413,982.00	0.06	重大事项停牌
2	601717	郑煤机	163,590.00	0.02	重大事项停牌
3	600643	爱建集团	123,880.00	0.02	重大事项停牌

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
59,355	7,024.16	32,350,133.95	7.76%	384,568,988.58	92.24%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	120,587.93	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月22日）基金份额总额	292,915,388.83
本报告期期初基金份额总额	356,775,373.10
本报告期基金总申购份额	362,032,857.09
减:本报告期基金总赎回份额	301,889,107.66
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	416,919,122.53

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	318,723,363.96	53.10%	223,117.34	53.10%	-
中信建投证券股份有限公司	1	231,520,532.91	38.57%	162,064.83	38.57%	-
海通证券股份有限公司	1	35,815,782.17	5.97%	25,071.37	5.97%	-
广发证券股份有限公司	2	14,209,398.22	2.37%	9,946.59	2.37%	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限	1	-	-	-	-	-

公司						
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

注2：交易单元的选择标准和程序

（1）经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

（2）公司财务状况良好；

（3）有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

（4）有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

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

注3：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租上海交易单元1个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	2,047,561.19	100.00%
中信建投	3,310.20	100.00%	-	-	-	-	-	-

证券股份有限公司								

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话400-600-8800，或发E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017年8月26日