

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 04 月 08 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 审计报告</b>	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.4 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 .....	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 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 .....	81
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 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
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	500ETF
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	625,931,868.00 份
基金合同存续期	不定期
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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)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 27 楼 09-14 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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座 普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-33,945,605.04	-114,993,316.90	16,006,833.06
本期利润	473,996,397.93	-448,641,628.78	32,690,040.37
加权平均基金份额 本期利润	1.0364	-2.0710	0.1915
本期加权平均净值 利润率	19.75%	-38.82%	2.97%
本期基金份额净值 增长率	28.00%	-32.24%	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	1,255,320,111.22	229,686,666.35	458,991,095.22
期末可供分配基金 份额利润	2.0055	0.7865	2.8574
期末基金资产净值	3,487,745,146.67	1,271,236,532.11	1,031,894,668.15
期末基金份额净值	5.5721	4.3531	6.4240
3.1.3 累计期末指 标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值 增长率	56.23%	22.05%	80.12%

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

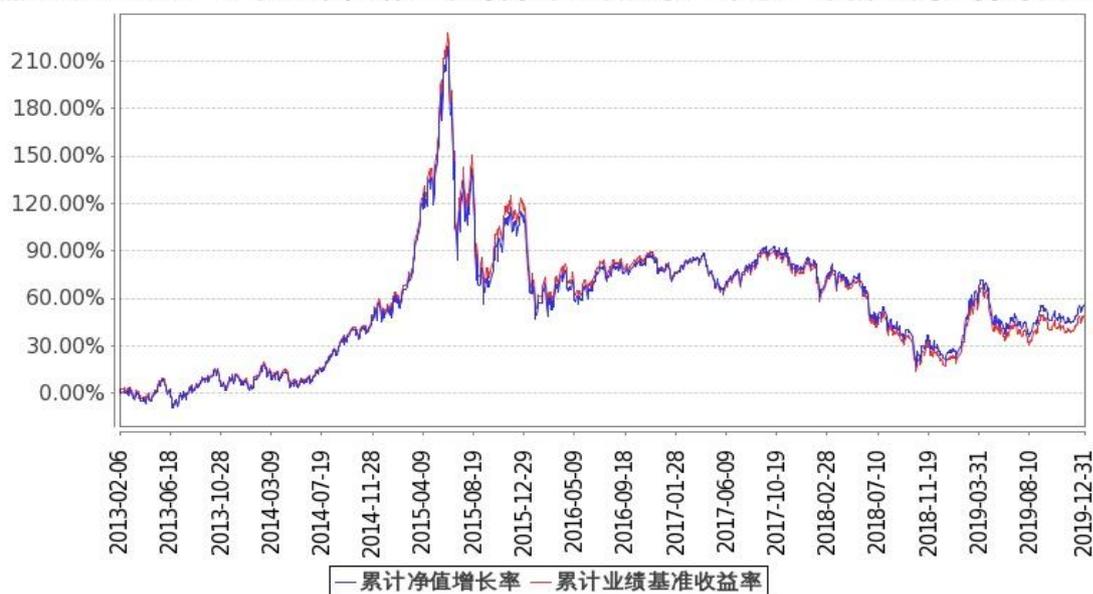
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.91%	0.92%	6.61%	0.92%	0.30%	0.00%
过去六个月	7.32%	1.08%	6.41%	1.08%	0.91%	0.00%
过去一年	28.00%	1.47%	26.38%	1.47%	1.62%	0.00%
过去三年	-11.64%	1.33%	-15.90%	1.33%	4.26%	0.00%
过去五年	4.86%	1.82%	-1.03%	1.83%	5.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	56.23%	1.70%	49.62%	1.71%	6.61%	-0.01%

### 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累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



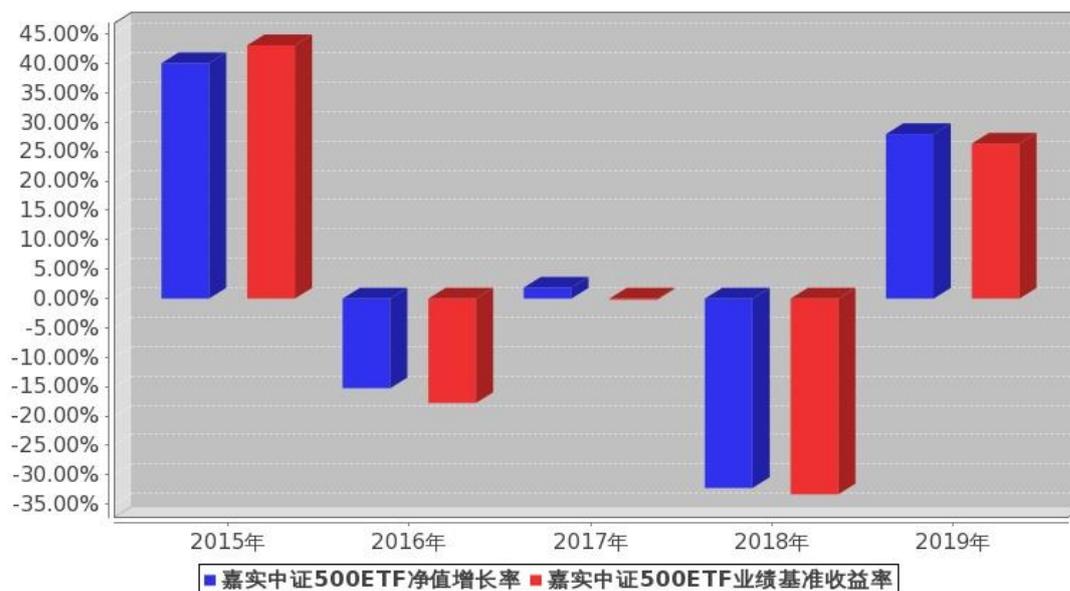
图：嘉实中证 500ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 2 月 6 日至 2019 年 12 月 31 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“第十四部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

截止2019年12月31日，基金管理人共管理176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。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		
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)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接基金经理	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, 现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实沪深 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 联接、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接基金经理	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。

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合规守信情况的说明

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基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.41%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

### 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 5.5721 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.00%，业绩比较基准收益率为 26.38%。

## 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。中证 500 指数于年末收于 5267.66，报告期内中证 500 指数上涨 26.38%。

作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，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，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

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

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

(3) 内部审计：按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

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

(5) 加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第23638号

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 一、 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 三、 管理层和治理层对财务报表的责任

嘉实中证500ETF基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实中证500ETF基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证500ETF基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督嘉实中证500ETF基金的财务报告过程。

### 四、 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致嘉实中证 500ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)  
中国·上海市

注册会计师  
薛 竞  
周 祎

2020 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	29,099,903.38	11,298,602.75
结算备付金		27,395,359.46	4,824,848.31
存出保证金		19,837,434.40	4,323,464.58
交易性金融资产	7.4.7.2	3,320,244,436.57	1,242,175,710.56
其中：股票投资		3,314,041,436.57	1,242,175,710.56
基金投资		-	-
债券投资		6,203,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	109,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		9,880,164.95	50,010.15
应收利息	7.4.7.5	53,995.39	3,280.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,515,511,294.15	1,272,675,916.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25,125,887.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		416,903.26	552,868.79
应付托管费		138,967.75	110,573.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,460,029.90	278,625.59
应交税费		173,335.27	3.30
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	451,023.90	497,313.39
负债合计		27,766,147.48	1,439,384.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,232,425,035.45	1,041,549,865.76
未分配利润	7.4.7.10	1,255,320,111.22	229,686,666.35
所有者权益合计		3,487,745,146.67	1,271,236,532.11
负债和所有者权益总计		3,515,511,294.15	1,272,675,916.94

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.5721 元，基金份额总额 625,931,868.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		487,856,381.90	-439,875,824.97
1. 利息收入		1,500,505.74	903,134.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	363,934.20	192,453.61
债券利息收入		2,255.63	472.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,053,071.04	710,208.59
证券出借利息收入		81,244.87	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,395,520.07	-107,123,916.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-67,488,784.61	-108,942,198.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	998,340.85	195,666.15
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	11,888,581.86	-10,524,560.00
股利收益	7.4.7.15	30,206,341.83	12,147,176.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	507,942,002.97	-333,648,311.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	2,809,393.26	-6,731.57
减: 二、费用		13,859,983.97	8,765,803.81
1. 管理人报酬		6,622,430.16	5,767,327.99
2. 托管费		1,628,242.46	1,153,465.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,562,316.09	1,031,445.44
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		40,867.78	1.18
7. 其他费用	7.4.7.19	1,006,127.48	813,563.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		473,996,397.93	-448,641,628.78
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		473,996,397.93	-448,641,628.78

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,041,549,865.76	229,686,666.35	1,271,236,532.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	473,996,397.93	473,996,397.93
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)	1,190,875,169.69	551,637,046.94	1,742,512,216.63
其中: 1. 基金申购款	3,477,933,278.37	1,655,035,681.00	5,132,968,959.37
2. 基金赎回款	-2,287,058,108.68	-1,103,398,634.06	-3,390,456,742.74
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	2,232,425,035.45	1,255,320,111.22	3,487,745,146.67

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	(基金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	572,903,572.93	458,991,095.22	1,031,894,668.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-448,641,628.78	-448,641,628.78
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)	468,646,292.83	219,337,199.91	687,983,492.74
其中：1. 基金申购款	629,141,598.77	303,005,527.25	932,147,126.02
2. 基金赎回款	-160,495,305.94	-83,668,327.34	-244,163,633.28
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)	1,041,549,865.76	229,686,666.35	1,271,236,532.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,108,591,728.00 元(含募集股票市值),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 047 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基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

3,108,729,402.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 137,674.00 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2013] 83 号文审核同意，本基金 871,631,868.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在深交所挂牌交易。

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基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，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 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。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。

本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 联接基金”)。嘉实中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入

方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于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。

（2）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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	29,099,903.38	11,298,602.75
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	29,099,903.38	11,298,602.75

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,179,514,966.17	3,314,041,436.57	134,526,470.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	6,203,000.00	6,203,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,203,000.00	6,203,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,185,717,966.17	3,320,244,436.57	134,526,470.40
项目	上年度末 2018年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		1,605,459,082.45	1,242,175,710.56	-363,283,371.89
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		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,605,459,082.45	1,242,175,710.56	-363,283,371.89

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	155,562,119.32	-	-	-
其中：股指期货投资	155,562,119.32	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	155,562,119.32	-	-	-

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
IC2003	IC2003	58	60,686,560.00	5,601,600.68
IC2006	IC2006	100	103,288,000.00	2,810,840.00
总额合计	-	-	-	8,412,440.68
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	8,412,440.68
股指期货投资净额	-	-	-	-

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	30,342,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	30,342,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,342,720.00	-	-	-

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
IC1903	IC1903	35	28,623,000.00	-1,719,720.00
总额合计	-	-	-	-1,719,720.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-1,719,720.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	109,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	109,000,000.00	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	7,098.02	2,415.42
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	13,606.89	2,795.54
应收债券利息	772.13	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-8,506.85	-1,945.22
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	40,945.78	-
其他	79.42	14.85
合计	53,995.39	3,280.59

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,460,029.90	278,625.59
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,460,029.90	278,625.59

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
其他	-	-
预提费用	220,000.00	400,000.00
应付指数使用费	231,023.90	97,313.39
合计	451,023.90	497,313.39

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	292,031,868.00	1,041,549,865.76

本期申购	975,150,000.00	3,477,933,278.37
本期赎回（以“-”号填列）	-641,250,000.00	-2,287,058,108.68
本期末	625,931,868.00	2,232,425,035.45

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	721,224,755.07	-491,538,088.72	229,686,666.35
本期利润	-33,945,605.04	507,942,002.97	473,996,397.93
本期基金份额交易产生的变动数	801,255,177.07	-249,618,130.13	551,637,046.94
其中：基金申购款	2,326,147,340.31	-671,111,659.31	1,655,035,681.00
基金赎回款	-1,524,892,163.24	421,493,529.18	-1,103,398,634.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,488,534,327.10	-233,214,215.88	1,255,320,111.22

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	124,781.07	84,320.42
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	238,461.79	107,727.68
其他	691.34	405.51
合计	363,934.20	192,453.61

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,286,856.91	-71,511,200.33
股票投资收益——赎回差价收入	-37,201,927.70	-37,430,998.41
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-67,488,784.61	-108,942,198.74

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	2,134,589,085.52	388,575,044.53
减：卖出股票成本总额	2,164,875,942.43	460,086,244.86
买卖股票差价收入	-30,286,856.91	-71,511,200.33

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
赎回基金份额对价总额	3,390,456,742.74	244,163,633.28
减：现金支付赎回款总额	1,090,001,169.74	10,879,449.28
减：赎回股票成本总额	2,337,657,500.70	270,715,182.41
赎回差价收入	-37,201,927.70	-37,430,998.41

## 7.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	13,578,670.69	3,244,577.42
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	12,578,800.00	3,048,400.00
减：应收利息总额	1,529.84	511.27
买卖债券差价收入	998,340.85	195,666.15

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.14.2 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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2018年1月1日至2018年12月31日
股指期货投资收益	11,888,581.86	-10,524,560.00

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	30,206,341.83	12,147,176.22
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	30,206,341.83	12,147,176.22

## 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	497,809,842.29	-330,563,471.88
股票投资	497,809,842.29	-330,563,471.88
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	10,132,160.68	-3,084,840.00
权证投资	-	-
期货投资	10,132,160.68	-3,084,840.00
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	507,942,002.97	-333,648,311.88

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

基金赎回费收入	-	-
基金转出费收入	-	-
替代损益	2,809,393.26	-6,731.57
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	2,809,393.26	-6,731.57

#### 7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	4,562,316.09	1,031,445.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,562,316.09	1,031,445.44

#### 7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	9,364.33	7,086.98
上市年费	60,000.00	60,000.00
债券托管账户维护费	-	-
指数使用费	716,290.15	346,039.65
红利手续费	-	-
其他	473.00	437.00
合计	1,006,127.48	813,563.63

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
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
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,622,430.16	5,767,327.99
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.5%/0.15%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×该日适用费率/当年天数。

2. 根据《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 0.5%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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,628,242.46	1,153,465.57

注：1. 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%/0.05%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×该日适用费率/当年天数。

2. 根据《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%。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 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

关联方名称	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
嘉实中证 500ETF联接	422,937,780.00	67.57	218,476,780.00	74.81

#### 7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	29,099,903.38	124,781.07	11,298,602.75	84,320.42

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本期（2019年1月1日至2019年12月31日），本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末(2019年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688268	华特气体	2019年12月19日	2020年6月29日	科创板新股锁定	22.16	35.78	5,216	115,586.56	186,628.48	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新发未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新发未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688363	华熙生物	2019年10月28日	2020年5月6日	科创板新股锁定	47.79	72.00	9,800	468,342.00	705,600.00	-
688202	美迪西	2019年10月29日	2020年5月6日	科创板新股锁定	41.50	50.80	2,120	87,980.00	107,696.00	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新发未上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688078	龙软科技	2019年12月20日	2020年6月30日	科创板新股锁定	21.59	41.95	2,811	60,689.49	117,921.45	-
688358	祥生医疗	2019年11月25日	2020年6月3日	科创板新股锁定	50.53	48.96	4,541	229,456.73	222,327.36	-

688399	硕世生物	2019年11月27日	2020年6月5日	科创板新股锁定	46.78	54.51	2,290	107,126.20	124,827.90	-
7.4.12.1.2 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
110065	淮矿转债	2019年12月24日	2020年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	4,500	450,000.00	450,000.00	网上申购
110065	淮矿转债	2019年12月25日	2020年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	1,680	168,000.00	168,000.00	网下申购
128084	木森转债	2019年12月16日	2020年1月10日	新债未上市	100.00	100.00	6,017	601,700.00	601,700.00	网上申购
128084	木森转债	2019年12月18日	2020年1月10日	新债未上市	100.00	100.00	2,360	236,000.00	236,000.00	网下申购
113029	明阳转债	2019年12月17日	2020年1月7日	新债未上市	100.00	100.00	2,570	257,000.00	257,000.00	网上申购
113029	明阳转债	2019年12月18日	2020年1月7日	新债未上市	100.00	100.00	1,890	189,000.00	189,000.00	网下申购
128085	鸿达转债	2019年12月16日	2020年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	10,998	1,099,800.00	1,099,800.00	网上申购
128085	鸿达转债	2019年12月18日	2020年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	3,040	304,000.00	304,000.00	网下申购
110063	鹰19转债	2019年12月16日	2020年1月3日	新债未上市	100.00	100.00	10,140	1,014,000.00	1,014,000.00	-
128086	国轩转债	2019年12月17日	2020年1月10日	新债未上市	100.00	100.00	9,827	982,700.00	982,700.00	网上申购
128086	国轩转债	2019年12月19日	2020年1月10日	新债未上市	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	网下申购
123036	先导转债	2019年12月11日	2020年1月	新债未上市	100.00	100.00	4,648	464,800.00	464,800.00	-

		日	10 日							
110064	建工转债	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 16 日	新债未 上市	100.00	100.00	2,530	253,000.00	253,000.00	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位:人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:张)	期末估值总额
2019121800000085	000426	兴业矿业	2019-12-18	2020-01-01	4.97	10,000	49,700.00
2019121800000086	000536	华映科技	2019-12-18	2020-01-01	2.7	66,000	178,200.00
2019121800000092	000681	视觉中国	2019-12-18	2020-01-01	17.24	16,000	275,840.00
2019121800000096	000727	华东科技	2019-12-18	2020-01-01	2.09	16,000	33,440.00
2019121800000111	000766	通化金马	2019-12-18	2020-01-01	6.54	27,000	176,580.00
2019121800000144	000990	诚志股份	2019-12-18	2020-01-01	14.82	12,000	177,840.00
2019121800000159	002118	紫鑫药业	2019-12-18	2020-01-01	6.24	36,000	224,640.00
20191218000001	002131	利欧股份	2019-12-18	2020-01-01	2.97	220,000	653,400.00

66							
20191218000001 93	002273	水晶光电	2019-12-18	2020-01-01	16.16	24,000	387,840.00
20191218000001 95	002280	联络互动	2019-12-18	2020-01-01	3.87	73,100	282,897.00
20191218000001 96	002273	水晶光电	2019-12-18	2020-01-01	16.16	30,000	484,800.00
20191218000001 98	002285	世联行	2019-12-18	2020-01-01	3.75	56,700	212,625.00
20191218000002 12	002426	胜利精密	2019-12-18	2020-01-01	2.36	82,400	194,464.00
20191218000002 18	002416	爱施德	2019-12-18	2020-01-01	7.61	23,700	180,357.00
20191218000002 19	002426	胜利精密	2019-12-18	2020-01-01	2.36	33,100	78,116.00
20191218000002 34	002505	大康农业	2019-12-18	2020-01-01	1.75	131,500	230,125.00
20191218000002 50	002681	奋达科技	2019-12-18	2020-01-01	5.58	39,000	217,620.00
20191218000002 54	002670	国盛金控	2019-12-18	2020-01-01	12.71	46,300	588,473.00
20191218000002 71	002797	第一创业	2019-12-18	2020-01-01	8.28	100,800	834,624.00
20191218000002 72	300010	立思辰	2019-12-18	2020-01-01	12.91	23,200	299,512.00
20191218000002 76	300010	立思辰	2019-12-18	2020-01-01	12.91	10,000	129,100.00
20191218000002 78	300014	亿纬锂能	2019-12-18	2020-01-01	50.16	21,700	1,088,472.00
20191218000003 05	300072	三聚环保	2019-12-18	2020-01-01	6.32	56,000	353,920.00
20191218000003 12	300088	长信科技	2019-12-18	2020-01-01	10.27	88,700	910,949.00
20191218000003 40	300168	万达信息	2019-12-18	2020-01-01	15.43	42,200	651,146.00
20191218000003 56	300199	翰宇药业	2019-12-18	2020-01-01	5.8	10,000	58,000.00
20191218000003 75	300315	掌趣科技	2019-12-18	2020-01-01	6.17	132,300	816,291.00
20191218000003 86	300418	昆仑万维	2019-12-18	2020-01-01	16.75	33,000	552,750.00
20191218000004 59	603000	人民网	2019-12-18	2020-01-01	19.79	26,500	524,435.00
20191218000004	603000	人民网	2019-12-18	2020-01-01	19.79	26,500	524,435.00

65							
20191218000005 00	601139	深圳燃气	2019-12-18	2020-01-01	7.83	22,700	177,741.00
20191218000005 08	600572	康恩贝	2019-12-18	2020-01-01	6.15	89,500	550,425.00
20191218000005 26	601880	大连港	2019-12-18	2020-01-01	2.03	148,400	301,252.00
20191218000005 31	600707	彩虹股份	2019-12-18	2020-01-01	4.2	34,100	143,220.00
20191218000005 44	600536	中国软件	2019-12-18	2020-01-01	71.69	14,200	1,017,998.00
20191218000005 50	600094	大名城	2019-12-18	2020-01-01	5.85	76,400	446,940.00
20191218000005 56	600909	华安证券	2019-12-18	2020-01-01	7.3	86,800	633,640.00
20191218000005 67	600291	西水股份	2019-12-18	2020-01-01	8.99	11,800	106,082.00
20191218000005 80	601231	环旭电子	2019-12-18	2020-01-01	19.23	31,000	596,130.00
20191218000005 91	601969	海南矿业	2019-12-18	2020-01-01	5.79	10,000	57,900.00
20191218000006 15	600903	贵州燃气	2019-12-18	2020-01-01	14.78	10,900	161,102.00
20191218000006 28	600150	中国船舶	2019-12-18	2020-01-01	21.76	32,800	713,728.00
20191219000001 02	000717	韶钢松山	2019-12-19	2020-01-02	4.74	58,000	274,920.00
20191220000000 28	000156	华数传媒	2019-12-20	2020-01-03	10.44	27,600	288,144.00
20191220000000 33	000066	中国长城	2019-12-20	2020-01-03	15.56	85,300	1,327,268.00
20191220000000 35	000158	常山北明	2019-12-20	2020-01-03	6.82	46,600	317,812.00
20191220000000 40	000301	东方盛虹	2019-12-20	2020-01-03	5.18	20,000	103,600.00
20191220000000 44	000528	柳工	2019-12-20	2020-01-03	6.94	20,000	138,800.00
20191220000000 58	002002	鸿达兴业	2019-12-20	2020-01-03	4.16	20,000	83,200.00
20191220000000 78	002302	西部建设	2019-12-20	2020-01-03	11.29	20,000	225,800.00
20191220000001 51	600996	贵广网络	2019-12-20	2020-01-03	8.05	15,300	123,165.00
20191220000001	601678	滨化股份	2019-12-20	2020-01-03	5.11	50,000	255,500.00

55							
20191220000001 59	600782	新钢股份	2019-12-20	2020-01-03	5.13	20,000	102,600.00
20191220000001 62	600584	长电科技	2019-12-20	2020-01-03	21.98	54,600	1,200,108.00
20191220000001 74	603888	新华网	2019-12-20	2020-01-03	21.1	10,000	211,000.00
20191220000001 82	600155	华创阳安	2019-12-20	2020-01-03	14.03	33,800	474,214.00
20191220000001 87	600970	中材国际	2019-12-20	2020-01-03	6.97	20,000	139,400.00
20191220000002 05	600776	东方通信	2019-12-20	2020-01-03	20.83	23,100	481,173.00
20191220000002 26	601872	招商轮船	2019-12-20	2020-01-03	8.26	100,000	826,000.00
20191220000002 33	600640	号百控股	2019-12-20	2020-01-03	25.81	15,500	400,055.00
20191223000001 15	000536	华映科技	2019-12-23	2020-01-06	2.7	141,400	381,780.00
20191223000001 24	000717	韶钢松山	2019-12-23	2020-01-06	4.74	123,400	584,916.00
20191223000001 36	000980	众泰汽车	2019-12-23	2020-01-06	2.93	177,800	520,954.00
20191223000001 38	000990	诚志股份	2019-12-23	2020-01-06	14.82	25,500	377,910.00
20191223000001 47	002118	紫鑫药业	2019-12-23	2020-01-06	6.24	79,200	494,208.00
20191223000001 62	002174	游族网络	2019-12-23	2020-01-06	23.27	79,900	1,859,273.00
20191223000001 69	002273	水晶光电	2019-12-23	2020-01-06	16.16	115,000	1,858,400.00
20191223000001 70	002131	利欧股份	2019-12-23	2020-01-06	2.97	478,200	1,420,254.00
20191223000001 80	002302	西部建设	2019-12-23	2020-01-06	11.29	55,700	628,853.00
20191223000001 85	002416	爱施德	2019-12-23	2020-01-06	7.61	50,600	385,066.00
20191223000002 12	002797	第一创业	2019-12-23	2020-01-06	8.28	214,300	1,774,404.00
20191223000002 13	300088	长信科技	2019-12-23	2020-01-06	10.27	188,700	1,937,949.00
20191223000002 63	600584	长电科技	2019-12-23	2020-01-06	21.98	100,000	2,198,000.00
20191223000002	603888	新华网	2019-12-23	2020-01-06	21.1	10,000	211,000.00

92							
20191223000003 08	600970	中材国际	2019-12-23	2020-01-06	6.97	20,000	139,400.00
20191223000003 19	601231	环旭电子	2019-12-23	2020-01-06	19.23	66,900	1,286,487.00
20191223000003 26	600707	彩虹股份	2019-12-23	2020-01-06	4.2	73,500	308,700.00
20191223000003 27	600776	东方通信	2019-12-23	2020-01-06	20.83	48,600	1,012,338.00
20191223000003 36	600094	大名城	2019-12-23	2020-01-06	5.85	162,500	950,625.00
20191223000003 64	600903	贵州燃气	2019-12-23	2020-01-06	14.78	23,200	342,896.00
20191223000003 73	600150	中国船舶	2019-12-23	2020-01-06	21.76	70,500	1,534,080.00
20191223000003 78	601872	招商轮船	2019-12-23	2020-01-06	8.26	263,900	2,179,814.00
20191223000003 80	600640	号百控股	2019-12-23	2020-01-06	25.81	32,200	831,082.00
20191224000000 76	000536	华映科技	2019-12-24	2020-01-07	2.7	40,500	109,350.00
20191224000000 82	000158	常山北明	2019-12-24	2020-01-07	6.82	64,000	436,480.00
20191224000000 95	000717	韶钢松山	2019-12-24	2020-01-07	4.74	32,500	154,050.00
20191224000001 11	000980	众泰汽车	2019-12-24	2020-01-07	2.93	45,800	134,194.00
20191224000001 39	002280	联络互动	2019-12-24	2020-01-07	3.87	251,800	974,466.00
20191224000001 52	002174	游族网络	2019-12-24	2020-01-07	23.27	18,000	418,860.00
20191224000001 62	002416	爱施德	2019-12-24	2020-01-07	7.61	13,700	104,257.00
20191224000001 74	002681	奋达科技	2019-12-24	2020-01-07	5.58	105,300	587,574.00
20191224000001 94	300088	长信科技	2019-12-24	2020-01-07	10.27	70,000	718,900.00
20191224000002 32	600917	重庆燃气	2019-12-24	2020-01-07	7.26	39,800	288,948.00
20191224000002 37	603000	人民网	2019-12-24	2020-01-07	19.79	45,600	902,424.00
20191224000002 47	600460	士兰微	2019-12-24	2020-01-07	15.47	72,000	1,113,840.00
20191224000002	600536	中国软件	2019-12-24	2020-01-07	71.69	13,000	931,970.00

58							
20191224000002 60	603025	大豪科技	2019-12-24	2020-01-07	9.47	39,500	374,065.00
20191224000002 78	600707	彩虹股份	2019-12-24	2020-01-07	4.2	24,400	102,480.00
20191224000002 82	600094	大名城	2019-12-24	2020-01-07	5.85	101,100	591,435.00
20191224000002 85	601860	紫金银行	2019-12-24	2020-01-07	5.62	67,000	376,540.00
20191224000003 02	601231	环旭电子	2019-12-24	2020-01-07	19.23	13,100	251,913.00
20191224000003 07	600776	东方通信	2019-12-24	2020-01-07	20.83	14,100	293,703.00
20191224000003 30	600640	号百控股	2019-12-24	2020-01-07	25.81	10,000	258,100.00
20191225000000 88	000156	华数传媒	2019-12-25	2020-01-08	10.44	74,400	776,736.00
20191225000001 01	002176	江特电机	2019-12-25	2020-01-08	3.76	150,000	564,000.00
20191225000001 07	002118	紫鑫药业	2019-12-25	2020-01-08	6.24	21,400	133,536.00
20191225000001 35	002505	大康农业	2019-12-25	2020-01-08	1.75	167,000	292,250.00
20191225000001 51	300199	翰宇药业	2019-12-25	2020-01-08	5.8	85,400	495,320.00
20191225000001 78	601127	小康股份	2019-12-25	2020-01-08	11.4	47,700	543,780.00
20191225000001 94	600536	中国软件	2019-12-25	2020-01-08	71.69	34,400	2,466,136.00
20191225000001 98	601865	福莱特	2019-12-25	2020-01-08	12.13	31,200	378,456.00
20191226000000 58	000009	中国宝安	2019-12-26	2020-01-09	6.19	420,000	2,599,800.00
20191226000000 66	000066	中国长城	2019-12-26	2020-01-09	15.56	44,200	687,752.00
20191226000000 69	000021	深科技	2019-12-26	2020-01-09	12.18	128,000	1,559,040.00
20191226000000 70	000681	视觉中国	2019-12-26	2020-01-09	17.24	42,700	736,148.00
20191226000000 76	002030	达安基因	2019-12-26	2020-01-09	11.5	37,300	428,950.00
20191226000000 92	002176	江特电机	2019-12-26	2020-01-09	3.76	73,300	275,608.00
20191226000000	002183	怡亚通	2019-12-26	2020-01-09	4.21	114,100	480,361.00

94							
20191226000000 95	002285	世联行	2019-12-26	2020-01-09	3.75	113,400	425,250.00
20191226000001 09	002437	誉衡药业	2019-12-26	2020-01-09	3.03	208,800	632,664.00
20191226000001 14	002426	胜利精密	2019-12-26	2020-01-09	2.36	288,100	679,916.00
20191226000001 17	002589	瑞康医药	2019-12-26	2020-01-09	7.69	57,800	444,482.00
20191226000001 26	002640	跨境通	2019-12-26	2020-01-09	7.72	61,000	470,920.00
20191226000001 27	002701	奥瑞金	2019-12-26	2020-01-09	4.41	99,800	440,118.00
20191226000001 28	002797	第一创业	2019-12-26	2020-01-09	8.28	20,300	168,084.00
20191226000001 50	300308	中际旭创	2019-12-26	2020-01-09	52.15	13,700	714,455.00
20191226000001 54	300316	晶盛机电	2019-12-26	2020-01-09	15.72	118,400	1,861,248.00
20191226000001 81	601139	深圳燃气	2019-12-26	2020-01-09	7.83	87,400	684,342.00
20191226000001 88	600460	士兰微	2019-12-26	2020-01-09	15.47	22,000	340,340.00
20191226000001 97	600158	中体产业	2019-12-26	2020-01-09	10.03	47,100	472,413.00
20191226000002 16	600909	华安证券	2019-12-26	2020-01-09	7.3	40,000	292,000.00
20191226000002 18	600410	华胜天成	2019-12-26	2020-01-09	10.31	67,700	697,987.00
20191226000002 19	600053	九鼎投资	2019-12-26	2020-01-09	25.43	22,300	567,089.00
20191226000002 35	600478	科力远	2019-12-26	2020-01-09	4.4	159,800	703,120.00
20191226000002 39	600515	海航基础	2019-12-26	2020-01-09	4.46	151,800	677,028.00
20191226000002 41	600006	东风汽车	2019-12-26	2020-01-09	4.58	109,200	500,136.00
20191227000001 83	002131	利欧股份	2019-12-27	2020-01-10	2.97	136,200	404,514.00
20191227000002 52	002503	搜于特	2019-12-27	2020-01-10	2.39	289,800	692,622.00
20191227000002 69	002665	首航节能	2019-12-27	2020-01-10	3.36	115,000	386,400.00
20191227000003	300168	万达信息	2019-12-27	2020-01-10	15.43	60,000	925,800.00

01							
20191227000003 72	600567	山鹰纸业	2019-12-27	2020-01-10	3.77	110,000	414,700.00
20191227000004 49	600869	智慧能源	2019-12-27	2020-01-10	4.9	84,000	411,600.00
20191227000004 89	600158	中体产业	2019-12-27	2020-01-10	10.03	42,000	421,260.00
20191227000005 32	600515	海航基础	2019-12-27	2020-01-10	4.46	59,100	263,586.00
20191230000000 67	000009	中国宝安	2019-12-30	2020-01-13	6.19	25,900	160,321.00
20191230000000 90	002273	水晶光电	2019-12-30	2020-01-13	16.16	11,800	190,688.00
20191230000001 50	601099	太平洋	2019-12-30	2020-01-13	3.79	30,000	113,700.00
20191224000000 75	000012	南玻 A	2019-12-24	2020-01-21	5.01	47,700	238,977.00
20191224000000 79	000158	常山北明	2019-12-24	2020-01-21	6.82	34,000	231,880.00
20191224000000 81	000156	华数传媒	2019-12-24	2020-01-21	10.44	18,000	187,920.00
20191224000000 85	000536	华映科技	2019-12-24	2020-01-21	2.7	47,000	126,900.00
20191224000000 86	000089	深圳机场	2019-12-24	2020-01-21	9.77	35,200	343,904.00
20191224000000 88	000547	航天发展	2019-12-24	2020-01-21	10.22	40,300	411,866.00
20191224000000 93	000813	德展健康	2019-12-24	2020-01-21	6.29	31,600	198,764.00
20191224000000 94	000826	启迪环境	2019-12-24	2020-01-21	9.18	25,000	229,500.00
20191224000000 96	000766	通化金马	2019-12-24	2020-01-21	6.54	20,000	130,800.00
20191224000000 97	000825	太钢不锈	2019-12-24	2020-01-21	4.09	81,600	333,744.00
20191224000000 98	000932	华菱钢铁	2019-12-24	2020-01-21	4.78	61,100	292,058.00
20191224000001 04	000717	韶钢松山	2019-12-24	2020-01-21	4.74	44,100	209,034.00
20191224000001 06	000959	首钢股份	2019-12-24	2020-01-21	3.53	57,200	201,916.00
20191224000001 09	000980	众泰汽车	2019-12-24	2020-01-21	2.93	35,800	104,894.00
20191224000001	000987	越秀金控	2019-12-24	2020-01-21	9.67	19,700	190,499.00

10							
20191224000001 13	000990	诚志股份	2019-12-24	2020-01-21	14.82	10,000	148,200.00
20191224000001 14	002004	华邦健康	2019-12-24	2020-01-21	4.94	55,200	272,688.00
20191224000001 19	002065	东华软件	2019-12-24	2020-01-21	10.32	47,100	486,072.00
20191224000001 20	002074	国轩高科	2019-12-24	2020-01-21	14.55	26,400	384,120.00
20191224000001 22	002118	紫鑫药业	2019-12-24	2020-01-21	6.24	23,400	146,016.00
20191224000001 33	002212	南洋股份	2019-12-24	2020-01-21	19.01	18,500	351,685.00
20191224000001 38	002268	卫士通	2019-12-24	2020-01-21	25.79	18,400	474,536.00
20191224000001 40	002281	光迅科技	2019-12-24	2020-01-21	29.78	14,700	437,766.00
20191224000001 41	002273	水晶光电	2019-12-24	2020-01-21	16.16	29,200	471,872.00
20191224000001 42	002285	世联行	2019-12-24	2020-01-21	3.75	40,900	153,375.00
20191224000001 50	002174	游族网络	2019-12-24	2020-01-21	23.27	15,800	367,666.00
20191224000001 51	002155	湖南黄金	2019-12-24	2020-01-21	7.89	29,200	230,388.00
20191224000001 54	002407	多氟多	2019-12-24	2020-01-21	13.11	24,000	314,640.00
20191224000001 61	002419	天虹股份	2019-12-24	2020-01-21	10.55	16,900	178,295.00
20191224000001 65	002416	爱施德	2019-12-24	2020-01-21	7.61	17,600	133,936.00
20191224000001 70	002500	山西证券	2019-12-24	2020-01-21	8.29	57,600	477,504.00
20191224000001 71	002572	索菲亚	2019-12-24	2020-01-21	20.95	19,500	408,525.00
20191224000001 72	002589	瑞康医药	2019-12-24	2020-01-21	7.69	41,800	321,442.00
20191224000001 73	002681	奋达科技	2019-12-24	2020-01-21	5.58	28,900	161,262.00
20191224000001 76	002491	通鼎互联	2019-12-24	2020-01-21	6.61	26,900	177,809.00
20191224000001 79	002797	第一创业	2019-12-24	2020-01-21	8.28	60,600	501,768.00
20191224000001	300009	安科生物	2019-12-24	2020-01-21	15.09	22,300	336,507.00

83							
20191224000001 85	300010	立思辰	2019-12-24	2020-01-21	12.91	26,100	336,951.00
20191224000001 90	300088	长信科技	2019-12-24	2020-01-21	10.27	46,900	481,663.00
20191224000001 99	300113	顺网科技	2019-12-24	2020-01-21	25.69	13,200	339,108.00
20191224000002 00	300115	长盈精密	2019-12-24	2020-01-21	17.79	19,000	338,010.00
20191224000002 02	300168	万达信息	2019-12-24	2020-01-21	15.43	30,600	472,158.00
20191224000002 16	601975	招商南油	2019-12-24	2020-01-21	2.81	71,400	200,634.00
20191224000002 21	600707	彩虹股份	2019-12-24	2020-01-21	4.2	21,100	88,620.00
20191224000002 23	600572	康恩贝	2019-12-24	2020-01-21	6.15	64,900	399,135.00
20191224000002 29	600754	锦江酒店	2019-12-24	2020-01-21	28.71	10,600	304,326.00
20191224000002 30	601872	招商轮船	2019-12-24	2020-01-21	8.26	66,600	550,116.00
20191224000002 31	600909	华安证券	2019-12-24	2020-01-21	7.3	56,300	410,990.00
20191224000002 33	600580	卧龙电驱	2019-12-24	2020-01-21	12.02	25,600	307,712.00
20191224000002 34	600699	均胜电子	2019-12-24	2020-01-21	17.9	25,700	460,030.00
20191224000002 35	600497	驰宏锌锗	2019-12-24	2020-01-21	4.38	92,500	405,150.00
20191224000002 36	600545	卓郎智能	2019-12-24	2020-01-21	6.07	33,500	203,345.00
20191224000002 40	601100	恒立液压	2019-12-24	2020-01-21	49.75	10,000	497,500.00
20191224000002 44	601615	明阳智能	2019-12-24	2020-01-21	12.3	10,000	123,000.00
20191224000002 45	601860	紫金银行	2019-12-24	2020-01-21	5.62	12,800	71,936.00
20191224000002 49	601231	环旭电子	2019-12-24	2020-01-21	19.23	20,700	398,061.00
20191224000002 56	600776	东方通信	2019-12-24	2020-01-21	20.83	16,000	333,280.00
20191224000002 61	600823	世茂股份	2019-12-24	2020-01-21	4.5	52,700	237,150.00
20191224000002	600155	华创阳安	2019-12-24	2020-01-21	14.03	23,700	332,511.00

62							
20191224000002 63	600808	马钢股份	2019-12-24	2020-01-21	3.07	106,500	326,955.00
20191224000002 64	601689	拓普集团	2019-12-24	2020-01-21	17.43	14,200	247,506.00
20191224000002 67	600515	海航基础	2019-12-24	2020-01-21	4.46	48,700	217,202.00
20191224000002 69	600770	综艺股份	2019-12-24	2020-01-21	5.39	27,900	150,381.00
20191224000002 71	600409	三友化工	2019-12-24	2020-01-21	6.32	45,000	284,400.00
20191224000002 73	600006	东风汽车	2019-12-24	2020-01-21	4.58	28,200	129,156.00
20191224000002 75	600996	贵广网络	2019-12-24	2020-01-21	8.05	11,100	89,355.00
20191224000002 77	601333	广深铁路	2019-12-24	2020-01-21	3.06	121,100	370,566.00
20191224000002 79	600460	士兰微	2019-12-24	2020-01-21	15.47	28,400	439,348.00
20191224000002 88	600325	华发股份	2019-12-24	2020-01-21	7.83	61,400	480,762.00
20191224000002 91	600801	华新水泥	2019-12-24	2020-01-21	26.43	21,900	578,817.00
20191224000002 92	600339	中油工程	2019-12-24	2020-01-21	3.39	59,300	201,027.00
20191224000002 93	600150	中国船舶	2019-12-24	2020-01-21	21.76	22,900	498,304.00
20191224000002 99	600216	浙江医药	2019-12-24	2020-01-21	13.35	25,800	344,430.00
20191224000003 00	603000	人民网	2019-12-24	2020-01-21	19.79	19,400	383,926.00
20191224000003 01	600885	宏发股份	2019-12-24	2020-01-21	34.45	14,900	513,305.00
20191224000003 03	600640	号百控股	2019-12-24	2020-01-21	25.81	10,000	258,100.00
20191224000003 04	601127	小康股份	2019-12-24	2020-01-21	11.4	10,900	124,260.00
20191224000003 11	600648	外高桥	2019-12-24	2020-01-21	17.37	13,200	229,284.00
20191224000003 13	600435	北方导航	2019-12-24	2020-01-21	8.32	36,600	304,512.00
20191224000003 15	601003	柳钢股份	2019-12-24	2020-01-21	5.65	19,000	107,350.00
20191224000003	600277	亿利洁能	2019-12-24	2020-01-21	4.56	44,900	204,744.00

17							
20191224000003 18	600392	盛和资源	2019-12-24	2020-01-21	9.07	36,900	334,683.00
20191224000003 19	603517	绝味食品	2019-12-24	2020-01-21	46.45	11,000	510,950.00
20191224000003 20	600507	方大特钢	2019-12-24	2020-01-21	10.06	26,200	263,572.00
20191224000003 21	600903	贵州燃气	2019-12-24	2020-01-21	14.78	10,000	147,800.00
20191224000003 24	600859	王府井	2019-12-24	2020-01-21	13.99	14,000	195,860.00
合计	-	-	-	-	-	13,410,300	108,762,771.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。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。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	618,000.00	-
AAA 以下	5,585,000.00	-
未评级	-	-
合计	6,203,000.00	-

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，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。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,099,903.38	-	-	-	29,099,903.38
结算备付金	27,395,359.46	-	-	-	27,395,359.46
存出保证金	160,487.20	-	-	19,676,947.20	19,837,434.40
交易性金融资产	-	-	6,203,000.00	3,314,041,436.57	3,320,244,436.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	109,000,000.00	-	-	-	109,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	9,880,164.95	9,880,164.95
应收利息	-	-	-	53,995.39	53,995.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	165,655,750.04	-	6,203,000.00	3,343,652,544.11	3,515,511,294.15
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	-	-	-	25,125,887.40	25,125,887.40
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	416,903.26	416,903.26
应付托管费	-	-	-	138,967.75	138,967.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,460,029.90	1,460,029.90
应付税费	-	-	-	173,335.27	173,335.27
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	451,023.90	451,023.90
负债总计	-	-	-	27,766,147.48	27,766,147.48
利率敏感度缺口	165,655,750.04	-	6,203,000.00	3,315,886,396.63	3,487,745,146.67
上年度末 2018年12月31日					
资产					
银行存款	11,298,602.75	-	-	-	11,298,602.75

结算备付金	4,824,848.31	-	-	-	4,824,848.31
存出保证金	30,014.58	-	-	4,293,450.00	4,323,464.58
交易性金融资产	-	-	-	-1,242,175,710.56	1,242,175,710.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	50,010.15	50,010.15
应收利息	-	-	-	3,280.59	3,280.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,153,465.64	-	-	-1,246,522,451.30	1,272,675,916.94
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	552,868.79	552,868.79
应付托管费	-	-	-	110,573.76	110,573.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	278,625.59	278,625.59
应付税费	-	-	-	3.30	3.30
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	497,313.39	497,313.39
负债总计	-	-	-	1,439,384.83	1,439,384.83
利率敏感度缺口	26,153,465.64	-	-	-1,245,083,066.47	1,271,236,532.11

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 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 0.18%(2018 年 12 月 31 日,本基金未持有交易性债券投资),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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数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。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	3,314,041,436.57	95.02	1,242,175,710.56	97.71
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	3,314,041,436.57	95.02	1,242,175,710.56	97.71

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2018年12月31日）	
分	业绩比较基准上升 5%	174,247,463.96	63,658,288.83

析	业绩比较基准下降 5%	-174, 247, 463. 96	-63, 658, 288. 83
---	-------------	--------------------	-------------------

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,312,291,533.33 元，属于第二层次的余额为 7,952,903.24 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 1,234,712,339.20 元，第二层次 7,463,371.36 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,314,041,436.57	94.27
	其中：股票	3,314,041,436.57	94.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,203,000.00	0.18
	其中：债券	6,203,000.00	0.18
	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	109,000,000.00	3.10
	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	56,495,262.84	1.61
8	其他各项资产	29,771,594.74	0.85
9	合计	3,515,511,294.15	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 108,762,771.00 元，占基金资产净值的比例为 3.12%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	22,165,228.00	0.64
B	采矿业	86,558,208.09	2.48
C	制造业	1,889,961,418.64	54.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,824,520.80	2.63
E	建筑业	43,261,074.67	1.24
F	批发和零售业	156,150,851.58	4.48
G	交通运输、仓储和邮政业	115,291,034.16	3.31
H	住宿和餐饮业	14,981,601.60	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	336,034,947.68	9.63
J	金融业	193,861,281.86	5.56
K	房地产业	131,362,695.01	3.77
L	租赁和商务服务业	46,924,379.90	1.35
M	科学研究和技术服务业	19,566,651.80	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	23,418,559.10	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,298,121.20	0.09

Q	卫生和社会工作	28,777,854.21	0.83
R	文化、体育和娱乐业	64,494,611.48	1.85
S	综合	44,312,785.72	1.27
	合计	3,312,245,825.50	94.97

### 8.2.2 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	-	-
C	制造业	1,557,345.48	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	117,921.45	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	107,696.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,789,540.97	0.05

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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	600745	闻泰科技	260,600	24,105,500.00	0.69
2	000066	中国长城	1,356,905	21,113,441.80	0.61
3	002463	沪电股份	932,755	20,716,488.55	0.59
4	002384	东山精密	870,075	20,142,236.25	0.58
5	601099	太平洋	5,267,300	19,963,067.00	0.57
6	601128	常熟银行	2,117,793	19,293,094.23	0.55
7	600584	长电科技	868,104	19,080,925.92	0.55
8	300014	亿纬锂能	374,800	18,799,968.00	0.54
9	600426	华鲁恒升	879,332	17,472,326.84	0.50
10	300383	光环新网	833,400	16,726,338.00	0.48
11	002049	紫光国微	326,941	16,621,680.44	0.48

12	002371	北方华创	188,067	16,549,896.00	0.47
13	600536	中国软件	229,918	16,482,821.42	0.47
14	002439	启明星辰	485,800	16,420,040.00	0.47
15	300207	欣旺达	836,300	16,324,576.00	0.47
16	600201	生物股份	869,861	16,283,797.92	0.47
17	002812	恩捷股份	310,290	15,669,645.00	0.45
18	002340	格林美	3,205,746	15,611,983.02	0.45
19	601872	招商轮船	1,871,806	15,461,117.56	0.44
20	002465	海格通信	1,425,600	15,439,248.00	0.44
21	300012	华测检测	1,025,200	15,285,732.00	0.44
22	300253	卫宁健康	1,015,263	15,208,639.74	0.44
23	600763	通策医疗	148,143	15,189,101.79	0.44
24	002129	中环股份	1,285,078	15,176,771.18	0.44
25	002065	东华软件	1,444,500	14,907,240.00	0.43
26	300088	长信科技	1,429,600	14,681,992.00	0.42
27	002127	南极电商	1,327,750	14,485,752.50	0.42
28	600739	辽宁成大	943,800	14,374,074.00	0.41
29	002273	水晶光电	871,765	14,087,722.40	0.40
30	002821	凯莱英	107,716	13,949,222.00	0.40
31	600801	华新水泥	525,398	13,886,269.14	0.40
32	002353	杰瑞股份	370,600	13,697,376.00	0.39
33	002180	纳思达	410,600	13,516,952.00	0.39
34	002797	第一创业	1,623,000	13,438,440.00	0.39
35	300315	掌趣科技	2,130,362	13,144,333.54	0.38
36	000050	深天马 A	791,300	12,890,277.00	0.37
37	601233	桐昆股份	854,300	12,805,957.00	0.37
38	000988	华工科技	622,324	12,626,953.96	0.36
39	000401	冀东水泥	730,100	12,419,001.00	0.36
40	000750	国海证券	2,279,451	12,172,268.34	0.35
41	000009	中国宝安	1,951,663	12,080,793.97	0.35
42	600673	东阳光	1,164,894	11,928,514.56	0.34
43	300285	国瓷材料	521,200	11,909,420.00	0.34
44	600885	宏发股份	345,640	11,907,298.00	0.34
45	000623	吉林敖东	717,751	11,864,424.03	0.34
46	002078	太阳纸业	1,201,407	11,821,844.88	0.34
47	600298	安琪酵母	382,343	11,726,459.81	0.34
48	002268	卫士通	452,295	11,664,688.05	0.33
49	600150	中国船舶	532,400	11,585,024.00	0.33
50	300529	健帆生物	161,200	11,580,608.00	0.33
51	002195	二三四五	3,567,008	11,521,435.84	0.33
52	002507	涪陵榨菜	426,400	11,397,672.00	0.33
53	600161	天坛生物	403,791	11,281,920.54	0.32

54	002926	华西证券	1,015,000	11,175,150.00	0.32
55	600642	申能股份	1,894,000	11,004,140.00	0.32
56	603517	绝味食品	235,700	10,948,265.00	0.31
57	002500	山西证券	1,311,603	10,873,188.87	0.31
58	600699	均胜电子	603,940	10,810,526.00	0.31
59	002131	利欧股份	3,596,879	10,682,730.63	0.31
60	300168	万达信息	679,500	10,484,685.00	0.30
61	000975	银泰黄金	766,731	10,435,208.91	0.30
62	600256	广汇能源	3,150,200	10,427,162.00	0.30
63	300296	利亚德	1,353,000	10,377,510.00	0.30
64	002572	索菲亚	494,200	10,353,490.00	0.30
65	002373	千方科技	573,468	10,345,362.72	0.30
66	000998	隆平高科	701,400	10,317,594.00	0.30
67	600704	物产中大	1,953,200	10,254,300.00	0.29
68	600325	华发股份	1,306,977	10,233,629.91	0.29
69	601100	恒立液压	205,226	10,209,993.50	0.29
70	600909	华安证券	1,397,800	10,203,940.00	0.29
71	601799	星宇股份	107,200	10,181,856.00	0.29
72	600143	金发科技	1,393,200	10,142,496.00	0.29
73	002387	维信诺	634,586	10,089,917.40	0.29
74	000686	东北证券	1,084,600	10,086,780.00	0.29
75	600879	航天电子	1,681,684	10,056,470.32	0.29
76	600079	人福医药	733,400	9,908,234.00	0.28
77	600528	中铁工业	856,710	9,852,165.00	0.28
78	600486	扬农化工	143,322	9,836,188.86	0.28
79	002250	联化科技	570,260	9,768,553.80	0.28
80	603444	吉比特	32,722	9,767,189.78	0.28
81	601168	西部矿业	1,469,642	9,729,030.04	0.28
82	600728	佳都科技	1,033,300	9,692,354.00	0.28
83	601231	环旭电子	504,000	9,691,920.00	0.28
84	002013	中航机电	1,395,400	9,684,076.00	0.28
85	600132	重庆啤酒	185,700	9,648,972.00	0.28
86	000513	丽珠集团	284,691	9,594,086.70	0.28
87	600446	金证股份	465,800	9,586,164.00	0.27
88	002174	游族网络	411,663	9,579,398.01	0.27
89	000999	华润三九	301,800	9,561,024.00	0.27
90	002385	大北农	1,916,000	9,541,680.00	0.27
91	002670	国盛金控	748,501	9,513,447.71	0.27
92	002223	鱼跃医疗	466,029	9,469,709.28	0.27
93	600460	士兰微	608,303	9,410,447.41	0.27
94	600567	山鹰纸业	2,480,400	9,351,108.00	0.27
95	002281	光迅科技	312,923	9,318,846.94	0.27

96	002019	亿帆医药	569,900	9,260,875.00	0.27
97	600895	张江高科	598,600	9,164,566.00	0.26
98	603858	步长制药	439,600	9,064,552.00	0.26
99	002092	中泰化学	1,326,772	9,008,781.88	0.26
100	000778	新兴铸管	2,157,800	8,998,026.00	0.26
101	000878	云南铜业	656,700	8,970,522.00	0.26
102	002074	国轩高科	615,649	8,957,692.95	0.26
103	000997	新大陆	563,980	8,956,002.40	0.26
104	002152	广电运通	930,600	8,943,066.00	0.26
105	300418	昆仑万维	532,395	8,917,616.25	0.26
106	000547	航天发展	869,600	8,887,312.00	0.25
107	002110	三钢闽光	946,752	8,861,598.72	0.25
108	600572	康恩贝	1,440,649	8,859,991.35	0.25
109	600521	华海药业	510,400	8,809,504.00	0.25
110	600820	隧道股份	1,455,420	8,790,736.80	0.25
111	603659	璞泰来	103,000	8,770,450.00	0.25
112	600410	华胜天成	846,738	8,729,868.78	0.25
113	600273	嘉化能源	774,100	8,708,625.00	0.25
114	300058	蓝色光标	1,540,700	8,704,955.00	0.25
115	600497	驰宏锌锗	1,964,300	8,603,634.00	0.25
116	000581	威孚高科	451,391	8,598,998.55	0.25
117	300308	中际旭创	164,754	8,591,921.10	0.25
118	603939	益丰药房	117,200	8,581,384.00	0.25
119	600466	蓝光发展	1,163,320	8,573,668.40	0.25
120	600845	宝信软件	260,180	8,559,922.00	0.25
121	601966	玲珑轮胎	371,400	8,516,202.00	0.24
122	600549	厦门钨业	651,980	8,501,819.20	0.24
123	002075	沙钢股份	1,363,300	8,493,359.00	0.24
124	300166	东方国信	653,276	8,492,588.00	0.24
125	002212	南洋股份	446,613	8,490,113.13	0.24
126	603000	人民网	426,600	8,442,414.00	0.24
127	600260	凯乐科技	619,437	8,405,760.09	0.24
128	601005	重庆钢铁	4,532,100	8,384,385.00	0.24
129	000830	鲁西化工	792,283	8,326,894.33	0.24
130	000060	中金岭南	1,931,750	8,306,525.00	0.24
131	300274	阳光电源	788,120	8,298,903.60	0.24
132	600839	四川长虹	2,850,200	8,294,082.00	0.24
133	300113	顺网科技	320,776	8,240,735.44	0.24
134	000636	风华高科	552,961	8,233,589.29	0.24
135	002690	美亚光电	210,048	8,212,876.80	0.24
136	600884	杉杉股份	607,344	8,205,217.44	0.24
137	600021	上海电力	1,012,000	8,146,600.00	0.23

138	600415	小商品城	2,103,200	8,139,384.00	0.23
139	000039	中集集团	823,040	8,082,252.80	0.23
140	000960	锡业股份	774,000	8,080,560.00	0.23
141	300251	光线传媒	679,700	8,020,460.00	0.23
142	601333	广深铁路	2,620,900	8,019,954.00	0.23
143	002217	合力泰	1,445,000	8,019,750.00	0.23
144	600315	上海家化	258,977	8,012,748.38	0.23
145	600881	亚泰集团	2,510,359	8,008,045.21	0.23
146	300001	特锐德	463,800	7,968,084.00	0.23
147	600376	首开股份	996,169	7,939,466.93	0.23
148	601866	中远海发	3,064,100	7,936,019.00	0.23
149	600258	首旅酒店	381,860	7,870,134.60	0.23
150	002807	江阴银行	1,679,000	7,824,140.00	0.22
151	600875	东方电气	849,100	7,803,229.00	0.22
152	600779	水井坊	150,700	7,798,725.00	0.22
153	300316	晶盛机电	495,480	7,788,945.60	0.22
154	600380	健康元	748,423	7,746,178.05	0.22
155	002191	劲嘉股份	678,815	7,745,279.15	0.22
156	000089	深圳机场	792,281	7,740,585.37	0.22
157	600160	巨化股份	1,060,527	7,720,636.56	0.22
158	600811	东方集团	2,295,232	7,711,979.52	0.22
159	600776	东方通信	369,900	7,705,017.00	0.22
160	603338	浙江鼎力	107,600	7,693,400.00	0.22
161	600959	江苏有线	1,932,970	7,693,220.60	0.22
162	600718	东软集团	670,800	7,613,580.00	0.22
163	000690	宝新能源	1,344,561	7,596,769.65	0.22
164	600155	华创阳安	536,700	7,529,901.00	0.22
165	000402	金融街	923,800	7,501,256.00	0.22
166	300115	长盈精密	421,320	7,495,282.80	0.21
167	000983	西山煤电	1,216,900	7,459,597.00	0.21
168	600166	福田汽车	3,556,600	7,433,294.00	0.21
169	002368	太极股份	190,253	7,404,646.76	0.21
170	600392	盛和资源	813,320	7,376,812.40	0.21
171	300009	安科生物	487,700	7,359,393.00	0.21
172	600755	厦门国贸	1,001,811	7,353,292.74	0.21
173	600022	山东钢铁	5,066,320	7,244,837.60	0.21
174	603882	金城医学	141,200	7,232,264.00	0.21
175	600580	卧龙电驱	600,719	7,220,642.38	0.21
176	600643	爱建集团	751,559	7,214,966.40	0.21
177	600094	大名城	1,230,600	7,199,010.00	0.21
178	000825	太钢不锈	1,759,800	7,197,582.00	0.21
179	002589	瑞康医药	930,050	7,152,084.50	0.21

180	600373	中文传媒	523,600	7,126,196.00	0.20
181	600754	锦江酒店	247,700	7,111,467.00	0.20
182	002085	万丰奥威	1,014,700	7,102,900.00	0.20
183	000729	燕京啤酒	1,088,300	7,095,716.00	0.20
184	600282	南钢股份	2,054,300	7,087,335.00	0.20
185	000970	中科三环	658,500	7,078,875.00	0.20
186	600266	城建发展	872,840	7,070,004.00	0.20
187	600808	马钢股份	2,301,100	7,064,377.00	0.20
188	300027	华谊兄弟	1,510,580	6,993,985.40	0.20
189	600737	中粮糖业	824,486	6,975,151.56	0.20
190	600167	联美控股	529,550	6,968,878.00	0.20
191	002233	塔牌集团	552,351	6,959,622.60	0.20
192	600216	浙江医药	521,300	6,959,355.00	0.20
193	600967	内蒙一机	651,936	6,930,079.68	0.20
194	002221	东华能源	892,972	6,929,462.72	0.20
195	300010	立思辰	536,600	6,927,506.00	0.20
196	002407	多氟多	528,400	6,927,324.00	0.20
197	000021	深科技	567,656	6,914,050.08	0.20
198	603707	健友股份	165,700	6,873,236.00	0.20
199	600171	上海贝岭	434,375	6,841,406.25	0.20
200	603885	吉祥航空	454,000	6,810,000.00	0.20
201	000563	陕国投 A	1,532,579	6,789,324.97	0.19
202	600037	歌华有线	752,326	6,778,457.26	0.19
203	600804	鹏博士	1,104,200	6,757,704.00	0.19
204	600026	中远海能	1,056,986	6,743,570.68	0.19
205	601699	潞安环能	924,500	6,711,870.00	0.19
206	600435	北方导航	805,310	6,700,179.20	0.19
207	601098	中南传媒	554,600	6,621,924.00	0.19
208	600777	新潮能源	3,153,200	6,621,720.00	0.19
209	600060	海信视像	606,667	6,582,336.95	0.19
210	000031	大悦城	910,263	6,535,688.34	0.19
211	600064	南京高科	668,424	6,517,134.00	0.19
212	601118	海南橡胶	1,322,600	6,507,192.00	0.19
213	002028	思源电气	471,085	6,486,840.45	0.19
214	603866	桃李面包	152,313	6,464,163.72	0.19
215	002372	伟星新材	487,020	6,414,053.40	0.18
216	002317	众生药业	503,880	6,399,276.00	0.18
217	000598	兴蓉环境	1,381,700	6,397,271.00	0.18
218	600511	国药股份	233,809	6,380,647.61	0.18
219	603816	顾家家居	139,193	6,365,295.89	0.18
220	300244	迪安诊断	287,234	6,356,488.42	0.18
221	600640	号百控股	245,900	6,346,679.00	0.18

222	002936	郑州银行	1,360,400	6,325,860.00	0.18
223	600782	新钢股份	1,231,100	6,315,543.00	0.18
224	000883	湖北能源	1,507,400	6,285,858.00	0.18
225	002038	双鹭药业	477,300	6,276,495.00	0.18
226	000932	华菱钢铁	1,305,220	6,238,951.60	0.18
227	002064	华峰氨纶	997,570	6,234,812.50	0.18
228	000807	云铝股份	1,208,200	6,210,148.00	0.18
229	600863	内蒙华电	2,240,700	6,161,925.00	0.18
230	601106	中国一重	2,116,300	6,158,433.00	0.18
231	603228	景旺电子	139,500	6,112,890.00	0.18
232	002414	高德红外	288,967	6,068,307.00	0.17
233	603077	和邦生物	4,094,348	6,059,635.04	0.17
234	002004	华邦健康	1,223,248	6,042,845.12	0.17
235	600409	三友化工	955,056	6,035,953.92	0.17
236	300133	华策影视	813,600	6,020,640.00	0.17
237	600597	光明乳业	473,323	6,006,468.87	0.17
238	601958	金钼股份	748,800	5,997,888.00	0.17
239	002048	宁波华翔	387,203	5,986,158.38	0.17
240	002242	九阳股份	237,617	5,978,443.72	0.17
241	002440	闰土股份	533,315	5,973,128.00	0.17
242	002583	海能达	709,700	5,968,577.00	0.17
243	601000	唐山港	2,288,666	5,950,531.60	0.17
244	603806	福斯特	121,342	5,897,221.20	0.17
245	300180	华峰超纤	658,200	5,818,488.00	0.17
246	600008	首创股份	1,756,500	5,778,885.00	0.17
247	000738	航发控制	441,700	5,773,019.00	0.17
248	000877	天山股份	486,974	5,770,641.90	0.17
249	601179	中国西电	1,581,900	5,758,116.00	0.17
250	300072	三聚环保	908,100	5,739,192.00	0.16
251	603883	老百姓	89,487	5,734,326.96	0.16
252	000559	万向钱潮	1,063,610	5,711,585.70	0.16
253	000027	深圳能源	919,100	5,707,611.00	0.16
254	300026	红日药业	1,625,000	5,703,750.00	0.16
255	000930	中粮科技	857,227	5,657,698.20	0.16
256	601689	拓普集团	324,485	5,655,773.55	0.16
257	000685	中山公用	683,459	5,631,702.16	0.16
258	002399	海普瑞	288,632	5,631,210.32	0.16
259	600507	方大特钢	558,800	5,621,528.00	0.16
260	600388	龙净环保	576,500	5,620,875.00	0.16
261	600970	中材国际	806,277	5,619,750.69	0.16
262	600039	四川路桥	1,672,184	5,618,538.24	0.16
263	600138	中青旅	445,840	5,617,584.00	0.16

264	600729	重庆百货	187,337	5,592,009.45	0.16
265	600649	城投控股	976,300	5,584,436.00	0.16
266	600827	百联股份	619,663	5,564,573.74	0.16
267	300182	捷成股份	1,591,700	5,555,033.00	0.16
268	600908	无锡银行	999,200	5,545,560.00	0.16
269	000528	柳工	798,372	5,540,701.68	0.16
270	600500	中化国际	1,044,810	5,537,493.00	0.16
271	601718	际华集团	1,694,500	5,524,070.00	0.16
272	600633	浙数文化	603,700	5,523,855.00	0.16
273	601228	广州港	1,435,900	5,499,497.00	0.16
274	000008	神州高铁	1,503,100	5,456,253.00	0.16
275	002831	裕同科技	204,440	5,427,882.00	0.16
276	000012	南玻A	1,080,739	5,414,502.39	0.16
277	600056	中国医药	412,519	5,383,372.95	0.15
278	600515	海航基础	1,205,600	5,376,976.00	0.15
279	600120	浙江东方	614,758	5,366,837.34	0.15
280	000090	天健集团	1,011,614	5,361,554.20	0.15
281	600598	北大荒	548,300	5,340,442.00	0.15
282	000712	锦龙股份	347,100	5,275,920.00	0.15
283	002665	首航节能	1,569,615	5,273,906.40	0.15
284	600062	华润双鹤	403,000	5,259,150.00	0.15
285	000488	晨鸣纸业	1,032,712	5,256,504.08	0.15
286	000028	国药一致	115,642	5,245,521.12	0.15
287	600158	中体产业	521,684	5,232,490.52	0.15
288	600823	世茂股份	1,160,000	5,220,000.00	0.15
289	002056	横店东磁	635,500	5,211,100.00	0.15
290	601717	郑煤机	804,071	5,202,339.37	0.15
291	601598	中国外运	1,217,800	5,187,828.00	0.15
292	600563	法拉电子	104,870	5,185,821.50	0.15
293	600418	江淮汽车	1,024,686	5,143,923.72	0.15
294	002155	湖南黄金	650,325	5,131,064.25	0.15
295	600348	阳泉煤业	927,700	5,130,181.00	0.15
296	000887	中鼎股份	565,300	5,115,965.00	0.15
297	000826	启迪环境	552,300	5,070,114.00	0.15
298	000158	常山北明	742,180	5,061,667.60	0.15
299	000400	许继电气	468,700	5,047,899.00	0.14
300	002266	浙富控股	1,222,557	5,036,934.84	0.14
301	600648	外高桥	288,500	5,011,245.00	0.14
302	002002	鸿达兴业	1,200,035	4,992,145.60	0.14
303	601608	中信重工	1,338,843	4,980,495.96	0.14
304	600307	酒钢宏兴	2,415,400	4,975,724.00	0.14
305	002030	达安基因	430,610	4,952,015.00	0.14

306	300002	神州泰岳	1,516,808	4,944,794.08	0.14
307	002408	齐翔腾达	685,431	4,900,831.65	0.14
308	600717	天津港	775,500	4,870,140.00	0.14
309	601880	大连港	2,390,749	4,853,220.47	0.14
310	000301	东方盛虹	933,800	4,837,084.00	0.14
311	002183	怡亚通	1,148,900	4,836,869.00	0.14
312	600277	亿利洁能	1,056,500	4,817,640.00	0.14
313	002701	奥瑞金	1,091,241	4,812,372.81	0.14
314	000501	鄂武商 A	357,319	4,745,196.32	0.14
315	002390	信邦制药	902,250	4,736,812.50	0.14
316	000732	泰禾集团	769,700	4,733,655.00	0.14
317	000078	海王生物	1,268,952	4,733,190.96	0.14
318	600862	中航高科	429,300	4,730,886.00	0.14
319	002244	滨江集团	960,970	4,727,972.40	0.14
320	002815	崇达技术	273,300	4,725,357.00	0.14
321	600557	康缘药业	319,543	4,710,063.82	0.14
322	002925	盈趣科技	106,678	4,688,498.10	0.13
323	000681	视觉中国	270,600	4,665,144.00	0.13
324	000758	中色股份	1,065,100	4,665,138.00	0.13
325	002640	跨境通	603,100	4,655,932.00	0.13
326	002203	海亮股份	451,400	4,626,850.00	0.13
327	000156	华数传媒	442,100	4,615,524.00	0.13
328	002603	以岭药业	371,256	4,614,712.08	0.13
329	300134	大富科技	295,960	4,563,703.20	0.13
330	002280	联络互动	1,177,800	4,558,086.00	0.13
331	600291	西水股份	506,400	4,552,536.00	0.13
332	300324	旋极信息	809,729	4,534,482.40	0.13
333	000967	盈峰环境	734,400	4,531,248.00	0.13
334	600195	中牧股份	390,005	4,504,557.75	0.13
335	000718	苏宁环球	1,172,700	4,479,714.00	0.13
336	601928	凤凰传媒	587,900	4,473,919.00	0.13
337	002444	巨星科技	415,120	4,458,388.80	0.13
338	600545	卓郎智能	732,283	4,444,957.81	0.13
339	002635	安洁科技	266,244	4,438,287.48	0.13
340	000717	韶钢松山	934,600	4,430,004.00	0.13
341	600765	中航重机	432,107	4,420,454.61	0.13
342	002709	天赐材料	212,840	4,405,788.00	0.13
343	002302	西部建设	390,200	4,405,358.00	0.13
344	600664	哈药股份	1,161,010	4,400,227.90	0.13
345	002426	胜利精密	1,861,300	4,392,668.00	0.13
346	000727	华东科技	2,100,200	4,389,418.00	0.13
347	600339	中油工程	1,294,700	4,389,033.00	0.13

348	600901	江苏租赁	691,700	4,371,544.00	0.13
349	601975	招商南油	1,553,200	4,364,492.00	0.13
350	000813	德展健康	692,200	4,353,938.00	0.12
351	600316	洪都航空	333,700	4,348,111.00	0.12
352	601611	中国核建	608,500	4,338,605.00	0.12
353	000959	首钢股份	1,225,400	4,325,662.00	0.12
354	603712	七一二	177,800	4,299,204.00	0.12
355	600645	中源协和	252,860	4,280,919.80	0.12
356	601678	滨化股份	834,513	4,264,361.43	0.12
357	603233	大参林	81,148	4,239,983.00	0.12
358	000761	本钢板材	1,073,900	4,231,166.00	0.12
359	002249	大洋电机	1,095,984	4,230,498.24	0.12
360	600748	上实发展	711,587	4,226,826.78	0.12
361	600125	铁龙物流	704,290	4,211,654.20	0.12
362	600499	科达洁能	972,600	4,211,358.00	0.12
363	600869	智慧能源	858,876	4,208,492.40	0.12
364	600859	王府井	298,780	4,179,932.20	0.12
365	600017	日照港	1,424,210	4,144,451.10	0.12
366	002839	张家港行	697,600	4,143,744.00	0.12
367	600835	上海机电	249,575	4,135,457.75	0.12
368	000987	越秀金控	424,900	4,108,783.00	0.12
369	000519	中兵红箭	537,910	4,098,874.20	0.12
370	600582	天地科技	1,280,000	4,083,200.00	0.12
371	600751	海航科技	1,393,000	4,081,490.00	0.12
372	600141	兴发集团	396,641	4,077,469.48	0.12
373	000543	皖能电力	876,747	4,068,106.08	0.12
374	600312	平高电气	629,706	4,067,900.76	0.12
375	600259	广晟有色	116,711	4,058,041.47	0.12
376	600073	上海梅林	507,629	4,045,803.13	0.12
377	600565	迪马股份	1,128,700	4,040,746.00	0.12
378	002745	木林森	295,500	4,021,755.00	0.12
379	600478	科力远	893,409	3,930,999.60	0.11
380	002434	万里扬	413,900	3,923,772.00	0.11
381	000006	深振业 A	731,457	3,920,609.52	0.11
382	601200	上海环境	353,098	3,919,387.80	0.11
383	002419	天虹股份	371,500	3,919,325.00	0.11
384	002920	德赛西威	127,500	3,867,075.00	0.11
385	002491	通鼎互联	583,800	3,858,918.00	0.11
386	002128	露天煤业	444,437	3,848,824.42	0.11
387	600126	杭钢股份	783,040	3,829,065.60	0.11
388	600317	营口港	1,499,600	3,823,980.00	0.11
389	002051	中工国际	382,660	3,719,455.20	0.11

390	002505	大康农业	2,119,190	3,708,582.50	0.11
391	002118	紫鑫药业	592,100	3,694,704.00	0.11
392	603198	迎驾贡酒	184,370	3,672,650.40	0.11
393	300159	新研股份	921,300	3,611,496.00	0.10
394	002382	蓝帆医疗	297,300	3,609,222.00	0.10
395	002375	亚厦股份	622,000	3,607,600.00	0.10
396	002544	杰赛科技	264,799	3,606,562.38	0.10
397	000848	承德露露	452,599	3,561,954.13	0.10
398	002285	世联行	946,759	3,550,346.25	0.10
399	600639	浦东金桥	262,759	3,547,246.50	0.10
400	600787	中储股份	679,570	3,540,559.70	0.10
401	000553	安道麦 A	353,100	3,531,000.00	0.10
402	601326	秦港股份	1,102,000	3,515,380.00	0.10
403	002681	奋达科技	629,130	3,510,545.40	0.10
404	300459	金科文化	1,094,470	3,491,359.30	0.10
405	603328	依顿电子	307,300	3,478,636.00	0.10
406	601139	深圳燃气	443,600	3,473,388.00	0.10
407	002176	江特电机	922,900	3,470,104.00	0.10
408	000062	深圳华强	242,799	3,457,457.76	0.10
409	600759	洲际油气	1,223,625	3,389,441.25	0.10
410	002470	金正大	1,270,600	3,379,796.00	0.10
411	603888	新华网	159,650	3,368,615.00	0.10
412	601019	山东出版	484,600	3,367,970.00	0.10
413	600985	淮北矿业	336,300	3,359,637.00	0.10
414	000537	广宇发展	431,100	3,349,647.00	0.10
415	000564	供销大集	1,395,479	3,335,194.81	0.10
416	603568	伟明环保	145,345	3,334,214.30	0.10
417	300197	铁汉生态	1,087,250	3,326,985.00	0.10
418	603377	东方时尚	180,620	3,298,121.20	0.09
419	603515	欧普照明	117,090	3,291,399.90	0.09
420	300376	易事特	715,900	3,278,822.00	0.09
421	300297	蓝盾股份	578,400	3,262,176.00	0.09
422	600770	综艺股份	603,821	3,254,595.19	0.09
423	002573	清新环境	501,800	3,236,610.00	0.09
424	002867	周大生	168,700	3,212,048.00	0.09
425	002093	国脉科技	389,300	3,137,758.00	0.09
426	600694	大商股份	113,638	3,112,544.82	0.09
427	600428	中远海特	828,652	3,099,158.48	0.09
428	601016	节能风电	1,283,073	3,092,205.93	0.09
429	600575	淮河能源	1,201,000	3,086,570.00	0.09
430	600329	中新药业	220,640	3,058,070.40	0.09
431	002625	光启技术	334,200	3,057,930.00	0.09

432	000869	张裕A	105,662	3,032,499.40	0.09
433	002358	森源电气	430,346	3,008,118.54	0.09
434	000937	冀中能源	818,600	2,996,076.00	0.09
435	603766	隆鑫通用	793,300	2,959,009.00	0.08
436	000061	农产品	524,500	2,931,955.00	0.08
437	000766	通化金马	447,100	2,924,034.00	0.08
438	002416	爱施德	383,240	2,916,456.40	0.08
439	600757	长江传媒	470,016	2,895,298.56	0.08
440	300257	开山股份	265,200	2,885,376.00	0.08
441	000536	华映科技	1,068,500	2,884,950.00	0.08
442	600623	华谊集团	431,000	2,866,150.00	0.08
443	000990	诚志股份	192,400	2,851,368.00	0.08
444	601001	大同煤业	645,828	2,841,643.20	0.08
445	002503	搜于特	1,187,972	2,839,253.08	0.08
446	002424	贵州百灵	325,869	2,838,318.99	0.08
447	600006	东风汽车	617,932	2,830,128.56	0.08
448	002672	东江环保	313,900	2,825,100.00	0.08
449	000426	兴业矿业	567,040	2,818,188.80	0.08
450	002366	台海核电	401,900	2,797,224.00	0.08
451	000980	众泰汽车	939,850	2,753,760.50	0.08
452	600098	广州发展	420,200	2,748,108.00	0.08
453	000600	建投能源	553,300	2,705,637.00	0.08
454	600058	五矿发展	332,600	2,667,452.00	0.08
455	600338	西藏珠峰	212,520	2,656,500.00	0.08
456	603486	科沃斯	130,626	2,650,401.54	0.08
457	600657	信达地产	661,054	2,637,605.46	0.08
458	601615	明阳智能	214,200	2,634,660.00	0.08
459	002482	广田集团	592,683	2,595,951.54	0.07
460	600903	贵州燃气	175,000	2,586,500.00	0.07
461	002437	誉衡药业	848,109	2,569,770.27	0.07
462	002653	海思科	125,800	2,561,288.00	0.07
463	600350	山东高速	519,800	2,552,218.00	0.07
464	601801	皖新传媒	460,884	2,525,644.32	0.07
465	002948	青岛银行	423,900	2,517,966.00	0.07
466	601127	小康股份	219,115	2,497,911.00	0.07
467	603056	德邦股份	222,900	2,476,419.00	0.07
468	603556	海兴电力	151,250	2,465,375.00	0.07
469	600053	九鼎投资	96,400	2,451,452.00	0.07
470	600874	创业环保	337,242	2,424,769.98	0.07
471	600707	彩虹股份	553,300	2,323,860.00	0.07
472	601003	柳钢股份	395,980	2,237,287.00	0.06
473	002818	富森美	174,536	2,207,880.40	0.06

474	601869	长飞光纤	64,000	2,113,920.00	0.06
475	300199	翰宇药业	355,038	2,059,220.40	0.06
476	603983	丸美股份	33,400	2,005,002.00	0.06
477	600335	国机汽车	338,850	1,965,330.00	0.06
478	600996	贵广网络	243,800	1,962,590.00	0.06
479	000025	特力A	91,811	1,946,393.20	0.06
480	601969	海南矿业	301,000	1,742,790.00	0.05
481	601860	紫金银行	309,900	1,741,638.00	0.05
482	603379	三美股份	46,300	1,729,305.00	0.05
483	601811	新华文轩	122,280	1,612,873.20	0.05
484	603225	新凤鸣	129,816	1,603,227.60	0.05
485	603650	彤程新材	91,200	1,588,704.00	0.05
486	603317	天味食品	34,400	1,544,560.00	0.04
487	603355	莱克电气	63,200	1,495,944.00	0.04
488	001872	招商港口	81,800	1,403,688.00	0.04
489	002423	中粮资本	142,300	1,381,733.00	0.04
490	601865	福莱特	113,300	1,374,329.00	0.04
491	603868	飞科电器	36,300	1,367,784.00	0.04
492	603025	大豪科技	142,997	1,354,181.59	0.04
493	600939	重庆建工	280,100	1,347,281.00	0.04
494	601068	中铝国际	237,800	1,317,412.00	0.04
495	603256	宏和科技	75,700	1,118,089.00	0.03
496	600917	重庆燃气	144,100	1,046,166.00	0.03
497	002957	科瑞技术	31,100	1,019,147.00	0.03
498	002941	新疆交建	53,800	944,190.00	0.03
499	002946	新乳业	73,700	925,672.00	0.03
500	603877	太平鸟	43,500	664,245.00	0.02

### 8.3.2 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	688363	华熙生物	9,800	705,600.00	0.02
2	688358	祥生医疗	4,541	222,327.36	0.01
3	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.01
4	688268	华特气体	5,216	186,628.48	0.01
5	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.00
6	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.00
7	688202	美迪西	2,120	107,696.00	0.00
8	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.00
9	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
10	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00

11	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
----	--------	------	-------	----------	------

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601099	太平洋	19,260,490.22	1.52
2	600745	闻泰科技	18,821,166.67	1.48
3	300014	亿纬锂能	18,628,661.32	1.47
4	300012	华测检测	14,869,353.93	1.17
5	002065	东华软件	14,668,264.06	1.15
6	002405	四维图新	14,540,676.16	1.14
7	002180	纳思达	13,811,716.51	1.09
8	600763	通策医疗	13,425,332.17	1.06
9	600739	辽宁成大	13,269,930.72	1.04
10	002157	正邦科技	13,053,579.00	1.03
11	000050	深天马 A	12,385,270.43	0.97
12	300285	国瓷材料	12,371,113.04	0.97
13	601128	常熟银行	12,232,674.83	0.96
14	601233	桐昆股份	11,906,496.39	0.94
15	600150	中国船舶	11,895,472.27	0.94
16	300529	健帆生物	11,457,567.00	0.90
17	600256	广汇能源	11,069,720.50	0.87
18	600132	重庆啤酒	10,618,558.78	0.84
19	600704	物产中大	10,224,168.54	0.80
20	002812	恩捷股份	10,145,786.42	0.80

##### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600183	生益科技	35,160,415.73	2.77
2	603501	韦尔股份	30,227,391.21	2.38
3	600745	闻泰科技	30,110,980.55	2.37
4	600872	中炬高新	29,064,192.80	2.29
5	000860	顺鑫农业	22,420,787.23	1.76
6	002405	四维图新	21,120,849.46	1.66
7	603369	今世缘	20,104,059.43	1.58
8	600536	中国软件	17,312,214.39	1.36
9	002916	深南电路	16,942,606.74	1.33
10	600201	生物股份	16,889,392.41	1.33
11	600779	水井坊	16,801,539.29	1.32
12	300450	先导智能	16,537,551.19	1.30

13	002157	正邦科技	14,490,297.28	1.14
14	600426	华鲁恒升	13,865,186.04	1.09
15	600584	长电科技	13,558,952.00	1.07
16	300347	泰格医药	13,376,156.67	1.05
17	600848	上海临港	12,880,681.69	1.01
18	002506	协鑫集成	12,713,675.97	1.00
19	600739	辽宁成大	12,400,270.70	0.98
20	600763	通策医疗	11,957,209.28	0.94

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,325,476,211.38
卖出股票收入（成交）总额	2,134,589,085.52

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,203,000.00	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,203,000.00	0.18

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

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	128085	鸿达转债	14,038	1,403,800.00	0.04
2	128086	国轩转债	11,657	1,165,700.00	0.03
3	110063	鹰 19 转债	10,140	1,014,000.00	0.03
4	128084	木森转债	8,377	837,700.00	0.02
5	110065	淮矿转债	6,180	618,000.00	0.02

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

无。

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

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

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 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
IC2003	IC2003	58	60,686,560.00	5,601,600.68	-
IC2006	IC2006	100	103,288,000.00	2,810,840.00	-
公允价值变动总额合计(元)					8,412,440.68
股指期货投资本期收益(元)					11,888,581.86
股指期货投资本期公允价值变动(元)					10,132,160.68

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
无。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 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1月25日，太平洋证券股份有限公司发布关于收到云南证监局行政监管措施决定书的公告，公司违反了《证券公司风险控制指标管理办法》第七条、第十九条的规定，责令公司限期改正。2019年7月15日，太平洋证券股份有限公司发布关于收到云南证监局行政监管措施决定书的公告，自收到行政监管措施决定书之日起暂停太平洋证券股份有限公司另类投资子公司业务（项目退出或投资标的股权转让除外）3个月。

本基金投资于“太平洋（601099）”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，太平洋为标的指数成份股，本基金投资于“太平洋”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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	19,837,434.40
2	应收证券清算款	9,880,164.95
3	应收股利	-
4	应收利息	53,995.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,771,594.74

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600584	长电科技	3,398,108.00	0.10	转融通出借证券
2	000066	中国长城	2,015,020.00	0.06	转融通出借证券
3	300014	亿纬锂能	1,088,472.00	0.03	转融通出借证券
4	601099	太平洋	113,700.00	0.00	转融通出借证券

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688363	华熙生物	705,600.00	0.02	科创板新股锁定
2	688358	祥生医疗	222,327.36	0.01	科创板新股锁定
3	688181	八亿时空	189,377.88	0.01	新发未上市
4	688268	华特气体	186,628.48	0.01	科创板新股锁定

5	688399	硕世生物	124,827.90	0.00	科创板新股锁定
---	--------	------	------------	------	---------

注:根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》,本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的,锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
9,512	65,804.44	560,401,070.00	89.53	65,530,798.00	10.47

#### 9.1.2 ETF 联接基金期末持有份额及占比

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500ETF 联接	422,937,780.00	67.57

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例 (%)
1	中国证券金融股份有限公司	40,950,000.00	6.54
2	广发证券股份有限公司	11,441,101.00	1.83
3	民生通惠资管—工商银行—民生通惠精选策略 FOF1 号 资产管理产品	10,200,000.00	1.63
4	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	8,300,000.00	1.33
5	中国国际金融股份有限公司	7,280,641.00	1.16
6	中信证券股份有限公司	6,310,928.00	1.01
7	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	5,773,600.00	0.92
8	渤海人寿保险股份有限公司—分红险产品一	5,551,300.00	0.89
9	国泰君安证券股份有限公司	5,130,041.00	0.82
10	招商证券股份有限公司	4,562,790.00	0.73
11	中国建设银行股份有限公司—嘉实中证 500 交易型开 放式指数证券投资基金联接基金	422,937,780.00	67.57

注:上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	292,031,868.00
本报告期基金总申购份额	975,150,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	641,250,000.00
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	625,931,868.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### （1）基金管理人的重大人事变动情况

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。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券股份有限公司	1	1,304,474,196.77	38.06%	913,234.18	43.78%	-
招商证券股份有限公司	1	811,962,809.09	23.69%	568,386.63	27.25%	-
中信建投证券股份有限公司	3	496,784,015.43	14.49%	75,172.26	3.60%	新增 1 个
光大证券股份有限公司	1	427,099,580.24	12.46%	269,630.69	12.92%	新增
申万宏源证券有限公司	3	196,710,432.14	5.74%	137,699.21	6.60%	-
兴业证券股份有限公司	2	166,538,349.64	4.86%	105,133.03	5.04%	-

公司						
北京高华 证券有限 责任公司	1	24,092,450.00	0.70%	16,864.96	0.81%	-
财富证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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

## 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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
北京高华证券有限责任公司	8,784,154.70	64.69%	1,521,000,000.00	15.05%	-	-
光大证券股份有限公司	382,296.30	2.82%	2,099,000,000.00	20.77%	-	-
华泰证券股份有限公司	833,269.80	6.14%	3,716,000,000.00	36.77%	-	-
申万宏源证券有限公司	365,207.41	2.69%	851,000,000.00	8.42%	-	-
兴业证券股份有限公司	251,549.00	1.85%	1,918,000,000.00	18.98%	-	-
招商证券股份有限公司	2,962,193.48	21.82%	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实中证 500ETF 流动性服务商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 01 月 03 日
2	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 01 月 28 日
3	关于嘉实中证 500ETF 流动性服务商的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 04 月 01 日
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加流动性服务商的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 04 月 23 日
5	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	上海证券报、管理人网站	2019 年 06 月 15 日
6	关于增加国盛证券为嘉实旗下基金申购赎回代理券商的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 06 月 26 日
7	关于增加中金公司为嘉实中证 500 交	上海证券报、管理人网	2019 年 10 月 11 日

	易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	站	
8	关于嘉实中证 500ETF 开通场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎业务并修改基金合同的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 10 月 16 日
9	关于嘉实中证 500ETF 更新招募说明书的更正公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 10 月 19 日
10	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金“深市股票实物申赎、沪市股票现金替代”模式下增加申购赎回代理券商的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 10 月 21 日
11	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 11 月 05 日
12	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 11 月 06 日
13	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 11 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2019/01/01 至 2019/12/31	218,476,780.00	1,412,102,100.00	1,207,641,100.00	422,937,780.00	67.57

#### 产品特有风险

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。

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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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基金合同》;
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
- (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公告的各项原稿。

### 13.2 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

### 13.3 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 04 月 08 日