

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	57
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.13 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	66
§ 11 备查文件目录	66
11.1 备查文件目录	66
11.2 存放地点	66
11.3 查阅方式	67

§ 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	1,082,778,456.07 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	嘉实中证 500ETF 联 接 I	嘉实中证 500ETF 联 接 Y
下属分级基金的交 易代码	000008	070039	021887	022915
报告期末下属分级 基金的份额总额	870,296,848.42 份	208,495,691.57 份	2,117,524.15 份	1,868,391.93 份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。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。 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析

	和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。 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。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%。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。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
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	郭松	王小飞
	联系电话	(010)65215588	021-60637103

	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637228
传真		(010)65215588	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 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		100020	100033
法定代表人		经雷	张金良

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)			
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 I	嘉实中证 500ETF 联接 Y
本期已实现收益	-6,095,612.46	-1,673,416.26	-12,682.22	-10,147.22
本期利润	62,904,838.62	13,775,018.52	96,432.36	141,439.45
加权平均基金份额	0.0702	0.0654	0.0451	0.0929
本期利润				
本期加权	4.18%	5.04%	3.46%	5.50%

平均净值 利润率				
本期基金 份额净值 增长率	4.21%	4.01%	4.16%	4.22%
3.1.2 期末数 据和指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)			
期末可供 分配利润	642,526,041.13	71,507,754.37	736,124.31	1,396,574.17
期末可供 分配基金 份额利润	0.7383	0.3430	0.3476	0.7475
期末基金 资产净值	1,512,822,889.55	280,003,445.94	2,853,648.46	3,264,966.10
期末基金 份额净值	1.7383	1.3430	1.3476	1.7475
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)			
基金份额 累计净值 增长率	82.76%	34.30%	20.90%	0.43%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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
过去一个月	4.79%	0.73%	4.09%	0.75%	0.70%	-0.02%

过去三个月	1.99%	1.42%	0.97%	1.43%	1.02%	-0.01%
过去六个月	4.21%	1.28%	3.21%	1.29%	1.00%	-0.01%
过去一年	19.80%	1.62%	18.83%	1.64%	0.97%	-0.02%
过去三年	-3.76%	1.27%	-7.61%	1.29%	3.85%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	82.76%	1.48%	65.06%	1.49%	17.70%	-0.01%

嘉实中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.75%	0.73%	4.09%	0.75%	0.66%	-0.02%
过去三个月	1.89%	1.42%	0.97%	1.43%	0.92%	-0.01%
过去六个月	4.01%	1.28%	3.21%	1.29%	0.80%	-0.01%
过去一年	19.32%	1.62%	18.83%	1.64%	0.49%	-0.02%
过去三年	-4.91%	1.27%	-7.61%	1.29%	2.70%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	34.30%	1.33%	25.01%	1.33%	9.29%	0.00%

嘉实中证 500ETF 联接 I

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.77%	0.73%	4.09%	0.75%	0.68%	-0.02%
过去三个月	1.96%	1.42%	0.97%	1.43%	0.99%	-0.01%
过去六个月	4.16%	1.28%	3.21%	1.29%	0.95%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	20.90%	1.64%	20.33%	1.66%	0.57%	-0.02%

嘉实中证 500ETF 联接 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.79%	0.73%	4.09%	0.75%	0.70%	-0.02%
过去三个月	1.99%	1.42%	0.97%	1.43%	1.02%	-0.01%

过去六个月	4.22%	1.28%	3.21%	1.29%	1.01%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	0.43%	1.27%	-1.09%	1.28%	1.52%	-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：

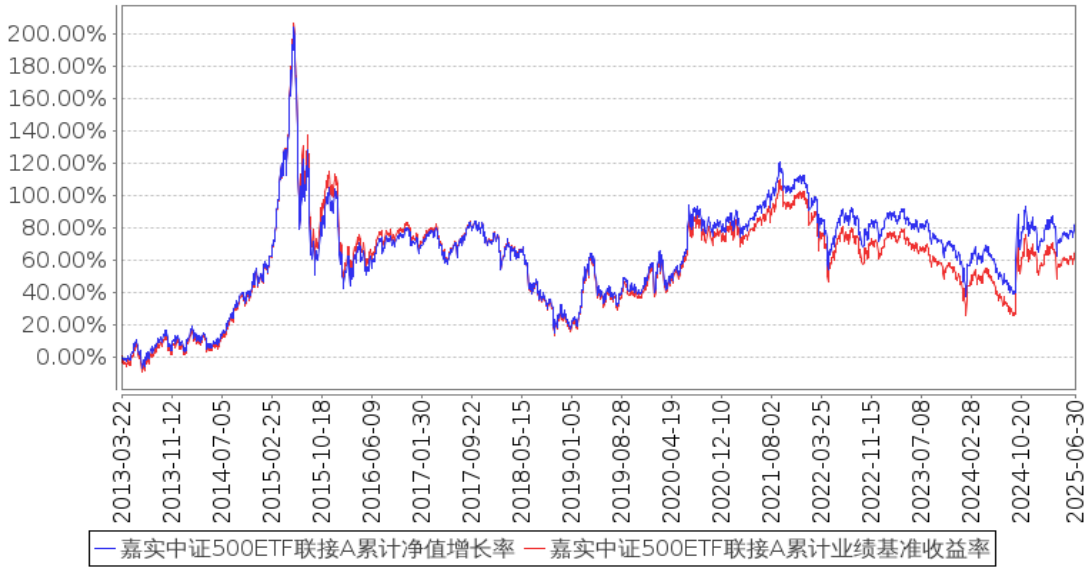
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{中证 500 指数收益率}(t)+5\% \times ((1+\text{银行活期存款税后利率})^{1/365}-1)$$

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

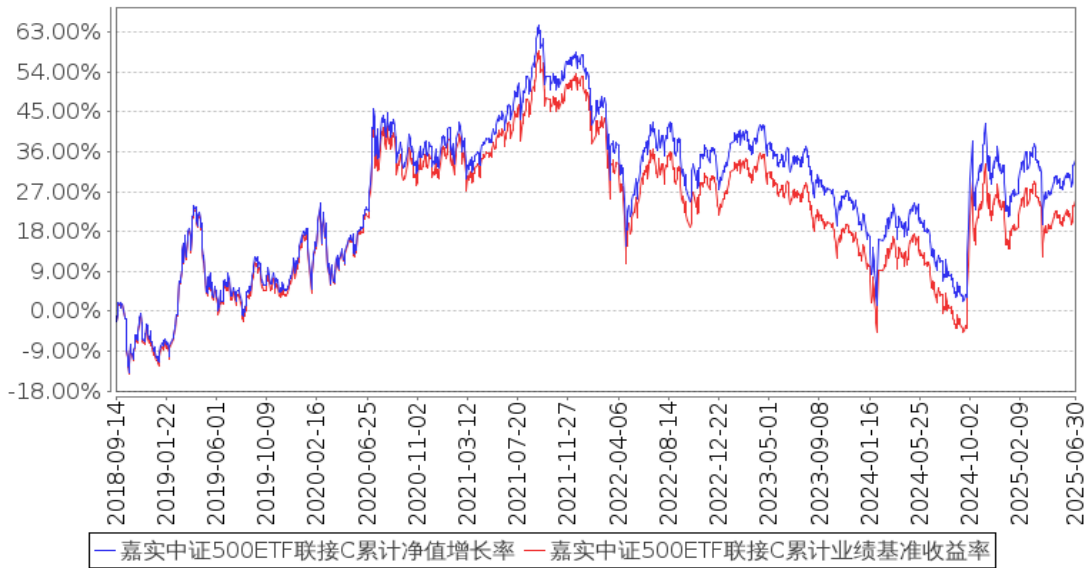
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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2025年06月30日)



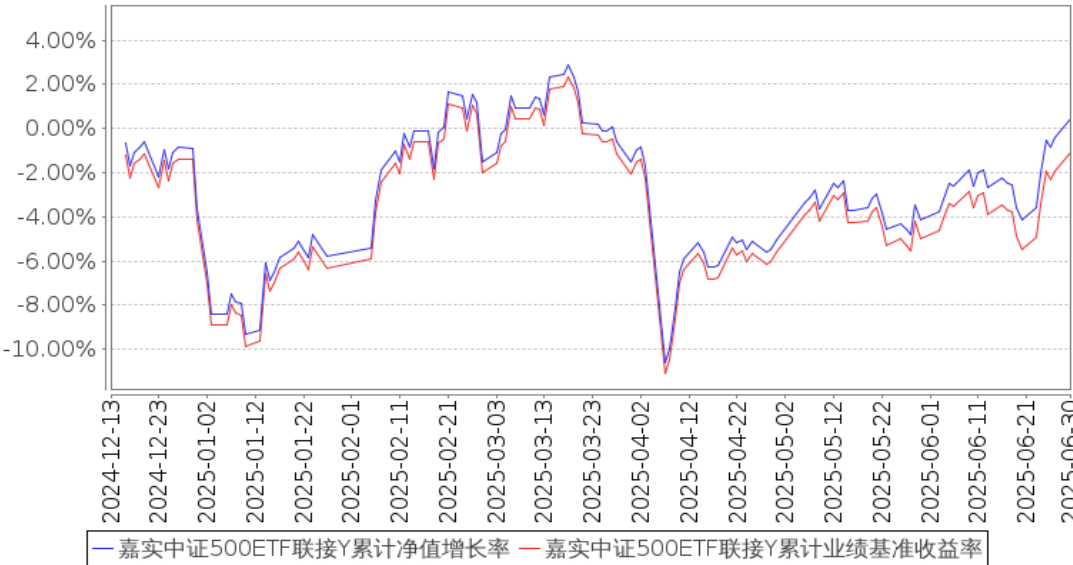
嘉实中证500ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年09月14日至2025年06月30日)



嘉实中证500ETF联接I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
(2024年07月18日至2025年06月30日)



嘉实中证500ETF联接Y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
(2024年12月13日至2025年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月为建仓期，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。

3.3 其他指标

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。

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 和特定资产管理业务等资格。

截止 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实国证通信ETF发起联接、嘉实中证A50ETF联接基金经理	2016年1月5日	-	19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，现任指数基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
李直	本基金、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证500ETF、嘉实基本面50ETF、	2021年9月24日	-	10年	2014年7月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	嘉实中证大农业ETF、嘉实中证科创创业50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业50ETF发起联接、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实中证2000ETF、嘉实中证大农业ETF发起联接、嘉实中证A100ETF、嘉实中证A100ETF发起联接基金经理				
--	---	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李直	公募基金	15	18,361,443,852.58	2017年12月26日
	私募资产管理计划	1	10,267,722.49	2025年5月12日
	其他组合	-	-	-
	合计	16	18,371,711,575.07	-

注：1. “任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间；

2. 报告期内，李直管理的 1 只公募基金已于 2025 年 5 月 17 日离任。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金标的指数为中证小盘 500 指数，中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金的投资策略为通过投资于目标 ETF 实现基金投资目标。

回顾上半年，外部扰动不断，但宏观经济复苏进程仍在持续推进。一季度关税预期压制进出口贸易，但政策持续发力推动部分产业景气度修复，战略性新兴产业尤为突出。4、5 月超预期关税的落地造成了较大冲击，货币政策的进一步宽松和社融改善推动内需结构性改善，高新技术产品出口及高技术制造业增加值大幅提升。总体来看，上半年增量政策效果逐步显现，高新技术产品成为经济发展新动能。海外方面，美国经济的表现极大地影响了降息进程和市场对未来利率水平的预期。1、2 月虽然也有关税不确定性的影响，但美国经济数据总体表现较为积极，美联储对

通胀表示关注，3 月并未继续降息。进入二季度，通胀仍未明显下降，同时劳动力市场较为坚挺，5 月平均周薪创历史新高，6 月非农就业超预期，美联储降息预期不断延后。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.38%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 4.00%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值为 1.7383 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.21%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.3430 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.01%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 I 基金份额净值为 1.3476 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.16%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 Y 基金份额净值为 1.7475 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.22%；业绩比较基准收益率为 3.21%。

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。展望下半年，积极的总量政策仍将持续，货币和社融同比增速在低基数的背景下有望保持稳健。随着货币和信贷的宽松推动经济增长、关税等国际贸易冲击逐渐消退，内外需有望相继企稳。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	98,240,314.86	103,767,198.01
结算备付金		2,988,561.42	2,108,135.18
存出保证金		1,485,932.69	1,420,260.17
交易性金融资产	6.4.7.2	1,692,313,959.21	1,725,798,801.76
其中：股票投资		10,113,836.85	920,928.82
基金投资		1,682,200,022.35	1,724,877,872.94

债券投资		100.01	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,461,520.37	1,962,027.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,802,490,288.55	1,835,056,422.64
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.08	0.01
应付赎回款		3,346,727.51	2,387,131.47
应付管理人报酬		14,028.14	15,750.69
应付托管费		4,676.06	5,250.22
应付销售服务费		87,294.94	107,802.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	92,611.77	176,617.65
负债合计		3,545,338.50	2,692,552.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,082,778,456.07	1,148,679,219.80
未分配利润	6.4.7.12	716,166,493.98	683,684,650.28
净资产合计		1,798,944,950.05	1,832,363,870.08
负债和净资产总计		1,802,490,288.55	1,835,056,422.64

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值 1.7383 元，基金份额总额 870,296,848.42 份，嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值 1.3430 元，基金份额总额

208,495,691.57 份,嘉实中证 500ETF 联接 I 基金份额净值 1.3476 元,基金份额总额 2,117,524.15 份,嘉实中证 500ETF 联接 Y 基金份额净值 1.7475 元,基金份额总额 1,868,391.93 份,基金份额总额合计为 1,082,778,456.07 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		77,668,185.82	-182,253,653.69
1. 利息收入		204,355.34	258,787.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	204,355.34	258,787.85
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,477,866.87	-19,367,870.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,197,295.46	1,317,154.54
基金投资收益	6.4.7.15	-10,474,553.69	-19,976,154.93
债券投资收益	6.4.7.16	39.11	846.08
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	696,151.79	-797,371.12
股利收益	6.4.7.20	103,200.46	87,654.79
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	84,709,587.11	-163,373,660.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	232,110.24	229,089.93
减：二、营业总支出		750,456.87	1,149,035.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	90,476.61	108,916.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,158.89	36,305.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	545,740.64	915,281.22

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	84, 080. 73	88, 532. 66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76, 917, 728. 95	-183, 402, 688. 94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76, 917, 728. 95	-183, 402, 688. 94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		76, 917, 728. 95	-183, 402, 688. 94

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 148, 679, 219. 80	-	683, 684, 650. 28	1, 832, 363, 870. 08
二、本期期初净资产	1, 148, 679, 219. 80	-	683, 684, 650. 28	1, 832, 363, 870. 08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65, 900, 763. 73	-	32, 481, 843. 70	-33, 418, 920. 03
（一）、综合收益总额	-	-	76, 917, 728. 95	76, 917, 728. 95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-65, 900, 763. 73	-	-44, 435, 885. 25	-110, 336, 648. 98
其中：1. 基金申购款	298, 783, 514. 32	-	124, 809, 541. 44	423, 593, 055. 76
2. 基金赎回款	-364, 684, 278. 05	-	-169, 245, 426. 69	-533, 929, 704. 74

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,082,778,456.07	-	716,166,493.98	1,798,944,950.05
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,523,671,822.98	-	769,628,656.08	2,293,300,479.06
二、本期期初净资产	1,523,671,822.98	-	769,628,656.08	2,293,300,479.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	84,530,070.63	-	-190,945,354.48	-106,415,283.85
（一）、综合收益总额	-	-	-183,402,688.94	-183,402,688.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	84,530,070.63	-	-7,542,665.54	76,987,405.09
其中：1. 基金申购款	417,316,998.87	-	128,384,722.36	545,701,721.23
2. 基金赎回款	-332,786,928.24	-	-135,927,387.90	-468,714,316.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,608,201,893.61	-	578,683,301.60	2,186,885,195.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 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) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税; 对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税; 自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易

印花税；

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	98,240,314.86
等于：本金	98,230,833.55
加：应计利息	9,481.31
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	98,240,314.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,805,952.52	-	10,113,836.85	307,884.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100.00	0.01	100.01	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100.00	0.01	100.01	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,718,500,196.09	-	1,682,200,022.35	-36,300,173.74
其他		-	-	-	-
合计		1,728,306,248.61	0.01	1,692,313,959.21	-35,992,289.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,126,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,126,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,126,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	10.00	11,551,600.00	424,640.00
合计				424,640.00
减：可抵销期货暂收款				424,640.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,313.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,954.96
其中：交易所市场	9,954.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	92,611.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 500ETF 联接 A

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	926,162,721.37	926,162,721.37
本期申购	96,194,020.25	96,194,020.25
本期赎回（以“-”号填列）	-152,059,893.20	-152,059,893.20
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	870,296,848.42	870,296,848.42

嘉实中证 500ETF 联接 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	219,842,640.45	219,842,640.45
本期申购	200,030,783.87	200,030,783.87
本期赎回（以“-”号填列）	-211,377,732.75	-211,377,732.75
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	208,495,691.57	208,495,691.57

嘉实中证 500ETF 联接 I

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,066,750.17	2,066,750.17
本期申购	1,039,333.26	1,039,333.26
本期赎回（以“-”号填列）	-988,559.28	-988,559.28
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	2,117,524.15	2,117,524.15

嘉实中证 500ETF 联接 Y

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	607,107.81	607,107.81
本期申购	1,519,376.94	1,519,376.94
本期赎回（以“-”号填列）	-258,092.82	-258,092.82

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	1,868,391.93	1,868,391.93

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	1,087,271,877.28	-468,623,878.93	618,647,998.35
本期期初	1,087,271,877.28	-468,623,878.93	618,647,998.35
本期利润	-6,095,612.46	69,000,451.08	62,904,838.62
本期基金份额交易产生的变动数	-65,374,659.30	26,347,863.46	-39,026,795.84
其中：基金申购款	112,626,808.93	-47,937,760.49	64,689,048.44
基金赎回款	-178,001,468.23	74,285,623.95	-103,715,844.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,015,801,605.52	-373,275,564.39	642,526,041.13

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	84,607,485.91	-20,588,828.82	64,018,657.09
本期期初	84,607,485.91	-20,588,828.82	64,018,657.09
本期利润	-1,673,416.26	15,448,434.78	13,775,018.52
本期基金份额交易产生的变动数	-4,319,805.09	-1,966,116.15	-6,285,921.24
其中：基金申购款	76,202,427.68	-17,434,533.24	58,767,894.44
基金赎回款	-80,522,232.77	15,468,417.09	-65,053,815.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,614,264.56	-7,106,510.19	71,507,754.37

嘉实中证 500ETF 联接 I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	800,959.40	-193,836.03	607,123.37
本期期初	800,959.40	-193,836.03	607,123.37
本期利润	-12,682.22	109,114.58	96,432.36
本期基金份额交易产生的变动数	19,899.31	12,669.27	32,568.58
其中：基金申购款	400,402.03	-73,571.15	326,830.88
基金赎回款	-380,502.72	86,240.42	-294,262.30

本期已分配利润	-	-	-
本期末	808,176.49	-72,052.18	736,124.31

嘉实中证 500ETF 联接 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	724,103.27	-313,231.80	410,871.47
本期期初	724,103.27	-313,231.80	410,871.47
本期利润	-10,147.22	151,586.67	141,439.45
本期基金份额交易产生的变动数	1,501,834.63	-657,571.38	844,263.25
其中：基金申购款	1,808,596.21	-782,828.53	1,025,767.68
基金赎回款	-306,761.58	125,257.15	-181,504.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,215,790.68	-819,216.51	1,396,574.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	175,577.94
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	16,221.56
其他	12,555.84
合计	204,355.34

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	306,836.30
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	1,890,459.16
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,197,295.46

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,705,789.09
减：卖出股票成本总额	6,366,010.29
减：交易费用	32,942.50

买卖股票差价收入	306,836.30
----------	------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
申购基金份额总额	99,151,500.00
减：现金支付申购款总额	684,912.09
减：申购股票成本总额	96,576,128.75
减：交易费用	-
申购差价收入	1,890,459.16

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	215,207,220.81
减：卖出/赎回基金成本总额	225,670,956.65
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	10,817.85
基金投资收益	-10,474,553.69

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39.06
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	39.11

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	439.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	400.00
减：应计利息总额	0.04
减：交易费用	0.02
买卖债券差价收入	39.06

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	696,151.79

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	103,200.46
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	103,200.46

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	84,338,517.88
股票投资	495,719.42
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	83,842,798.46
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	371,069.23
权证投资	-
期货投资	371,069.23
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	84,709,587.11

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	218,051.98
基金转出费收入	14,058.26
合计	232,110.24

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,729.95
存托服务费	7.62
合计	84,080.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“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
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	90,476.61	108,916.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	526,226.23	587,242.96
应支付基金管理人的净管理费	-435,749.62	-478,326.90

注：1. 本基金投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的目标 ETF 而调减，因此应支付基金管理人的净管理费为负。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 0.15%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）×0.15%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,158.89	36,305.31

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人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 0.05%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝（前一日的基金资产净值-基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值）（若为负数，则取 0）×0.05%/当年天

数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期				
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 I	嘉实中证 500ETF 联接 Y	合计
嘉实基金管理有限公司	-	39,640.40	1,376.99	-	41,017.39
嘉实财富	-	74,978.03	-	-	74,978.03
合计	-	114,618.43	1,376.99	-	115,995.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间				
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 I	嘉实中证 500ETF 联接 Y	合计
嘉实基金管理有限公司	-	105,771.21	-	-	105,771.21
嘉实财富	-	183,331.40	-	-	183,331.40
合计	-	289,102.61	-	-	289,102.61

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，I 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，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：各类别基金日销售服务费＝各类别基金份额前一日基金资产净值×各类别基金份额适用的销售服务费率/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	98,240,314.86	175,577.94	123,940,651.84	228,039.05

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2025 年 06 月 30 日)，本基金持有 705,236,248.00 份目标 ETF 基金份额(2024 年 12 月 31 日：754,671,803.00 份)，占其总份额的比例为 14.78%(2024 年 12 月 31 日：14.45%)。

6.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日)，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2025 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	1	100.00	100.01	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事项停牌	0.40	-	-	3,600	2,268.00	1,440.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	100.01	-
未评级	-	-
合计	100.01	-

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	98,240,314.86	-	-	-	98,240,314.86
结算备付金	2,988,561.42	-	-	-	2,988,561.42
存出保证金	99,740.69	-	-	1,386,192.00	1,485,932.69
交易性金融资产	-	-	100.01	1,692,313,859.20	1,692,313,959.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,461,520.37	7,461,520.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	101,328,616.97	-	100.01	1,701,161,571.57	1,802,490,288.55
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.08	0.08
应付赎回款	-	-	-	3,346,727.51	3,346,727.51
应付管理人报酬	-	-	-	14,028.14	14,028.14
应付托管费	-	-	-	4,676.06	4,676.06
应付销售服务费	-	-	-	87,294.94	87,294.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	92,611.77	92,611.77
负债总计	-	-	-	3,545,338.50	3,545,338.50
利率敏感度缺口	101,328,616.97	-	100.01	1,697,616,233.07	1,798,944,950.05
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	103,767,198.01	-	-	-	103,767,198.01

结算备付金	2,108,135.18	-	-	-	2,108,135.18
存出保证金	194,373.77	-	-	1,225,886.40	1,420,260.17
交易性金融资产	-	-	-	1,725,798,801.76	1,725,798,801.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,962,027.52	1,962,027.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	106,069,706.96	-	-	1,728,986,715.68	1,835,056,422.64
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	2,387,131.47	2,387,131.47
应付管理人报酬	-	-	-	15,750.69	15,750.69
应付托管费	-	-	-	5,250.22	5,250.22
应付销售服务费	-	-	-	107,802.52	107,802.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	176,617.65	176,617.65
负债总计	-	-	-	2,692,552.56	2,692,552.56
利率敏感度缺口	106,069,706.96	-	-	1,726,294,163.12	1,832,363,870.08

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）

	市场利率上升 25 个基点	-1.43	-
	市场利率下降 25 个基点	1.45	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	10,113,836.85	0.56	920,928.82	0.05
交易性金融资产—基金投资	1,682,200,022.35	93.51	1,724,877,872.94	94.13
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	1,692,313,859.20	94.07	1,725,798,801.76	94.18

6.4.13.4.3.2 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		
分析	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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	89,646,324.97	90,509,014.66
	业绩比较基准下降 5%	-89,646,324.97	-90,509,014.66

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	1,692,312,419.20	1,725,797,361.76
第二层次	100.01	—
第三层次	1,440.00	1,440.00
合计	1,692,313,959.21	1,725,798,801.76

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,113,836.85	0.56
	其中：股票	10,113,836.85	0.56
2	基金投资	1,682,200,022.35	93.33
3	固定收益投资	100.01	0.00
	其中：债券	100.01	0.00
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	101,228,876.28	5.62
8	其他各项资产	8,947,453.06	0.50
9	合计	1,802,490,288.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	24,778.00	0.00
B	采矿业	342,875.50	0.02
C	制造业	6,372,927.20	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	324,755.00	0.02
E	建筑业	84,523.00	0.00
F	批发和零售业	210,122.10	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	170,548.00	0.01
H	住宿和餐饮业	20,280.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,018,729.35	0.06
J	金融业	989,620.10	0.06
K	房地产业	132,726.00	0.01
L	租赁和商务服务业	87,238.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	60,070.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	39,544.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,808.00	0.00
Q	卫生和社会工作	49,584.40	0.00
R	文化、体育和娱乐业	140,285.00	0.01
S	综合	24,423.00	0.00
	合计	10,113,836.85	0.56

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	800	107,504.00	0.01
2	688521	芯原股份	979	94,473.50	0.01
3	688578	艾力斯	943	87,736.72	0.00
4	688213	思特威	800	81,776.00	0.00

5	688220	翱捷科技	862	67,494.60	0.00
6	688361	中科飞测	800	67,352.00	0.00
7	688099	晶晨股份	901	63,980.01	0.00
8	688525	佰维存储	933	62,884.20	0.00
9	000988	华工科技	1,300	61,113.00	0.00
10	300339	润和软件	1,200	60,996.00	0.00
11	603893	瑞芯微	400	60,744.00	0.00
12	688002	睿创微纳	822	57,309.84	0.00
13	689009	九号公司	949	56,152.33	0.00
14	688114	华大智造	858	55,624.14	0.00
15	600988	赤峰黄金	2,200	54,736.00	0.00
16	688582	芯动联科	800	53,760.00	0.00
17	002966	苏州银行	6,000	52,680.00	0.00
18	600839	四川长虹	5,100	49,572.00	0.00
19	002517	恺英网络	2,500	48,275.00	0.00
20	601555	东吴证券	5,500	48,125.00	0.00
21	688122	西部超导	910	47,210.80	0.00
22	601162	天风证券	9,500	46,835.00	0.00
23	002340	格林美	7,200	45,720.00	0.00
24	002850	科达利	400	45,268.00	0.00
25	300251	光线传媒	2,200	44,594.00	0.00
26	688297	中无人机	828	44,215.20	0.00
27	002195	岩山科技	7,800	43,914.00	0.00
28	002156	通富微电	1,700	43,554.00	0.00
29	300207	欣旺达	2,100	42,126.00	0.00
30	002797	第一创业	5,900	41,772.00	0.00
31	600157	永泰能源	31,000	41,540.00	0.00
32	688065	凯赛生物	881	41,495.10	0.00
33	688183	生益电子	800	40,960.00	0.00
34	688385	复旦微电	829	40,844.83	0.00
35	002261	拓维信息	1,300	40,235.00	0.00
36	002558	巨人网络	1,700	40,035.00	0.00
37	002273	水晶光电	2,000	39,940.00	0.00
38	600879	航天电子	3,800	39,786.00	0.00
39	600487	亨通光电	2,600	39,780.00	0.00
40	300450	先导智能	1,600	39,760.00	0.00
41	002281	光迅科技	800	39,456.00	0.00
42	300803	指南针	485	39,120.10	0.00
43	688777	中控技术	868	38,981.88	0.00
44	000066	中国长城	2,600	38,480.00	0.00
45	002294	信立泰	800	37,864.00	0.00
46	300454	深信服	400	37,672.00	0.00
47	600885	宏发股份	1,680	37,480.80	0.00

48	600536	中国软件	800	37,416.00	0.00
49	600096	云天化	1,700	37,349.00	0.00
50	601099	太平洋	9,400	36,942.00	0.00
51	601168	西部矿业	2,200	36,586.00	0.00
52	300017	网宿科技	3,400	36,448.00	0.00
53	601108	财通证券	4,600	36,386.00	0.00
54	002465	海格通信	2,600	36,244.00	0.00
55	600352	浙江龙盛	3,500	35,560.00	0.00
56	002821	凯莱英	400	35,300.00	0.00
57	000933	神火股份	2,100	34,944.00	0.00
58	601128	常熟银行	4,700	34,639.00	0.00
59	300857	协创数据	400	34,424.00	0.00
60	002185	华天科技	3,400	34,340.00	0.00
61	601577	长沙银行	3,400	33,796.00	0.00
62	002138	顺络电子	1,200	33,744.00	0.00
63	688561	奇安信	992	33,708.16	0.00
64	600079	人福医药	1,600	33,568.00	0.00
65	002085	万丰奥威	2,100	33,369.00	0.00
66	000783	长江证券	4,800	33,264.00	0.00
67	603605	珀莱雅	400	33,116.00	0.00
68	688469	芯联集成	6,894	32,884.38	0.00
69	000831	中国稀土	900	32,508.00	0.00
70	603345	安井食品	400	32,168.00	0.00
71	300458	全志科技	800	31,752.00	0.00
72	002532	天山铝业	3,800	31,578.00	0.00
73	688180	君实生物	925	31,431.50	0.00
74	601933	永辉超市	6,400	31,360.00	0.00
75	600862	中航高科	1,200	31,296.00	0.00
76	002130	沃尔核材	1,300	30,966.00	0.00
77	300058	蓝色光标	4,720	30,963.20	0.00
78	600895	张江高科	1,200	30,840.00	0.00
79	600109	国金证券	3,500	30,695.00	0.00
80	300002	神州泰岳	2,600	30,680.00	0.00
81	000034	神州数码	800	30,112.00	0.00
82	300383	光环新网	2,100	30,030.00	0.00
83	000021	深科技	1,600	29,984.00	0.00
84	002673	西部证券	3,800	29,944.00	0.00
85	600143	金发科技	2,900	29,899.00	0.00
86	002202	金风科技	2,900	29,725.00	0.00
87	002078	太阳纸业	2,200	29,612.00	0.00
88	300919	中伟股份	900	29,592.00	0.00
89	002008	大族激光	1,200	29,244.00	0.00
90	300024	机器人	1,700	29,206.00	0.00

91	300474	景嘉微	400	29,200.00	0.00
92	000997	新大陆	900	29,142.00	0.00
93	002436	兴森科技	2,200	29,128.00	0.00
94	300136	信维通信	1,300	29,120.00	0.00
95	002155	湖南黄金	1,630	29,095.50	0.00
96	601198	东兴证券	2,600	28,990.00	0.00
97	002738	中矿资源	900	28,944.00	0.00
98	688568	中科星图	800	28,808.00	0.00
99	002065	东华软件	3,000	28,800.00	0.00
100	601615	明阳智能	2,500	28,725.00	0.00
101	002223	鱼跃医疗	800	28,480.00	0.00
102	600580	卧龙电驱	1,440	28,468.80	0.00
103	603160	汇顶科技	400	28,412.00	0.00
104	002410	广联达	2,100	28,161.00	0.00
105	300037	新宙邦	800	28,160.00	0.00
106	600298	安琪酵母	800	28,136.00	0.00
107	002353	杰瑞股份	800	28,000.00	0.00
108	300751	迈为股份	400	27,824.00	0.00
109	300115	长盈精密	1,300	27,820.00	0.00
110	600873	梅花生物	2,600	27,794.00	0.00
111	300223	北京君正	400	27,680.00	0.00
112	600060	海信视像	1,200	27,624.00	0.00
113	000728	国元证券	3,500	27,615.00	0.00
114	600171	上海贝岭	800	27,400.00	0.00
115	600549	厦门钨业	1,300	27,196.00	0.00
116	000426	兴业银锡	1,700	26,860.00	0.00
117	002472	双环传动	800	26,792.00	0.00
118	688676	金盘科技	800	26,760.00	0.00
119	600392	盛和资源	2,000	26,340.00	0.00
120	000519	中兵红箭	1,200	26,268.00	0.00
121	601216	君正集团	4,700	25,944.00	0.00
122	600153	建发股份	2,500	25,925.00	0.00
123	688249	晶合集成	1,276	25,864.52	0.00
124	000729	燕京啤酒	2,000	25,860.00	0.00
125	300054	鼎龙股份	900	25,812.00	0.00
126	002624	完美世界	1,700	25,789.00	0.00
127	300012	华测检测	2,200	25,718.00	0.00
128	002414	高德红外	2,500	25,625.00	0.00
129	000878	云南铜业	2,000	25,440.00	0.00
130	300699	光威复材	800	25,336.00	0.00
131	300346	南大光电	800	25,312.00	0.00
132	601665	齐鲁银行	4,000	25,280.00	0.00
133	600562	国睿科技	800	25,192.00	0.00

134	002007	华兰生物	1,600	25,072.00	0.00
135	000738	航发控制	1,200	24,900.00	0.00
136	000750	国海证券	6,000	24,720.00	0.00
137	000932	华菱钢铁	5,600	24,640.00	0.00
138	600673	东阳光	2,100	24,423.00	0.00
139	603659	璞泰来	1,300	24,414.00	0.00
140	601997	贵阳银行	3,900	24,336.00	0.00
141	300567	精测电子	400	24,244.00	0.00
142	601990	南京证券	3,000	24,240.00	0.00
143	301536	星辰科技	400	24,120.00	0.00
144	000893	亚钾国际	800	24,112.00	0.00
145	600369	西南证券	5,500	23,925.00	0.00
146	300623	捷捷微电	800	23,840.00	0.00
147	300573	兴齐眼药	460	23,823.40	0.00
148	002837	英维克	800	23,768.00	0.00
149	002595	豪迈科技	400	23,688.00	0.00
150	600398	海澜之家	3,400	23,664.00	0.00
151	601696	中银证券	2,200	23,518.00	0.00
152	300003	乐普医疗	1,700	23,426.00	0.00
153	600363	联创光电	400	23,332.00	0.00
154	601233	桐昆股份	2,200	23,320.00	0.00
155	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.00
156	600486	扬农化工	400	23,200.00	0.00
157	300558	贝达药业	400	23,180.00	0.00
158	300142	沃森生物	2,100	23,100.00	0.00
159	603728	鸣志电器	400	22,988.00	0.00
160	002444	巨星科技	900	22,959.00	0.00
161	300763	锦浪科技	400	22,956.00	0.00
162	300496	中科创达	400	22,888.00	0.00
163	600118	中国卫星	800	22,856.00	0.00
164	002152	广电运通	1,700	22,848.00	0.00
165	600699	均胜电子	1,300	22,672.00	0.00
166	600704	物产中大	4,300	22,661.00	0.00
167	600521	华海药业	1,200	22,356.00	0.00
168	600497	驰宏锌锗	4,200	22,218.00	0.00
169	000009	中国宝安	2,500	22,200.00	0.00
169	605589	圣泉集团	800	22,200.00	0.00
170	600909	华安证券	3,800	22,154.00	0.00
171	603596	伯特利	420	22,129.80	0.00
172	002044	美年健康	4,300	22,102.00	0.00
173	600132	重庆啤酒	400	22,040.00	0.00
174	600765	中航重机	1,300	21,944.00	0.00
175	603087	甘李药业	400	21,912.00	0.00

176	600177	雅戈尔	3,000	21,900.00	0.00
177	002409	雅克科技	400	21,876.00	0.00
178	300724	捷佳伟创	400	21,720.00	0.00
179	600637	东方明珠	2,900	21,663.00	0.00
180	002958	青农商行	6,000	21,660.00	0.00
181	603129	春风动力	100	21,650.00	0.00
182	601717	郑煤机	1,300	21,606.00	0.00
183	300001	特锐德	900	21,573.00	0.00
184	000623	吉林敖东	1,260	21,357.00	0.00
185	003031	中瓷电子	400	21,284.00	0.00
186	000887	中鼎股份	1,200	21,108.00	0.00
187	688349	三一重能	846	21,099.24	0.00
188	000423	东阿阿胶	400	20,920.00	0.00
189	600155	华创云信	3,000	20,880.00	0.00
190	300285	国瓷材料	1,200	20,820.00	0.00
191	002607	中公教育	6,800	20,808.00	0.00
192	300373	扬杰科技	400	20,760.00	0.00
193	603606	东方电缆	400	20,684.00	0.00
194	300765	新诺威	400	20,676.00	0.00
195	002025	航天电器	400	20,564.00	0.00
196	002568	百润股份	800	20,488.00	0.00
197	300395	菲利华	400	20,440.00	0.00
198	603816	顾家家居	800	20,416.00	0.00
199	600435	北方导航	1,300	20,267.00	0.00
200	000528	柳 工	2,100	20,181.00	0.00
201	300487	蓝晓科技	400	20,120.00	0.00
202	603298	杭叉集团	960	20,112.00	0.00
203	002851	麦格米特	400	20,056.00	0.00
204	000733	振华科技	400	20,020.00	0.00
205	600901	江苏金租	3,300	19,998.00	0.00
206	000415	渤海租赁	6,000	19,980.00	0.00
207	300676	华大基因	400	19,908.00	0.00
208	000960	锡业股份	1,300	19,890.00	0.00
209	600884	杉杉股份	2,100	19,866.00	0.00
210	600763	通策医疗	480	19,814.40	0.00
211	000039	中集集团	2,500	19,650.00	0.00
212	300627	华测导航	560	19,600.00	0.00
213	000400	许继电气	900	19,593.00	0.00
214	603939	益丰药房	800	19,576.00	0.00
215	300748	金力永磁	820	19,548.80	0.00
216	002739	万达电影	1,700	19,431.00	0.00
217	002653	海思科	458	19,336.76	0.00
218	603379	三美股份	400	19,248.00	0.00

219	002385	大北农	4,700	18,988.00	0.00
220	603338	浙江鼎力	400	18,960.00	0.00
221	688728	格科微	1,230	18,942.00	0.00
222	600498	烽火通信	900	18,927.00	0.00
223	600863	内蒙华电	4,600	18,906.00	0.00
224	603179	新泉股份	400	18,788.00	0.00
225	002926	华西证券	2,100	18,774.00	0.00
226	002318	久立特材	800	18,712.00	0.00
227	605358	立昂微	800	18,640.00	0.00
228	000723	美锦能源	4,300	18,576.00	0.00
228	603979	金诚信	400	18,576.00	0.00
229	600141	兴发集团	900	18,477.00	0.00
230	600312	平高电气	1,200	18,468.00	0.00
231	002312	川发龙蟒	1,600	18,368.00	0.00
232	600820	隧道股份	3,000	18,300.00	0.00
233	300679	电连技术	400	18,152.00	0.00
234	600008	首创环保	6,000	18,120.00	0.00
235	688538	和辉光电	7,742	18,116.28	0.00
236	300604	长川科技	400	17,964.00	0.00
237	001696	宗申动力	800	17,960.00	0.00
238	300144	宋城演艺	2,100	17,955.00	0.00
239	601179	中国西电	2,900	17,806.00	0.00
240	600208	衢州发展	6,000	17,760.00	0.00
241	600529	山东药玻	800	17,712.00	0.00
242	300957	贝泰妮	400	17,688.00	0.00
243	600380	健康元	1,600	17,648.00	0.00
244	000703	恒逸石化	3,000	17,640.00	0.00
245	600516	方大炭素	3,800	17,632.00	0.00
246	600166	福田汽车	6,500	17,615.00	0.00
247	002939	长城证券	2,100	17,598.00	0.00
248	600021	上海电力	2,000	17,580.00	0.00
249	600998	九州通	3,415	17,553.10	0.00
250	300073	当升科技	400	17,548.00	0.00
251	002203	海亮股份	1,700	17,544.00	0.00
252	002500	山西证券	3,000	17,520.00	0.00
253	600390	五矿资本	3,000	17,490.00	0.00
254	600170	上海建工	7,300	17,447.00	0.00
255	300212	易华录	800	17,408.00	0.00
256	300888	稳健医疗	420	17,262.00	0.00
257	300529	健帆生物	800	17,256.00	0.00
258	002064	华峰化学	2,600	17,186.00	0.00
259	601000	唐山港	4,200	17,052.00	0.00
260	002056	横店东磁	1,200	16,980.00	0.00

261	603737	三棵树	460	16,951.00	0.00
262	603156	养元饮品	800	16,928.00	0.00
263	002603	以岭药业	1,200	16,920.00	0.00
264	000683	博源化工	3,500	16,765.00	0.00
265	603228	景旺电子	400	16,736.00	0.00
266	000591	太阳能	3,800	16,682.00	0.00
267	600859	王府井	1,200	16,668.00	0.00
268	600348	华阳股份	2,500	16,650.00	0.00
269	002262	恩华药业	800	16,624.00	0.00
270	002244	滨江集团	1,700	16,575.00	0.00
271	000636	风华高科	1,200	16,488.00	0.00
272	000830	鲁西化工	1,600	16,480.00	0.00
273	601155	新城控股	1,200	16,416.00	0.00
274	000629	钒钛股份	6,400	16,384.00	0.00
275	600583	海油工程	3,000	16,380.00	0.00
276	600816	建元信托	5,500	16,225.00	0.00
277	603000	人民网	800	16,168.00	0.00
278	601991	大唐发电	5,100	16,167.00	0.00
279	603885	吉祥航空	1,200	16,164.00	0.00
280	688172	燕东微	818	16,081.88	0.00
281	603858	步长制药	990	16,077.60	0.00
282	600095	湘财股份	1,600	16,048.00	0.00
283	000060	中金岭南	3,500	16,030.00	0.00
284	601016	节能风电	5,500	15,895.00	0.00
285	603927	中科软	820	15,858.80	0.00
286	603688	石英股份	450	15,849.00	0.00
287	000155	川能动力	1,600	15,712.00	0.00
288	600499	科达制造	1,600	15,680.00	0.00
289	601611	中国核建	1,700	15,623.00	0.00
290	002080	中材科技	800	15,600.00	0.00
291	601666	平煤股份	2,100	15,561.00	0.00
292	002430	杭氧股份	800	15,536.00	0.00
293	600038	中直股份	400	15,524.00	0.00
294	600004	白云机场	1,700	15,470.00	0.00
295	601880	辽港股份	10,300	15,450.00	0.00
296	600970	中材国际	1,800	15,444.00	0.00
297	600483	福能股份	1,600	15,424.00	0.00
298	002507	涪陵榨菜	1,200	15,348.00	0.00
299	600126	杭钢股份	1,700	15,300.00	0.00
300	603568	伟明环保	800	15,264.00	0.00
301	300390	天华新能	800	15,256.00	0.00
302	002508	老板电器	800	15,208.00	0.00
303	600872	中炬高新	800	15,200.00	0.00

304	000598	兴蓉环境	2,100	15,141.00	0.00
305	600316	洪都航空	400	15,080.00	0.00
306	600663	陆家嘴	1,700	15,062.00	0.00
307	603077	和邦生物	8,600	15,050.00	0.00
308	002984	森麒麟	800	15,000.00	0.00
308	603658	安图生物	400	15,000.00	0.00
309	000563	陕国投 A	4,200	14,994.00	0.00
310	000403	派林生物	820	14,866.60	0.00
311	600271	航天信息	1,600	14,784.00	0.00
312	600985	淮北矿业	1,300	14,742.00	0.00
313	002120	韵达股份	2,200	14,740.00	0.00
314	002423	中粮资本	1,200	14,676.00	0.00
315	601001	晋控煤业	1,200	14,664.00	0.00
316	300146	汤臣倍健	1,300	14,612.00	0.00
317	600325	华发股份	3,000	14,610.00	0.00
318	002432	九安医疗	400	14,572.00	0.00
319	000050	深天马 A	1,700	14,484.00	0.00
320	600655	豫园股份	2,600	14,430.00	0.00
321	000513	丽珠集团	400	14,416.00	0.00
322	000987	越秀资本	2,100	14,406.00	0.00
323	002439	启明星辰	900	14,391.00	0.00
324	000958	电投产融	2,100	14,364.00	0.00
325	600282	南钢股份	3,400	14,280.00	0.00
326	601958	金钼股份	1,300	14,222.00	0.00
327	600131	国网信通	800	14,160.00	0.00
328	600535	天士力	900	14,085.00	0.00
329	000951	中国重汽	800	14,064.00	0.00
330	603589	口子窖	400	13,920.00	0.00
331	002841	视源股份	400	13,840.00	0.00
332	603529	爱玛科技	400	13,760.00	0.00
333	600764	中国海防	400	13,600.00	0.00
334	601866	中远海发	5,500	13,585.00	0.00
335	601333	广深铁路	4,700	13,583.00	0.00
336	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.00
337	600707	彩虹股份	2,100	13,566.00	0.00
337	601918	新集能源	2,100	13,566.00	0.00
338	300070	碧水源	3,000	13,500.00	0.00
339	601456	国联民生	1,300	13,455.00	0.00
340	000027	深圳能源	2,100	13,398.00	0.00
341	600329	达仁堂	400	13,344.00	0.00
342	002756	永兴材料	420	13,335.00	0.00
343	601966	玲珑轮胎	900	13,203.00	0.00
344	600739	辽宁成大	1,200	13,200.00	0.00

345	600582	天地科技	2,200	13,178.00	0.00
346	601212	白银有色	4,200	13,146.00	0.00
347	002429	兆驰股份	3,000	13,140.00	0.00
348	600867	通化东宝	1,600	13,120.00	0.00
349	000559	万向钱潮	1,700	13,005.00	0.00
350	600598	北大荒	900	12,978.00	0.00
351	603650	彤程新材	400	12,860.00	0.00
352	600517	国网英大	2,500	12,750.00	0.00
353	600995	南网储能	1,300	12,714.00	0.00
354	688772	珠海冠宇	887	12,675.23	0.00
355	300595	欧普康视	827	12,628.29	0.00
356	301358	湖南裕能	400	12,476.00	0.00
357	300601	康泰生物	820	12,455.80	0.00
358	600737	中粮糖业	1,300	12,285.00	0.00
359	000709	河钢股份	5,600	12,096.00	0.00
360	002670	国盛金控	800	12,040.00	0.00
361	600968	海油发展	2,900	11,832.00	0.00
362	000967	盈峰环境	1,700	11,815.00	0.00
363	600528	中铁工业	1,600	11,808.00	0.00
363	601098	中南传媒	900	11,808.00	0.00
364	601118	海南橡胶	2,500	11,800.00	0.00
365	600848	上海临港	1,300	11,791.00	0.00
366	600808	马钢股份	3,400	11,730.00	0.00
367	000883	湖北能源	2,600	11,726.00	0.00
368	601231	环旭电子	800	11,704.00	0.00
369	601399	国机重装	3,900	11,700.00	0.00
370	600959	江苏有线	3,400	11,696.00	0.00
371	600578	京能电力	2,600	11,674.00	0.00
372	600511	国药股份	400	11,664.00	0.00
373	603899	晨光股份	400	11,596.00	0.00
374	600906	财达证券	1,700	11,594.00	0.00
375	002773	康弘药业	400	11,588.00	0.00
376	603565	中谷物流	1,200	11,460.00	0.00
377	002299	圣农发展	800	11,432.00	0.00
378	600546	山煤国际	1,300	11,349.00	0.00
379	600258	首旅酒店	800	11,304.00	0.00
380	002572	索菲亚	800	11,208.00	0.00
381	000543	皖能电力	1,600	11,200.00	0.00
381	000739	普洛药业	800	11,200.00	0.00
382	301498	乖宝宠物	100	10,937.00	0.00
383	601608	中信重工	2,500	10,925.00	0.00
384	600871	石化油服	5,600	10,920.00	0.00
385	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.00

386	600685	中船防务	400	10,876.00	0.00
387	600378	昊华科技	400	10,828.00	0.00
388	002266	浙富控股	3,500	10,780.00	0.00
389	000825	太钢不锈	3,000	10,770.00	0.00
390	000062	深圳华强	400	10,744.00	0.00
391	000429	粤高速 A	800	10,664.00	0.00
392	601106	中国一重	3,800	10,640.00	0.00
393	600566	济川药业	400	10,532.00	0.00
394	601636	旗滨集团	2,100	10,521.00	0.00
395	601156	东航物流	800	10,472.00	0.00
396	002153	石基信息	1,200	10,392.00	0.00
397	000785	居然智家	3,400	10,370.00	0.00
398	601598	中国外运	2,100	10,353.00	0.00
399	000921	海信家电	400	10,280.00	0.00
400	603556	海兴电力	400	10,188.00	0.00
401	601928	凤凰传媒	900	10,053.00	0.00
402	688387	信科移动	1,779	10,051.35	0.00
403	300735	光弘科技	400	10,040.00	0.00
404	000537	中绿电	1,200	10,032.00	0.00
405	000582	北部湾港	1,200	9,900.00	0.00
406	600977	中国电影	900	9,648.00	0.00
407	301301	川宁生物	800	9,632.00	0.00
408	600606	绿地控股	5,900	9,617.00	0.00
409	603225	新凤鸣	900	9,585.00	0.00
410	300677	英科医疗	400	9,472.00	0.00
410	600801	华新水泥	800	9,472.00	0.00
411	002831	裕同科技	400	9,368.00	0.00
412	600056	中国医药	900	9,306.00	0.00
413	688363	华熙生物	179	9,191.65	0.00
414	600754	锦江酒店	400	8,976.00	0.00
415	603707	健友股份	800	8,920.00	0.00
416	600925	苏能股份	1,700	8,891.00	0.00
417	688425	铁建重工	2,177	8,882.16	0.00
418	301308	江波龙	100	8,749.00	0.00
419	601568	北元集团	2,100	8,715.00	0.00
420	600688	上海石化	3,000	8,550.00	0.00
421	600361	创新新材	2,100	8,379.00	0.00
422	002372	伟星新材	800	8,288.00	0.00
423	600007	中国国贸	400	8,232.00	0.00
424	603826	坤彩科技	420	8,219.40	0.00
425	600373	中文传媒	800	8,216.00	0.00
426	603290	斯达半导	100	8,127.00	0.00
427	600098	广州发展	1,300	8,125.00	0.00

428	000032	深桑达 A	400	8,092.00	0.00
429	000898	鞍钢股份	3,400	7,888.00	0.00
430	001286	陕西能源	900	7,830.00	0.00
431	601858	中国科传	400	7,780.00	0.00
432	301267	华夏眼科	400	7,668.00	0.00
433	601139	深圳燃气	1,200	7,632.00	0.00
434	601019	山东出版	800	7,576.00	0.00
435	000937	冀中能源	1,300	7,475.00	0.00
436	600062	华润双鹤	400	7,464.00	0.00
437	301165	锐捷网络	120	7,375.20	0.00
438	003035	南网能源	1,600	7,344.00	0.00
439	600339	中油工程	2,200	7,194.00	0.00
440	000959	首钢股份	2,100	7,140.00	0.00
441	601965	中国汽研	400	7,100.00	0.00
442	600295	鄂尔多斯	800	6,968.00	0.00
443	601228	广州港	2,100	6,783.00	0.00
444	600928	西安银行	1,700	6,664.00	0.00
445	002608	江苏国信	900	6,597.00	0.00
446	603233	大参林	400	6,520.00	0.00
447	003022	联泓新科	400	6,332.00	0.00
448	601061	中信金属	800	6,328.00	0.00
449	002563	森马服饰	1,200	6,312.00	0.00
450	600720	中交设计	800	6,184.00	0.00
451	600032	浙江新能	800	6,048.00	0.00
452	600927	永安期货	400	5,924.00	0.00
453	002945	华林证券	400	5,748.00	0.00
454	603786	科博达	100	5,541.00	0.00
455	000539	粤电力 A	1,200	5,448.00	0.00
456	600612	老凤祥	100	4,975.00	0.00
457	300140	节能环保	800	4,936.00	0.00
458	001213	中铁特货	1,200	4,872.00	0.00
459	002461	珠江啤酒	400	4,516.00	0.00
460	603341	龙旗科技	100	4,063.00	0.00
461	600299	安迪苏	400	3,860.00	0.00
462	601158	重庆水务	800	3,712.00	0.00
463	603868	飞科电器	100	3,587.00	0.00
464	601921	浙版传媒	400	3,224.00	0.00
465	600956	新天绿能	400	3,088.00	0.00
466	400174	中天 3	3,600	1,440.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	600418	江淮汽车	962,156.00	0.05
2	688220	翱捷科技	923,766.67	0.05
3	688578	艾力斯	908,814.57	0.05
4	002625	光启技术	899,823.00	0.05
5	688521	芯原股份	877,635.00	0.05
6	688099	晶晨股份	816,696.32	0.04
7	688114	华大智造	773,058.98	0.04
8	603893	瑞芯微	762,769.00	0.04
9	300339	润和软件	735,565.00	0.04
10	688525	佰维存储	715,811.54	0.04
11	300476	胜宏科技	644,187.00	0.04
12	002850	科达利	598,085.00	0.03
13	688002	睿创微纳	586,507.21	0.03
14	689009	九号公司	578,083.80	0.03
15	000988	华工科技	575,776.00	0.03
16	688363	华熙生物	555,937.45	0.03
17	600839	四川长虹	554,073.96	0.03
18	600988	赤峰黄金	539,927.00	0.03
19	688065	凯赛生物	519,966.09	0.03
20	002340	格林美	513,941.00	0.03

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688220	翱捷科技	227,213.46	0.01
2	688114	华大智造	209,837.80	0.01
3	688578	艾力斯	159,667.34	0.01
4	301308	江波龙	142,005.00	0.01
5	688525	佰维存储	134,187.27	0.01
6	688213	思特威	133,232.87	0.01
7	688521	芯原股份	133,140.66	0.01
8	688099	晶晨股份	130,801.23	0.01
9	688617	惠泰医疗	121,968.02	0.01
10	688120	华海清科	111,560.33	0.01
11	688363	华熙生物	110,405.91	0.01
12	688297	中无人机	102,424.08	0.01
13	688072	拓荆科技	99,720.72	0.01
14	688047	龙芯中科	98,451.89	0.01
15	688002	睿创微纳	96,527.74	0.01
16	688385	复旦微电	89,760.35	0.00
17	688331	荣昌生物	88,622.61	0.00
18	300251	光线传媒	88,585.00	0.00

19	688052	纳芯微	86,806.02	0.00
20	688065	凯赛生物	83,596.22	0.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	111,639,327.65
卖出股票收入（成交）总额	6,705,789.09

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	100.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100.01	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	1	100.01	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
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 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	1,682,200,022.35	93.51

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只基金。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,485,932.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,461,520.37
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,947,453.06

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实中证 500ETF 联接 A	118,618	7,336.97	24,328,245.67	2.80	845,968,602.75	97.20
嘉实中证 500ETF 联接 C	24,145	8,635.15	66,234,181.19	31.77	142,261,510.38	68.23
嘉实中证 500ETF 联接 I	60	35,292.07	-	-	2,117,524.15	100.00
嘉实中证 500ETF 联接 Y	607	3,078.08	-	-	1,868,391.93	100.00
合计	141,433	7,655.77	90,562,426.86	8.36	992,216,029.21	91.64

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管	嘉实中证 500ETF 联接 A	804,878.13	0.09

理人所有从业人员持有本基金	嘉实中证 500ETF 联接 C	22,222.73	0.01
	嘉实中证 500ETF 联接 I	8,242.54	0.39
	嘉实中证 500ETF 联接 Y	29,758.81	1.59
	合计	865,102.21	0.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	10~50
	嘉实中证 500ETF 联接 C	0~10
	嘉实中证 500ETF 联接 I	0~10
	嘉实中证 500ETF 联接 Y	0
	合计	10~50
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
	嘉实中证 500ETF 联接 I	0
	嘉实中证 500ETF 联接 Y	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C	嘉实中证 500ETF 联接 I	嘉实中证 500ETF 联接 Y
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	926,162,721.37	219,842,640.45	2,066,750.17	607,107.81
本报告期基金总申购份额	96,194,020.25	200,030,783.87	1,039,333.26	1,519,376.94
减：本报告期基金总赎回份额	152,059,893.20	211,377,732.75	988,559.28	258,092.82
本报告期	—	—	—	—

基金拆分 变动份额				
本报告期 期末基金 份额总额	870,296,848.42	208,495,691.57	2,117,524.15	1,868,391.93

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国信证券股份有限公司	1	54,089,235.68	45.70	10,056.52	45.69	—
华泰证券股份有限公司	1	34,523,825.01	29.17	6,421.95	29.18	—
中信建投证券股份有限公司	4	29,732,056.05	25.12	5,530.98	25.13	—
长江证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
东北证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
高盛高华证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
光大证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
广发证券股份有限公司	4	—	—	—	—	—
国泰海通证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
国投证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
华福证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—

开源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
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）合规风控能力较强；
- （4）交易等服务能力较强。

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. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国投证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国信证券股份有限公司	439.12	100.00	-	-	-	-	215,207,220.81	100.00
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

股份有限公司								
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

银泰 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中航 证券 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025 年 5 月 22 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

- 1) 北京市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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日