

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 30 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 2021 年 03 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况	13
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	20
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	20
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
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	20
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
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 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
8.10 期末投资目标基金明细 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.13 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
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 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>74</b>
12.1 备查文件目录 .....	74
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	嘉实中证 500ETF 联接	
基金主代码	000008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 22 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,003,023,597.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	000008	070039
报告期末下属分级基金的份额总额	865,280,318.83 份	137,743,278.96 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	<p>本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还将适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。</p> <p>此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他</p>

	经中国证监会允许的衍生金融产品。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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%。
风险收益特征	本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

### 2.2.1 目标基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	021-60637111
传真	(010) 65215588	021-60635778
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	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	经雷	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C

座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、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	报告期（2020 年 1 月 1 日 -2020 年 12 月 31 日）		报告期（2019 年 1 月 1 日 -2019 年 12 月 31 日）		报告期（2018 年 1 月 1 日 -2018 年 12 月 31 日）	2018 年 9 月 14 日 (基金合同 生效 日)-2018 年 12 月 31 日
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联 接 C
本期 已实 现收 益	536,311,634. 06	73,650,593 .77	-39,588,854. 75	-3,093,641 .88	-50,032,030. 14	-3,192.25
本期 利 润	423,127,506. 11	103,257,82 3.12	331,735,352. 28	14,870,366 .54	-332,299,226 .06	-183,665. 85
加 权 平 均 基 金 份 额	0.3676	0.4321	0.2682	0.1091	-0.5181	-0.1437

本期利润						
本期加权平均净值利润率	23.33%	35.56%	19.93%	10.17%	-36.94%	-15.35%
本期基金份额净值增长率	21.36%	20.89%	25.69%	25.31%	-30.74%	-10.30%
3.1 .2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	629,528,553.69	47,086,975.33	618,862,018.44	-20,691,072.48	122,992,577.69	-388,883.89
期末	0.7275	0.3418	0.4234	-0.0547	0.1325	-0.1030



可供分配基金份额利润						
期末基金资产净值	1,494,808,872.52	187,162,258.62	2,080,377,134.23	425,408,880.34	1,051,110,945.72	3,386,774.77
期末基金份额净值	1.7275	1.3588	1.4234	1.1240	1.1325	0.8970
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	81.63%	35.88%	49.66%	12.40%	19.07%	-10.30%

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

嘉实中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.52%	1.09%	2.70%	1.10%	-0.18%	-0.01%
过去六个月	9.15%	1.36%	8.20%	1.38%	0.95%	-0.02%
过去一年	21.36%	1.52%	19.94%	1.54%	1.42%	-0.02%
过去三年	5.65%	1.45%	2.25%	1.46%	3.40%	-0.01%
过去五年	-8.41%	1.42%	-15.01%	1.44%	6.60%	-0.02%
自基金合同生效起至今	81.63%	1.60%	76.08%	1.62%	5.55%	-0.02%

嘉实中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.42%	1.09%	2.70%	1.10%	-0.28%	-0.01%

过去六个月	8.94%	1.36%	8.20%	1.38%	0.74%	-0.02%
过去一年	20.89%	1.52%	19.94%	1.54%	0.95%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	35.88%	1.48%	33.36%	1.49%	2.52%	-0.01%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中证 500 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}^{(1/365)}$$

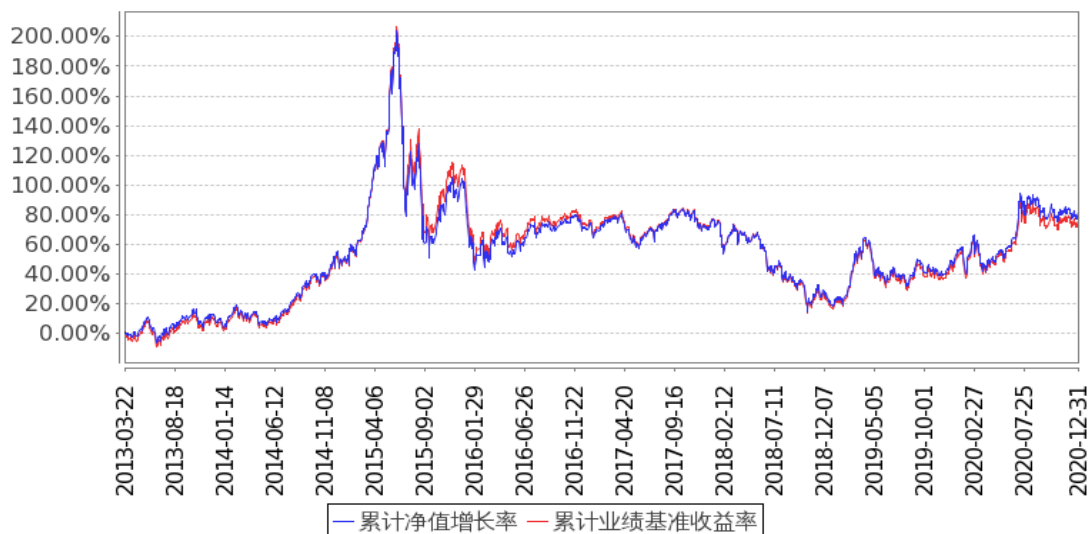
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

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

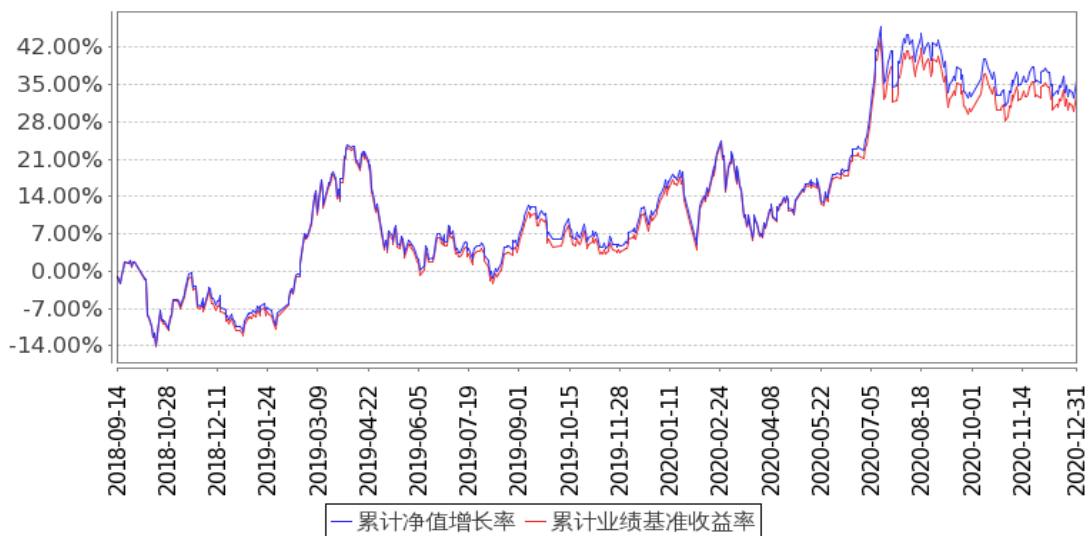
#### 嘉实中证500ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势 对比图

(2013年03月22日至2020年12月31日)



### 嘉实中证500ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

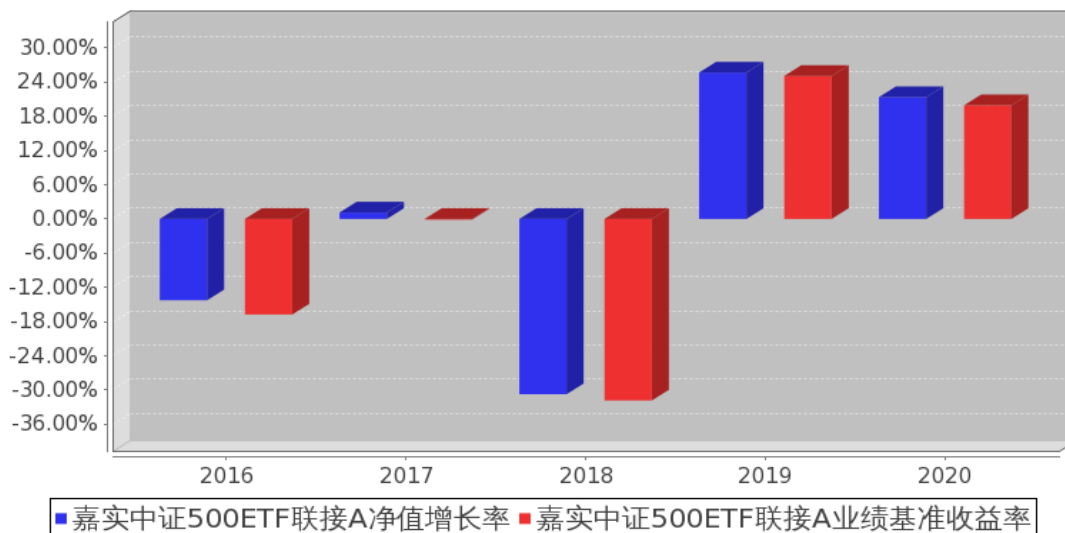
(2018年09月14日至2020年12月31日)



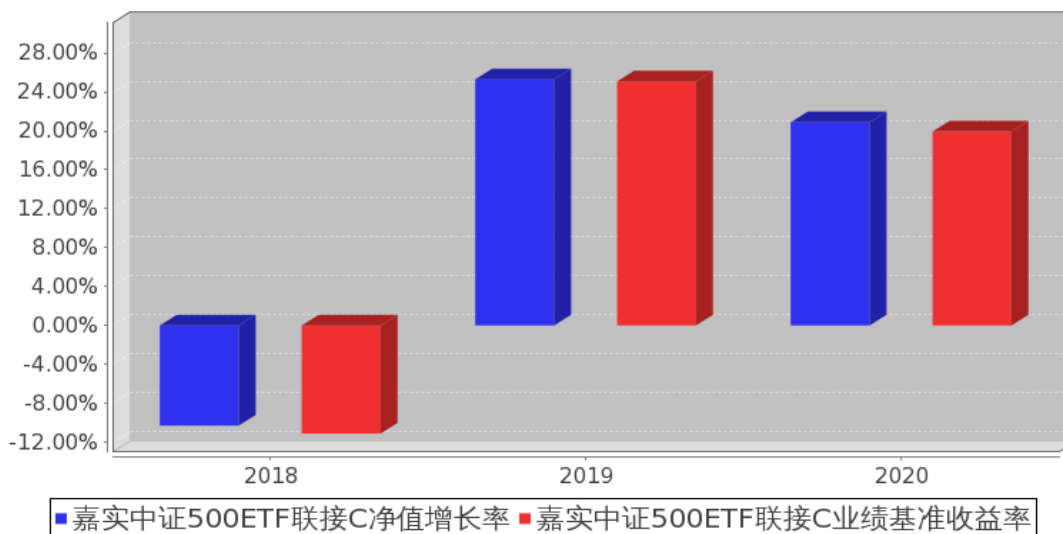
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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联接A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



嘉实中证500ETF联接C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



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

嘉实中证 500ETF 联接 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	0.6600	38,733,537.78	15,832,308.03	54,565,845.81	-
合计	0.6600	38,733,537.78	15,832,308.03	54,565,845.81	-

## § 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，总部设在北京并设北京、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2020年12月31日，基金管理人共管理205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、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、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 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、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。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-L)	2016 年 1 月 5 日	-	14 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。

	OF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、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、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理				
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实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	2016 年 1 月 5 日	-	15 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。



动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理				
---------------------------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和

实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基金日均跟踪误差为 0.06%，年度化拟合偏离度为 0.98%。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值为 1.7275 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.36%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.3588 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.89%；业绩比较基准收益率为 19.94%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金将在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化投资管理策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

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

(2) 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) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，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) 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基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

**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，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

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

**§ 6 审计报告****6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 23519 号

**6.2 审计报告的基本内容**

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 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”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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</p>

	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 联接基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
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 联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 500ETF 联接基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(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。</p> <p>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 联接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 联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实中证 500ETF 联接基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

	<p>(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,就可能对导致对嘉实中证 500ETF 联接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 联接基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	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	
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	82,004,861.76	274,004,817.36
结算备付金		12,513,461.76	16,973,041.89
存出保证金		1,768,222.69	2,519,373.52
交易性金融资产	7.4.7.2	1,584,489,891.09	2,358,898,477.86
其中: 股票投资		1,756,789.08	1,057,173.92
基金投资		1,578,216,902.01	2,356,651,603.94
债券投资		4,516,200.00	1,189,700.00
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	-	135,000,000.00
应收证券清算款		28,510,810.32	-
应收利息	7.4.7.5	29,746.85	40,763.85
应收股利		-	-

应收申购款		2,509,782.83	3,589,360.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,711,826,777.30	2,791,025,835.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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		17,818,450.30	130,178,946.48
应付赎回款		9,822,477.48	152,626,938.82
应付管理人报酬		17,084.76	27,098.00
应付托管费		5,694.91	9,032.71
应付销售服务费		63,517.49	105,544.82
应付交易费用	7.4.7.7	1,445,212.07	1,515,344.65
应交税费		440,492.55	7.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	242,716.60	776,908.09
负债合计		29,855,646.16	285,239,820.68
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,003,023,597.79	1,839,991,362.26
未分配利润	7.4.7.10	678,947,533.35	665,794,652.31
所有者权益合计		1,681,971,131.14	2,505,786,014.57
负债和所有者权益总计		1,711,826,777.30	2,791,025,835.25

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值 1.7275 元，基金份额总额 865,280,318.83 份，嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值 1.3588 元，基金份额总额 137,743,278.96 份，基金份额总额合计为 1,003,023,597.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		535,160,566.32	352,554,108.29
1. 利息收入		1,075,665.10	1,152,777.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	869,885.65	968,610.61

债券利息收入		51,114.53	1,405.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		154,664.92	182,744.74
证券出借利息收入		-	16.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		615,127,693.56	-40,335,536.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,384,378.19	11,252,737.94
基金投资收益	7.4.7.13	584,698,404.17	-56,268,241.72
债券投资收益	7.4.7.14	263,761.40	559,396.98
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	5,497,460.20	3,628,739.11
股利收益	7.4.7.17	283,689.60	491,831.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-83,576,898.60	389,288,215.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,534,106.26	2,448,651.75
减：二、费用		8,775,237.09	5,948,389.47
1. 管理人报酬		241,822.11	473,734.66
2. 托管费		80,607.34	115,371.22
3. 销售服务费		1,168,601.81	578,028.81
4. 交易费用	7.4.7.20	4,975,089.57	4,511,648.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,046,686.03	10,990.50
7. 其他费用	7.4.7.21	262,430.23	258,615.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		526,385,329.23	346,605,718.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		526,385,329.23	346,605,718.82

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元



项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	1,839,991,362.26	665,794,652.31	2,505,786,014.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	526,385,329.23	526,385,329.23
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)	-836,967,764.47	-513,232,448.19	-1,350,200,212.66
其中：1. 基金申购款	1,585,137,275.04	575,932,760.34	2,161,070,035.38
2. 基金赎回款	-2,422,105,039.51	-1,089,165,208.53	-3,511,270,248.04
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)	1,003,023,597.79	678,947,533.35	1,681,971,131.14
项目	上年度可比期间 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)	931,894,026.69	122,603,693.80	1,054,497,720.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	346,605,718.82	346,605,718.82
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)	908,097,335.57	196,585,239.69	1,104,682,575.26
其中：1. 基金申购款	2,564,135,417.56	699,633,600.52	3,263,769,018.08
2. 基金赎回款	-1,656,038,081.99	-503,048,360.83	-2,159,086,442.82

回款			
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）	1,839,991,362.26	665,794,652.31	2,505,786,014.57

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联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 292,915,388.83 份基金份额。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。

### 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联接基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 and 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

由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益每年最多分配 6 次，每基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每基金份额可供分配利润的 10%。本基金收益分配方式分为两种，现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估

值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	82,004,861.76	274,004,817.36



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 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	82,004,861.76	274,004,817.36

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,696,727.43	1,756,789.08	60,061.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,514,690.40	4,516,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,514,690.40	4,516,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	1,556,327,524.26	1,578,216,902.01	21,889,377.75
其他	-	-	-
合计	1,562,538,942.09	1,584,489,891.09	21,950,949.00
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,047,554.87	1,057,173.92	9,619.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,189,700.00	1,189,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,189,700.00	1,189,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	2,252,496,439.39	2,356,651,603.94	104,155,164.55
其他	-	-	-
合计	2,254,733,694.26	2,358,898,477.86	104,164,783.60

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	7,026,280.00	-	-	-
其中：股指期货投资	7,026,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,026,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,081,456.00	-	-	-
其中：股指期货投资	15,081,456.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,081,456.00	-	-	-

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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金买入 IC2106 持仓量为 6 手，对应合约市值 7,322,880.00 元，公允价值变动 296,600.00 元，公允价值变动总额合计 296,600.00 元，可抵消期货暂收款 296,600.00 元，股指期货投资净额为零（于 2019 年 12 月 31 日：买入 IC2003 持仓量为 16 手，对应合约市值 16,741,120.00 元，公允价值变动 1,659,664.00 元，公允价值变动总额合计 1,659,664.00 元，可抵消期货暂收款 1,659,664.00 元，股指期货投资净额为零）。

#### 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 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

合计	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	135,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	135,000,000.00	-

#### 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,665.97	32,550.03
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,392.08	9,800.84
应收债券利息	15,320.96	146.06
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-1,985.75
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	367.84	252.67
合计	29,746.85	40,763.85

#### 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,445,212.07	1,515,344.65
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,445,212.07	1,515,344.65

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	22,716.60	556,908.09
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	242,716.60	776,908.09

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 500ETF 联接 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,461,515,115.79	1,461,515,115.79
本期申购	871,908,076.39	871,908,076.39
本期赎回（以“-”号填列）	-1,468,142,873.35	-1,468,142,873.35
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	865,280,318.83	865,280,318.83

嘉实中证 500ETF 联接 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	378,476,246.47	378,476,246.47
本期申购	713,229,198.65	713,229,198.65
本期赎回（以“-”号填列）	-953,962,166.16	-953,962,166.16
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	137,743,278.96	137,743,278.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实中证 500ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	850,389,952.79	-231,527,934.35	618,862,018.44
本期利润	536,311,634.06	-113,184,127.95	423,127,506.11
本期基金份额交易产生的变动数	-442,341,877.17	29,880,906.31	-412,460,970.86

其中：基金申购款	632,512,897.39	-176,829,894.19	455,683,003.20
基金赎回款	-1,074,854,774.56	206,710,800.50	-868,143,974.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	944,359,709.68	-314,831,155.99	629,528,553.69

## 嘉实中证 500ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,691,072.48	67,623,706.35	46,932,633.87
本期利润	73,650,593.77	29,607,229.35	103,257,823.12
本期基金份额交易产生的变动数	-5,872,545.96	-94,898,931.37	-100,771,477.33
其中：基金申购款	32,174,226.02	88,075,531.12	120,249,757.14
基金赎回款	-38,046,771.98	-182,974,462.49	-221,021,234.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,086,975.33	2,332,004.33	49,418,979.66

## 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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	710,261.22	782,627.35
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	146,285.12	179,169.83
其他	13,339.31	6,813.43
合计	869,885.65	968,610.61

## 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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,968,860.25	6,917,777.03
股票投资收益——赎回差价收入	-	-

股票投资收益——申购差价收入	20,415,517.94	4,334,960.91
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	24,384,378.19	11,252,737.94

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	233,877,232.16	405,151,928.48
减：卖出股票成本总额	229,908,371.91	398,234,151.45
买卖股票差价收入	3,968,860.25	6,917,777.03

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
申购基金份额总额	7,230,037,335.00	4,834,799,595.00
减：现金支付申购款总额	1,826,951,755.60	294,196,553.13
减：申购股票成本总额	5,382,670,061.46	4,536,268,080.96
申购差价收入	20,415,517.94	4,334,960.91

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	8,513,405,753.45	3,778,241,094.50
减：卖出/赎回基金成本总额	7,928,707,349.28	3,834,509,336.22
基金投资收益	584,698,404.17	-56,268,241.72

## 7.4.7.14 债券投资收益

## 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	263,761.40	559,396.98
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	263,761.40	559,396.98

## 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成交总额	88,510,387.79	12,059,379.67
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	86,619,535.00	11,498,700.00
减：应收利息总额	1,627,091.39	1,282.69
买卖债券差价收入	263,761.40	559,396.98

## 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2019年1月1日至2019年12月31日
股指期货投资收益	5,497,460.20	3,628,739.11

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	283,689.60	491,831.52
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	283,689.60	491,831.52

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	-82,213,834.60	387,475,631.45
股票投资	50,442.60	1,771,257.42
债券投资	1,509.60	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-82,265,786.80	385,704,374.03
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-1,363,064.00	1,812,584.00
权证投资	-	-
期货投资	-1,363,064.00	1,812,584.00
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	-83,576,898.60	389,288,215.45

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	2,366,149.49	2,211,377.66
基金转出费收入	167,956.77	237,274.09
合计	2,534,106.26	2,448,651.75

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	4,425,597.55	4,118,279.51
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	549,492.02	393,369.39
其中：申购费	142,266.26	207,824.00
赎回费	3,312.49	18,257.89
交易费	403,913.27	167,287.50
其他费用	-	-

合计	4,975,089.57	4,511,648.90
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	42,430.23	38,615.38
合计	262,430.23	258,615.38

#### 7.4.7.22 分部报告

无。

#### 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（“嘉实基金”）	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
DWS Investments Singapore Limited	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
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

##### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	241,822.11	473,734.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,560,900.63	693,286.00

注：1. 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50%/0.15% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 =（前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值）（若为负数，则取 0）× 该日适用费率 / 当年天数。2. 自 2019 年 6 月 18 日起，基金管理费率由 0.50% 调整为 0.15%。3. 根据

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	80,607.34	115,371.22

注：1. 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 0.1%/0.05%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=(前一日基金资产净值-基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值)(若为负数，则取 0)×该日适用费率/当年天数。2. 自 2019 年 6 月 18 日起，基金托管费率由 0.1%调整为 0.05%。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	657,784.18	657,784.18
中国建设银行	-	-	-
合计	-	657,784.18	657,784.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	192,590.24	192,590.24
中国建设银行	-	-	-
合计	-	192,590.24	192,590.24

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

数。(2) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	本期 2020年1月1日至2020年12月31日
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	23,432,374.16
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	23,432,374.16
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

#### 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

无。

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	82,004,861.76	710,261.22	274,004,817.36	782,627.35

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2020年12月31日)，本基金持有226,543,731.00份目标ETF基金份额(2019年12月31日：422,937,780.00份)，占其总份额的比例为42.91%(2019年12月31日：67.57%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2020年1月1日至2020年12月31日)，本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末(2020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
003030	祖名股	2020年	2021年	新发未上	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

	份	12月25日	1月6日	市						
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-

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

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为嘉实中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 500ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数及嘉实中证 500ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。本基金的基金管理人按照法律法

规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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同责任，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拥有相关资质的银行，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与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### **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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	168,000.00
AAA 以下	-	1,021,700.00
未评级	-	-
合计	-	1,189,700.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约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相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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。

#### 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	82,004,861.76	-	-	-	82,004,861.76
结算备付金	12,513,461.76	-	-	-	12,513,461.76
存出保证金	743,019.49	-	-	1,025,203.20	1,768,222.69
交易性金融资产	4,516,200.00	-	-	1,579,973,691.09	1,584,489,891.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	28,510,810.32	28,510,810.32
应收利息	-	-	-	29,746.85	29,746.85

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,509,782.83	2,509,782.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	99,777,543.01	-	-	-1,612,049,234.29	1,711,826,777.30
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	-	-	-	17,818,450.30	17,818,450.30
应付赎回款	-	-	-	9,822,477.48	9,822,477.48
应付管理人报酬	-	-	-	17,084.76	17,084.76
应付托管费	-	-	-	5,694.91	5,694.91
应付销售服务费	-	-	-	63,517.49	63,517.49
应付交易费用	-	-	-	1,445,212.07	1,445,212.07
应付税费	-	-	-	440,492.55	440,492.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	242,716.60	242,716.60
负债总计	-	-	-	29,855,646.16	29,855,646.16
利率敏感度缺口	99,777,543.01	-	-	-1,582,193,588.13	1,681,971,131.14
上年度末 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	274,004,817.36	-	-	-	274,004,817.36
结算备付金	16,973,041.89	-	-	-	16,973,041.89
存出保证金	510,439.12	-	-	2,008,934.40	2,519,373.52
交易性金融资产	-	-	1,189,700.00	2,357,708,777.86	2,358,898,477.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	135,000,000.00	-	-	-	135,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	40,763.85	40,763.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,589,360.77	3,589,360.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	426,488,298.37	-	1,189,700.00	2,363,347,836.88	2,791,025,835.25
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	-	-	-	130,178,946.48	130,178,946.48
应付赎回款	-	-	-	152,626,938.82	152,626,938.82
应付管理人报酬	-	-	-	27,098.00	27,098.00
应付托管费	-	-	-	9,032.71	9,032.71
应付销售服务费	-	-	-	105,544.82	105,544.82
应付交易费用	-	-	-	1,515,344.65	1,515,344.65
应付税费	-	-	-	7.11	7.11
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	776,908.09	776,908.09
负债总计	-	-	-	285,239,820.68	285,239,820.68
利率敏感度缺口	426,488,298.37	-	1,189,700.00	2,078,108,016.20	2,505,786,014.57

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 2020 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 0.27% (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 0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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 2020年12月31日		上年度末 2019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	1,756,789.08	0.10	1,057,173.92	0.04
交易性金融资产—基金投资	1,578,216,902.01	93.83	2,356,651,603.94	94.05
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,579,973,691.09	93.94	2,357,708,777.86	94.09

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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）		上年度末（2019年12月31日）
	本期末（2020年12月31日）		
分析	业绩比较基准上升5%	83,351,577.96	124,475,788.82
	业绩比较基准下降5%	-83,351,577.96	-124,475,788.82

#### 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 1,579,951,901.55 元，属于第二层次的余额为 4,537,989.54 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,357,702,199.82 元，第二层次 1,196,278.04 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	1,756,789.08	0.10
	其中：股票	1,756,789.08	0.10
2	基金投资	1,578,216,902.01	92.19

3	固定收益投资	4,516,200.00	0.26
	其中：债券	4,516,200.00	0.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	94,518,323.52	5.52
8	其他各项资产	32,818,562.69	1.92
9	合计	1,711,826,777.30	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,710.00	0.00
B	采矿业	18,565.69	0.00
C	制造业	1,071,962.06	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,178.78	0.00
E	建筑业	15,695.35	0.00
F	批发和零售业	56,211.86	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	35,780.09	0.00
H	住宿和餐饮业	5,153.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	198,475.98	0.01
J	金融业	209,034.06	0.01
K	房地产业	45,607.08	0.00
L	租赁和商务服务业	11,784.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	10,213.94	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,339.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,919.68	0.00
R	文化、体育和娱乐业	11,929.00	0.00
S	综合	9,228.76	0.00
	合计	1,756,789.08	0.10

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603605	珀莱雅	1,000	178,000.00	0.01
2	002500	山西证券	8,800	78,760.00	0.00
3	603737	三棵树	500	75,750.00	0.00
4	002670	国盛金控	3,600	49,500.00	0.00
5	603444	吉比特	100	42,600.00	0.00
6	603868	飞科电器	500	23,390.00	0.00
7	603355	莱克电气	748	22,612.04	0.00
8	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
9	600426	华鲁恒升	500	18,650.00	0.00
10	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
11	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
12	002936	郑州银行	3,600	16,056.00	0.00
13	688099	晶晨股份	200	15,746.00	0.00
14	300595	欧普康视	179	14,663.68	0.00
15	688088	虹软科技	200	13,984.00	0.00
16	000547	航天发展	500	13,750.00	0.00
17	600143	金发科技	791	13,557.74	0.00
18	601233	桐昆股份	655	13,486.45	0.00
19	601099	太平洋	3,200	13,056.00	0.00
20	002957	科瑞技术	600	12,270.00	0.00
21	002185	华天科技	900	12,258.00	0.00
22	600132	重庆啤酒	100	11,899.00	0.00
23	600704	物产中大	2,600	11,362.00	0.00
24	600219	南山铝业	3,500	11,060.00	0.00
25	002797	第一创业	1,100	10,945.00	0.00
26	600739	辽宁成大	450	10,944.00	0.00
27	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
28	000636	风华高科	300	10,110.00	0.00
29	300012	华测检测	361	9,880.57	0.00
30	300146	汤臣倍健	400	9,660.00	0.00
31	002131	利欧股份	3,000	9,090.00	0.00
32	300088	长信科技	1,000	8,890.00	0.00
33	601128	常熟银行	1,200	8,856.00	0.00
34	002465	海格通信	800	8,664.00	0.00
35	002078	太阳纸业	600	8,658.00	0.00
36	600201	生物股份	412	8,606.68	0.00
37	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00



38	603806	福斯特	97	8,283.80	0.00
39	000009	中国宝安	1,092	8,222.76	0.00
40	001872	招商港口	511	8,135.12	0.00
41	600699	均胜电子	300	7,608.00	0.00
42	002901	大博医疗	100	7,373.00	0.00
43	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
44	000050	深天马 A	479	7,060.46	0.00
45	002250	联化科技	290	6,957.10	0.00
46	600733	北汽蓝谷	800	6,936.00	0.00
47	600166	福田汽车	2,200	6,930.00	0.00
48	603786	科博达	100	6,762.00	0.00
49	600879	航天电子	900	6,732.00	0.00
50	603317	天味食品	80	6,579.20	0.00
51	300168	万达信息	300	6,507.00	0.00
52	600885	宏发股份	120	6,506.40	0.00
53	300271	华宇软件	271	6,468.77	0.00
54	601799	星宇股份	32	6,416.00	0.00
55	300070	碧水源	838	6,410.70	0.00
56	002212	天融信	300	6,303.00	0.00
57	300315	掌趣科技	1,200	6,132.00	0.00
58	002273	水晶光电	522	6,049.98	0.00
59	600862	中航高科	200	6,020.00	0.00
60	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
61	600884	杉杉股份	325	5,859.75	0.00
62	002223	鱼跃医疗	206	5,811.26	0.00
63	300316	晶盛机电	192	5,775.36	0.00
64	600598	北大荒	300	5,775.00	0.00
65	002373	千方科技	300	5,736.00	0.00
66	300496	中科创达	49	5,733.00	0.00
67	002019	亿帆医药	300	5,679.00	0.00
68	603338	浙江鼎力	56	5,666.64	0.00
69	000401	冀东水泥	400	5,660.00	0.00
70	000686	东北证券	576	5,656.32	0.00
71	601866	中远海发	1,900	5,643.00	0.00
72	002064	华峰化学	556	5,610.04	0.00
73	002195	二三四五	2,470	5,582.20	0.00
74	300017	网宿科技	800	5,512.00	0.00
75	000623	吉林敖东	334	5,500.98	0.00
76	300212	易华录	178	5,455.70	0.00
77	002925	盈趣科技	84	5,403.72	0.00
78	002152	广电运通	500	5,340.00	0.00
79	600642	申能股份	1,022	5,334.84	0.00

80	603983	丸美股份	100	5,221.00	0.00
81	600754	锦江酒店	100	5,153.00	0.00
82	600409	三友化工	500	5,125.00	0.00
83	000718	苏宁环球	1,491	5,114.13	0.00
84	600895	张江高科	300	5,112.00	0.00
85	000060	中金岭南	1,050	5,061.00	0.00
86	000690	宝新能源	693	5,058.90	0.00
87	600549	厦门钨业	300	5,055.00	0.00
88	600529	山东药玻	100	5,015.00	0.00
89	600765	中航重机	200	5,000.00	0.00
90	600511	国药股份	100	4,931.00	0.00
91	300115	长盈精密	200	4,930.00	0.00
92	600153	建发股份	600	4,926.00	0.00
93	300418	昆仑万维	243	4,847.85	0.00
94	603858	步长制药	210	4,844.70	0.00
95	300058	蓝色光标	800	4,800.00	0.00
96	600811	东方集团	1,300	4,745.00	0.00
97	603866	桃李面包	80	4,728.00	0.00
98	600667	太极实业	500	4,725.00	0.00
99	600580	卧龙电驱	300	4,680.00	0.00
100	002081	金螳螂	493	4,629.27	0.00
101	300024	机器人	373	4,587.90	0.00
102	000738	航发控制	200	4,586.00	0.00
103	600728	佳都科技	600	4,554.00	0.00
104	600167	联美控股	400	4,540.00	0.00
105	000729	燕京啤酒	530	4,515.60	0.00
106	300296	利亚德	700	4,452.00	0.00
107	600535	天士力	300	4,437.00	0.00
108	600827	百联股份	300	4,380.00	0.00
109	600528	中铁工业	500	4,370.00	0.00
110	002444	巨星科技	140	4,355.40	0.00
111	000930	中粮科技	500	4,210.00	0.00
112	002124	天邦股份	284	4,146.40	0.00
113	000629	攀钢钒钛	1,900	4,123.00	0.00
114	603486	科沃斯	46	4,070.54	0.00
115	600515	海航基础	600	4,050.00	0.00
116	600804	鹏博士	600	4,032.00	0.00
117	002507	涪陵榨菜	95	4,018.50	0.00
118	002028	思源电气	200	4,012.00	0.00
119	600026	中远海能	600	4,008.00	0.00
120	601005	重庆钢铁	2,700	3,996.00	0.00
121	603000	人民网	235	3,971.50	0.00

122	601689	拓普集团	100	3,843.00	0.00
123	000598	兴蓉环境	800	3,840.00	0.00
124	000932	华菱钢铁	800	3,824.00	0.00
125	000301	东方盛虹	400	3,792.00	0.00
126	002926	华西证券	300	3,744.00	0.00
127	600273	嘉化能源	400	3,696.00	0.00
128	300026	红日药业	800	3,664.00	0.00
129	002807	江阴银行	853	3,650.84	0.00
130	000778	新兴铸管	975	3,588.00	0.00
131	002302	西部建设	400	3,512.00	0.00
132	000960	锡业股份	313	3,505.60	0.00
133	000021	深科技	184	3,497.84	0.00
134	002557	洽洽食品	64	3,446.40	0.00
135	600060	海信视像	300	3,444.00	0.00
136	002110	三钢闽光	507	3,412.11	0.00
137	600079	人福医药	100	3,388.00	0.00
138	000513	丽珠集团	82	3,321.00	0.00
139	002368	太极股份	127	3,315.97	0.00
140	002004	华邦健康	595	3,296.30	0.00
141	002056	横店东磁	216	3,281.04	0.00
142	002217	合力泰	800	3,280.00	0.00
143	600597	光明乳业	200	3,252.00	0.00
144	601699	潞安环能	500	3,250.00	0.00
145	600446	金证股份	200	3,242.00	0.00
146	600380	健康元	232	3,227.12	0.00
147	000402	金融街	500	3,225.00	0.00
148	601000	唐山港	1,300	3,224.00	0.00
149	600782	新钢股份	700	3,213.00	0.00
150	600909	华安证券	400	3,200.00	0.00
151	000997	新大陆	209	3,193.52	0.00
152	300376	易事特	400	3,184.00	0.00
153	002266	浙富控股	700	3,150.00	0.00
154	600037	歌华有线	342	3,146.40	0.00
155	000825	太钢不锈	864	3,119.04	0.00
156	000883	湖北能源	800	3,104.00	0.00
157	300630	普利制药	74	3,099.86	0.00
158	300133	华策影视	500	3,090.00	0.00
159	601598	中国外运	700	3,080.00	0.00
160	002085	万丰奥威	468	3,070.08	0.00
161	002839	张家港行	500	3,050.00	0.00
162	600908	无锡银行	500	3,040.00	0.00
163	000563	陕国投A	800	3,016.00	0.00

164	002563	森马服饰	300	3,006.00	0.00
165	600500	中化国际	570	3,003.90	0.00
166	002701	奥瑞金	600	2,964.00	0.00
167	002281	光迅科技	100	2,904.00	0.00
168	000519	中兵红箭	289	2,895.78	0.00
169	600056	中国医药	200	2,866.00	0.00
170	601098	中南传媒	300	2,859.00	0.00
171	600021	上海电力	400	2,848.00	0.00
172	000970	中科三环	300	2,835.00	0.00
173	002294	信立泰	100	2,833.00	0.00
174	000400	许继电气	195	2,819.70	0.00
175	600094	大名城	700	2,814.00	0.00
176	000078	海王生物	700	2,807.00	0.00
177	600348	华阳股份	500	2,805.00	0.00
178	600171	上海贝岭	200	2,804.00	0.00
179	000528	柳工	380	2,796.80	0.00
180	000877	天山股份	185	2,793.50	0.00
181	600435	北方导航	310	2,790.00	0.00
182	600970	中材国际	405	2,786.40	0.00
183	002191	劲嘉股份	300	2,769.00	0.00
184	000967	盈峰环境	340	2,767.60	0.00
185	002244	滨江集团	600	2,754.00	0.00
186	600126	杭钢股份	520	2,750.80	0.00
187	300257	开山股份	200	2,730.00	0.00
188	601718	际华集团	900	2,727.00	0.00
189	600216	浙江医药	200	2,720.00	0.00
190	600039	四川路桥	600	2,706.00	0.00
191	000758	中色股份	532	2,702.56	0.00
192	002249	大洋电机	600	2,700.00	0.00
193	002268	卫士通	160	2,672.00	0.00
194	600064	南京高科	260	2,670.20	0.00
195	600388	龙净环保	300	2,664.00	0.00
196	600266	城建发展	520	2,641.60	0.00
197	600486	扬农化工	20	2,640.00	0.00
198	002174	游族网络	200	2,632.00	0.00
199	002505	鹏都农牧	1,040	2,631.20	0.00
200	000999	华润三九	105	2,618.70	0.00
201	002183	怡亚通	600	2,616.00	0.00
202	002603	以岭药业	102	2,601.00	0.00
203	002203	海亮股份	347	2,564.33	0.00
204	000089	深圳机场	310	2,532.70	0.00
205	300009	安科生物	172	2,524.96	0.00

206	603883	老百姓	40	2,513.20	0.00
207	000988	华工科技	108	2,504.52	0.00
208	000031	大悦城	566	2,490.40	0.00
209	300207	欣旺达	81	2,487.51	0.00
210	002155	湖南黄金	292	2,484.92	0.00
211	002583	海能达	400	2,456.00	0.00
212	600801	华新水泥	119	2,454.97	0.00
213	002458	益生股份	220	2,453.00	0.00
214	600158	中体产业	200	2,452.00	0.00
215	600160	巨化股份	300	2,433.00	0.00
216	300166	东方国信	220	2,409.00	0.00
217	002511	中顺洁柔	115	2,400.05	0.00
218	600717	天津港	502	2,399.56	0.00
219	000739	普洛药业	103	2,397.84	0.00
220	002640	跨境通	466	2,395.24	0.00
221	000028	国药一致	52	2,381.60	0.00
222	002010	传化智联	500	2,355.00	0.00
223	002396	星网锐捷	100	2,306.00	0.00
224	002092	中泰化学	370	2,275.50	0.00
225	603885	吉祥航空	200	2,274.00	0.00
226	300285	国瓷材料	50	2,255.50	0.00
227	600823	世茂股份	485	2,235.85	0.00
228	600141	兴发集团	200	2,206.00	0.00
229	002317	众生药业	200	2,204.00	0.00
230	600195	中牧股份	171	2,190.51	0.00
231	601611	中国核建	300	2,184.00	0.00
232	300113	顺网科技	126	2,160.90	0.00
233	600312	平高电气	300	2,142.00	0.00
234	000717	韶钢松山	500	2,135.00	0.00
235	600808	马钢股份	800	2,128.00	0.00
236	300324	旋极信息	500	2,115.00	0.00
237	601106	中国一重	700	2,093.00	0.00
238	002589	瑞康医药	400	2,092.00	0.00
239	600073	上海梅林	200	2,058.00	0.00
240	601958	金钼股份	328	2,036.88	0.00
241	600392	盛和资源	229	2,035.81	0.00
242	000008	神州高铁	800	2,032.00	0.00
243	000090	天健集团	340	2,019.60	0.00
244	600373	中文传媒	200	2,018.00	0.00
245	000046	泛海控股	600	1,968.00	0.00
246	600748	上实发展	400	1,964.00	0.00
247	600835	上海机电	100	1,946.00	0.00

248	300244	迪安诊断	56	1,919.68	0.00
249	000061	农产品	271	1,910.55	0.00
250	000581	威孚高科	81	1,878.39	0.00
251	002002	鸿达兴业	618	1,854.00	0.00
252	601865	福莱特	46	1,835.40	0.00
253	600545	卓郎智能	500	1,750.00	0.00
254	600633	浙数文化	212	1,725.68	0.00
255	002635	安洁科技	100	1,723.00	0.00
256	002399	海普瑞	100	1,722.00	0.00
257	000156	华数传媒	200	1,712.00	0.00
258	002156	通富微电	67	1,691.08	0.00
259	002038	双鹭药业	167	1,686.70	0.00
260	000937	冀中能源	400	1,664.00	0.00
261	600959	江苏有线	500	1,655.00	0.00
262	000158	常山北明	265	1,643.00	0.00
263	000826	启迪环境	240	1,622.40	0.00
264	002920	德赛西威	19	1,598.66	0.00
265	600410	华胜天成	180	1,594.80	0.00
266	002048	宁波华翔	102	1,588.14	0.00
267	002013	中航机电	137	1,568.65	0.00
268	600062	华润双鹤	127	1,522.73	0.00
269	000543	皖能电力	360	1,504.80	0.00
270	600291	西水股份	262	1,485.54	0.00
271	600675	中华企业	440	1,478.40	0.00
272	600259	广晟有色	49	1,478.33	0.00
273	601139	深圳燃气	200	1,448.00	0.00
274	002815	崇达技术	100	1,444.00	0.00
275	600022	山东钢铁	1,000	1,430.00	0.00
276	002572	索菲亚	55	1,424.50	0.00
277	002387	维信诺	123	1,402.20	0.00
278	600648	外高桥	100	1,397.00	0.00
279	600575	淮河能源	600	1,392.00	0.00
280	601228	广州港	400	1,344.00	0.00
281	002434	万里扬	150	1,338.00	0.00
282	000732	泰禾集团	400	1,308.00	0.00
283	000681	视觉中国	100	1,300.00	0.00
284	002867	周大生	48	1,279.20	0.00
285	600643	爱建集团	167	1,255.84	0.00
286	600315	上海家化	36	1,250.28	0.00
287	600639	浦东金桥	100	1,240.00	0.00
288	601168	西部矿业	100	1,238.00	0.00
289	600350	山东高速	200	1,236.00	0.00

290	603328	依顿电子	155	1,232.25	0.00
291	600008	首创股份	435	1,231.05	0.00
292	600640	号百控股	100	1,225.00	0.00
293	000898	鞍钢股份	400	1,216.00	0.00
294	600657	信达地产	300	1,215.00	0.00
295	300180	华峰超纤	204	1,205.64	0.00
296	601200	上海环境	110	1,199.00	0.00
297	600277	亿利洁能	400	1,196.00	0.00
298	000990	诚志股份	100	1,186.00	0.00
299	000501	鄂武商 A	100	1,165.00	0.00
300	600985	淮北矿业	100	1,119.00	0.00
301	600901	江苏租赁	200	1,102.00	0.00
302	600718	东软集团	100	1,041.00	0.00
303	601003	柳钢股份	200	1,038.00	0.00
304	300134	大富科技	100	1,033.00	0.00
305	600673	东阳光	200	1,006.00	0.00
306	600875	东方电气	100	997.00	0.00
307	600649	城投控股	181	982.83	0.00
308	600737	中粮糖业	100	968.00	0.00
309	601801	皖新传媒	200	950.00	0.00
310	000537	广宇发展	147	921.69	0.00
311	603515	欧普照明	30	906.30	0.00
312	603228	景旺电子	30	904.50	0.00
313	000600	建投能源	159	891.99	0.00
314	002138	顺络电子	36	882.72	0.00
315	600260	凯乐科技	80	872.00	0.00
316	000685	中山公用	104	863.20	0.00
317	000039	中集集团	57	854.43	0.00
318	002221	东华能源	83	841.62	0.00
319	002440	闰土股份	86	801.52	0.00
320	000553	安道麦 A	100	782.00	0.00
321	000564	供销大集	300	777.00	0.00
322	603379	三美股份	40	764.00	0.00
323	002375	亚厦股份	100	744.00	0.00
324	600507	方大特钢	100	694.00	0.00
325	600120	浙江东方	116	692.52	0.00
326	600755	厦门国贸	100	668.00	0.00
327	600325	华发股份	100	621.00	0.00
328	601969	海南矿业	100	598.00	0.00
329	600820	隧道股份	100	541.00	0.00
330	600863	内蒙华电	200	514.00	0.00
331	600787	中储股份	111	511.71	0.00

332	002653	海思科	29	508.08	0.00
333	601118	海南橡胶	100	482.00	0.00
334	600572	康恩贝	100	471.00	0.00
335	601179	中国西电	100	461.00	0.00
336	600869	远东股份	100	399.00	0.00
337	000012	南玻A	50	369.00	0.00
338	600664	哈药股份	111	354.09	0.00
339	600645	中源协和	17	333.37	0.00
340	600307	酒钢宏兴	200	330.00	0.00
341	600376	首开股份	54	316.98	0.00
342	600339	中油工程	100	308.00	0.00
343	600582	天地科技	100	308.00	0.00
344	300357	我武生物	4	306.80	0.00
345	601966	玲珑轮胎	7	246.19	0.00
346	603568	伟明环保	10	189.30	0.00
347	002424	贵州百灵	19	148.77	0.00
348	000415	渤海租赁	43	103.20	0.00
349	002831	裕同科技	3	91.86	0.00
350	002051	中工国际	12	85.08	0.00
351	002353	杰瑞股份	2	70.00	0.00
352	002093	国脉科技	5	36.45	0.00
353	600566	济川药业	1	20.23	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 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	002821	凯莱英	52,615,644.62	2.10
2	300012	华测检测	44,136,335.34	1.76
3	300274	阳光电源	41,035,625.36	1.64
4	300253	卫宁健康	40,265,651.76	1.61
5	300207	欣旺达	38,906,460.99	1.55
6	300088	长信科技	37,518,615.00	1.50
7	300285	国瓷材料	37,491,847.92	1.50
8	002127	南极电商	35,742,631.22	1.43
9	000547	航天发展	33,997,964.27	1.36
10	002074	国轩高科	33,803,942.42	1.35
11	002385	大北农	33,639,472.91	1.34
12	002465	海格通信	32,712,806.60	1.31
13	002797	第一创业	32,600,600.80	1.30
14	002185	华天科技	30,824,240.07	1.23
15	002507	涪陵榨菜	30,363,901.05	1.21



16	000636	风华高科	29,685,087.02	1.18
17	002340	格林美	29,426,683.70	1.17
18	002439	启明星辰	29,222,376.39	1.17
19	002131	利欧股份	29,097,391.73	1.16
20	300496	中科创达	28,708,640.79	1.15

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 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	300014	亿纬锂能	2,897,040.61	0.12
2	002384	东山精密	2,410,940.00	0.10
3	002821	凯莱英	2,301,303.00	0.09
4	002129	中环股份	2,184,340.63	0.09
5	300088	长信科技	2,103,486.32	0.08
6	300253	卫宁健康	2,090,506.80	0.08
7	002463	沪电股份	2,078,771.00	0.08
8	002439	启明星辰	2,020,437.30	0.08
9	002065	东华软件	1,960,554.92	0.08
10	002371	北方华创	1,923,126.74	0.08
11	000066	中国长城	1,758,339.34	0.07
12	300383	光环新网	1,751,648.00	0.07
13	002127	南极电商	1,740,905.05	0.07
14	002340	格林美	1,676,454.09	0.07
15	300012	华测检测	1,658,657.04	0.07
16	300207	欣旺达	1,595,434.00	0.06
17	002180	纳思达	1,590,596.20	0.06
18	002049	紫光国微	1,584,174.00	0.06
19	002465	海格通信	1,542,806.00	0.06
20	002812	恩捷股份	1,533,894.30	0.06

#### 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	5,483,618,811.93
卖出股票收入（成交）总额	233,877,232.16

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	4,516,200.00	0.27
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,516,200.00	0.27

### 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	019645	20 国债 15	45,000	4,516,200.00	0.27

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

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 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	嘉实中证 500ETF	股票型	交易型开放式 (ETF)	嘉实基金管理有限公司	1,578,216,902.01	93.83

### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2106	IC2106	6	7,322,880.00	296,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					296,600.00
股指期货投资本期收益（元）					5,497,460.20
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,363,064.00

### 8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货的目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

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

### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.12.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 8.12.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 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

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

#### 8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,768,222.69
2	应收证券清算款	28,510,810.32
3	应收股利	-
4	应收利息	29,746.85
5	应收申购款	2,509,782.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,818,562.69

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500ETF 联接 A	117,405	7,370.05	219,495,582.56	25.37	645,784,736.27	74.63
嘉实中证 500ETF 联接 C	43,016	3,202.14	13,365,154.75	9.70	124,378,124.21	90.30
合计	153,334	6,541.43	232,860,737.31	23.22	770,162,860.48	76.78

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

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

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	528,713.33	0.06
	嘉实中证 500ETF 联接 C	13,153.06	0.01
	合计	541,866.39	0.05

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日 (2013 年 3 月 22 日) 基金份额总额	292,915,388.83	-
本报告期期初基金份额总额	1,461,515,115.79	378,476,246.47
本报告期基金总申购份额	871,908,076.39	713,229,198.65
减：本报告期基金总赎回份额	1,468,142,873.35	953,962,166.16
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	865,280,318.83	137,743,278.96

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

2020 年 4 月 8 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

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

2020 年 6 月 19 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 8 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

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

### 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	
广发证券股份有限公司	3	4,369,874,292.88	76.46%	2,772,445.66	75.29%	-
北京高华证券有限	1	803,904,652.24	14.07%	562,735.53	15.28%	-

责任公司						
兴业证券 股份有限 公司	1	268,765,447.52	4.70%	169,670.68	4.61%	-
西部证券 股份有限 公司	1	111,452,038.10	1.95%	70,362.27	1.91%	-
光大证券 股份有限 公司	1	86,914,587.86	1.52%	54,870.45	1.49%	-
华泰证券 股份有限 公司	1	55,810,197.04	0.98%	39,067.19	1.06%	-
中信建投 证券股份 有限公司	2	18,574,325.13	0.32%	13,002.15	0.35%	-
财信证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限	1	-	-	-	-	-

公司						
中信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

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。

## 3. 财富证券有限责任公司更名为财信证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：西部证券股份有限公司新增交易单元 1 个，广发证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

## 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券股份有限公司	42,237,125.00	23.91%	-	-	-	-	8,293,894,394.97	100.00%
北京高华证券有限责任公司	4,083,907.00	2.31%	1,715,700,000.00	98.62%	-	-	-	-



兴业 证券 股份 有限 公司	73,046,854.70	41.35%	24,000,000.00	1.38%	-	-	-	-
西部 证券 股份 有限 公司	26,482,276.40	14.99%	-	-	-	-	-	-
光大 证券 股份 有限 公司	23,601,323.50	13.36%	-	-	-	-	-	-
华泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券 股份 有限 公司	6,193,800.00	3.51%	-	-	-	-	-	-
财信 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券 股份	-	-	-	-	-	-	-	-

有限公司								
申万宏源证券有限公司	999,200.00	0.57%						
中信证券股份有限公司								

### 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	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月22日
2	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月02日
3	关于嘉实中证 500ETF 联接基金基金合同等文件的更正公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年05月22日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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

**嘉实基金管理有限公司**

**2021 年 3 月 30 日**