

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金联接基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 08 月 25 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	6
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	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.13 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	1,408,520,392.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 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	1,178,939,410.27 份	229,580,981.79 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%，年化跟踪误差不得超过 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%，年化跟踪误差不得超过 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	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	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	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》
登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	嘉实中证 500ETF 联接 A	嘉实中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	2,793,664.65	-201,474.82
本期利润	68,501,239.69	13,378,674.73
加权平均基金份 额本期利润	0.0587	0.0605
本期加权平均净 值利润率	3.34%	4.42%
本期基金份额净 值增长率	3.50%	3.30%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	849,235,899.39	77,999,588.80
期末可供分配基 金份额利润	0.7203	0.3397
期末基金资产净 值	2,028,175,309.66	307,580,570.59
期末基金份额净 值	1.7203	1.3397
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	80.87%	33.97%

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	-0.03%	0.89%	-0.77%	0.89%	0.74%	0.00%
过去三个月	-3.88%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.22%	0.00%
过去六个月	3.50%	0.75%	2.20%	0.75%	1.30%	0.00%
过去一年	-4.76%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.89%	0.00%
过去三年	8.69%	1.12%	2.48%	1.13%	6.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	80.87%	1.49%	66.77%	1.50%	14.10%	-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	-0.06%	0.89%	-0.77%	0.89%	0.71%	0.00%
过去三个月	-3.98%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.12%	0.00%
过去六个月	3.30%	0.75%	2.20%	0.75%	1.10%	0.00%
过去一年	-5.14%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.51%	0.00%
过去三年	7.41%	1.12%	2.48%	1.13%	4.93%	-0.01%
自基金合同生效起至今	33.97%	1.28%	26.30%	1.29%	7.67%	-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：

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

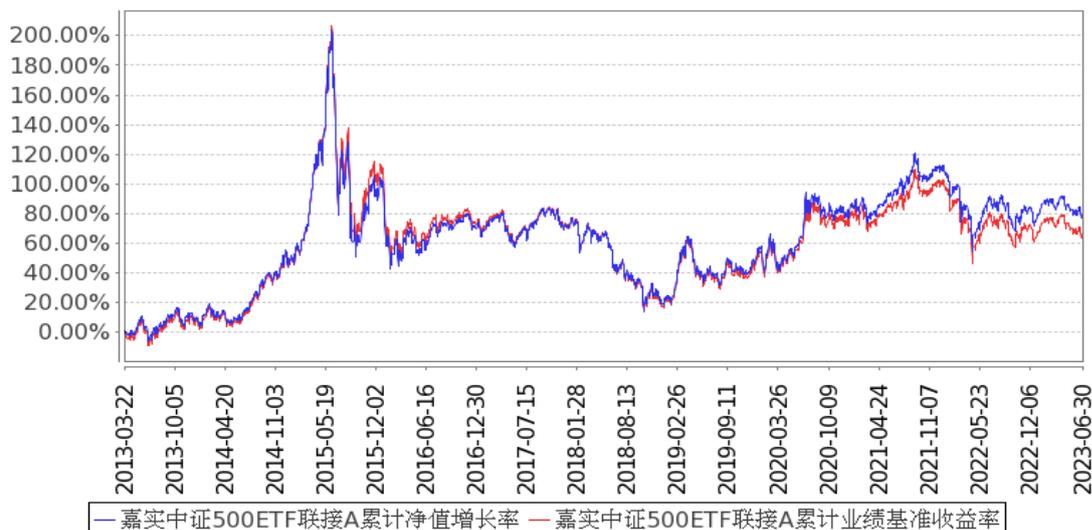
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

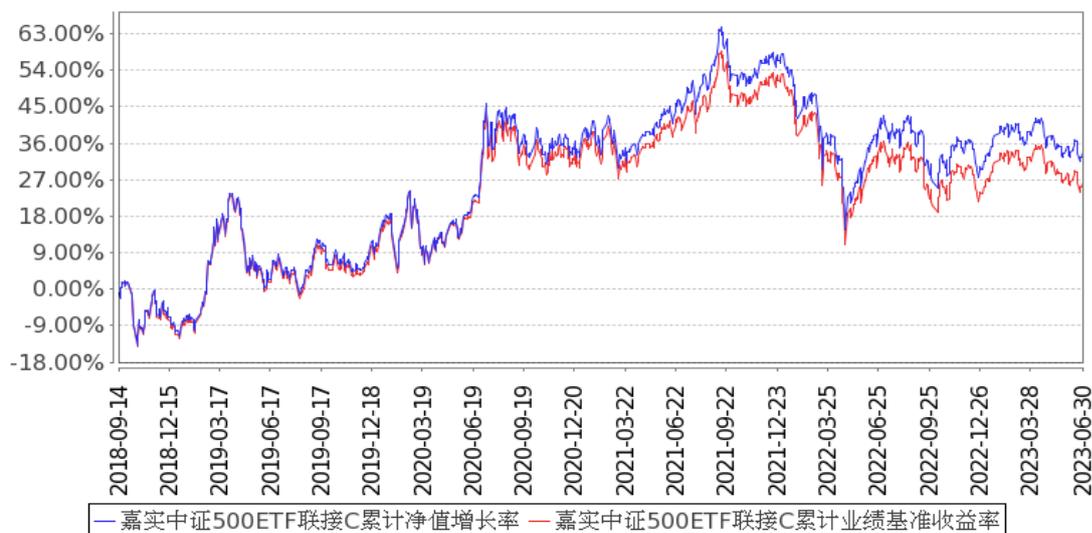
嘉实中证500ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年03月22日至2023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2023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,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 和特定资产管理业务等资格。

截止 2023 年 6 月 30 日,基金管理人共管理 314 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 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	17 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、嘉实中证	2021 年 9 月 24 日	-	8 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。

	大农业 ETF、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、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、嘉实中证信息安全主题 ETF、嘉实中证光伏产业指数发起式基金经理				
--	---	--	--	--	--

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。

4.2 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 6 次，均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。

上半年，在高通胀、美联储持续加息及地缘政治风险的共同作用下，全球经济波动加剧。全球主要经济体步入去库周期，制造业 PMI 进入下行趋势，多个指标表明全球经济依然存在衰退风险。但受益于服务业的持续高景气，全球经济下行势头趋缓。国内方面，上半年，我国经济总体呈现恢复性向好态势，一季度政策前置发力下，国内经济实现良好开局，一季度 GDP 同比增长 4.5%，二季度在海外风险加大、外需减弱和内需增长动力不足等影响下，国内经济增长边际放缓，但在去年低基数效应下，二季度 GDP 同比增长 6.3%，上半年同比增长 5.5%，总体保持持续向好态势。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.43%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35%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 1.7203 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.50%；截至本报告期末嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.3397 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.30%；业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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。

4.7 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	132,581,625.14	140,448,922.40
结算备付金		3,597,256.61	3,915,575.90
存出保证金		2,165,957.55	2,529,129.10
交易性金融资产	6.4.7.2	2,198,384,466.67	2,139,047,397.23
其中：股票投资		5,647,522.87	9,693,306.30
基金投资		2,192,736,943.80	2,129,354,090.93
债券投资		-	-
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		3,239.28	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,628,635.35	3,213,973.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,340,361,180.60	2,289,154,998.62
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		0.01	5,224,241.62
应付赎回款		4,323,590.56	7,866,110.01

应付管理人报酬		17,698.00	20,151.85
应付托管费		5,899.35	6,717.30
应付销售服务费		98,163.44	107,381.66
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	159,948.99	611,727.19
负债合计		4,605,300.35	13,836,329.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,408,520,392.06	1,426,089,824.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	927,235,488.19	849,228,844.18
净资产合计		2,335,755,880.25	2,275,318,668.99
负债和净资产总计		2,340,361,180.60	2,289,154,998.62

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实中证 500ETF 联接 A 基金份额净值 1.7203 元，基金份额总额 1,178,939,410.27 份，嘉实中证 500ETF 联接 C 基金份额净值 1.3397 元，基金份额总额 229,580,981.79 份，基金份额总额合计为 1,408,520,392.06 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		82,752,001.11	-222,304,831.40
1. 利息收入		284,311.60	280,834.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	284,311.60	280,834.93
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,005,322.69	-69,016,279.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-269,282.40	-1,145,215.44
基金投资收益	6.4.7.15	2,996,561.28	-69,109,568.99
债券投资收益	6.4.7.16	6,096.89	1,315.57
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	213,633.27	1,205,262.29
股利收益	6.4.7.20	58,313.65	31,927.34
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
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	79,287,724.59	-153,906,099.16
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	174,642.23	336,712.06
减：二、营业总支出		872,086.69	720,849.30
1. 管理人报酬		110,718.18	102,967.98
2. 托管费		36,906.09	34,322.65
3. 销售服务费		602,689.39	469,644.65
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		13,256.75	6,641.97
8. 其他费用	6.4.7.24	108,516.28	107,272.05
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		81,879,914.42	-223,025,680.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		81,879,914.42	-223,025,680.70
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		81,879,914.42	-223,025,680.70

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,426,089,824.81	-	849,228,844.18	2,275,318,668.99

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,426,089,824.81	-	849,228,844.18	2,275,318,668.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,569,432.75	-	78,006,644.01	60,437,211.26
(一)、综合收益总额	-	-	81,879,914.42	81,879,914.42
(二)、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)	-17,569,432.75	-	-3,873,270.41	-21,442,703.16
其中:1.基金申购款	372,143,453.59	-	187,190,025.61	559,333,479.20
2.基金赎回款	-389,712,886.34	-	-191,063,296.02	-580,776,182.36
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,408,520,392.06	-	927,235,488.19	2,335,755,880.25
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值)	1,181,045,725.50	-	1,136,126,492.31	2,317,172,217.81
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,181,045,725.50	-	1,136,126,492.31	2,317,172,217.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	80,738,936.19	-	-176,557,635.66	-95,818,699.47
(一)、综合收益总额	-	-	-223,025,680.70	-223,025,680.70
(二)、本期基	80,738,936.19	-	46,468,045.04	127,206,981.23

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	627,735,448.11	-	298,290,374.85	926,025,822.96
2. 基金赎回款	-546,996,511.92	-	-251,822,329.81	-798,818,841.73
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	1,261,784,661.69	-	959,568,856.65	2,221,353,518.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 6.4.4 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。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	132,581,625.14
等于：本金	132,568,333.90
加：应计利息	13,291.24
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	132,581,625.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,579,943.63	-	5,647,522.87	67,579.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	2,216,801,426.60	-	2,192,736,943.80	-24,064,482.80
其他	-	-	-	-
合计	2,222,381,370.23	-	2,198,384,466.67	-23,996,903.56

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 2023 年 6 月 30 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	16,790,440.00	-	-	
其中：股指期 货投资	16,790,440.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	16,790,440.00	-	-	

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
IC2309	IC2309	6.00	7,164,000.00	-121,960.00
IC2312	IC2312	8.00	9,478,720.00	-25,760.00
合计				-147,720.00
减：可抵销期货 暂收款				-147,720.00
净额				0.00

注：衍生金融资产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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,951.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	51,868.71
其中：交易所市场	51,868.71
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	105,128.42
合计	159,948.99

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,166,059,366.03	1,166,059,366.03
本期申购	130,190,005.01	130,190,005.01
本期赎回 (以“-”号填列)	-117,309,960.77	-117,309,960.77
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	1,178,939,410.27	1,178,939,410.27

嘉实中证 500ETF 联接 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	260,030,458.78	260,030,458.78
本期申购	241,953,448.58	241,953,448.58
本期赎回 (以“-”号填列)	-272,402,925.57	-272,402,925.57
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	229,580,981.79	229,580,981.79

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	1,297,070,686.89	-525,056,067.18	772,014,619.71
本期利润	2,793,664.65	65,707,575.04	68,501,239.69
本期基金份额交易产生的变动数	14,375,889.50	-5,655,849.51	8,720,039.99
其中：基金申购款	145,067,838.03	-46,689,691.59	98,378,146.44
基金赎回款	-130,691,948.53	41,033,842.08	-89,658,106.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,314,240,241.04	-465,004,341.65	849,235,899.39

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	90,298,140.87	-13,083,916.40	77,214,224.47
本期利润	-201,474.82	13,580,149.55	13,378,674.73
本期基金份额交易产生的变动数	-10,565,207.67	-2,028,102.73	-12,593,310.40
其中：基金申购款	84,035,445.77	4,776,433.40	88,811,879.17
基金赎回款	-94,600,653.44	-6,804,536.13	-101,405,189.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,531,458.38	-1,531,869.58	77,999,588.80

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入	242,224.67	
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	39,914.27	
其他	2,172.66	
合计	284,311.60	

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-239,329.04	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-29,953.36	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-269,282.40	

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额	222,032.57	
减：卖出股票成本总额	241,685.10	
减：交易费用	219,676.51	
买卖股票差价收入	-239,329.04	

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 2023年1月1日至2023年6月30日
申购基金份额总额	316,925,560.00
减：现金支付申购款总额	18,573,244.88
减：申购股票成本总额	298,382,268.48
减：交易费用	-
申购差价收入	-29,953.36

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	335,479,953.71
减：卖出/赎回基金成本总额	332,357,302.78
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	105,076.46
减：交易费用	21,013.19
基金投资收益	2,996,561.28

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,092.48
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	6,096.89

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,097.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,000.00

减：应计利息总额	4.42
减：交易费用	0.80
买卖债券差价收入	6,092.48

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	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

股指期货投资收益	213,633.27
----------	------------

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	58,313.65
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	58,313.65

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	78,915,444.59
股票投资	206,939.05
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	78,708,505.54
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	372,280.00
权证投资	-
期货投资	372,280.00
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	79,287,724.59

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	167,034.65
基金转出费收入	7,607.58
合计	174,642.23

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

审计费用	45,621.05
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,384.71
存托服务费	3.15
合计	108,516.28

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	110,718.18	102,967.98
其中：支付销售机构的客户维护费	586,541.52	470,279.33

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 0.15% 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	36,906.09	34,322.65

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	合计

嘉实基金管理有限公司	-	112,912.05	112,912.05
中国建设银行	-	-	-
嘉实财富	-	152,055.68	152,055.68
合计	-	264,967.73	264,967.73
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	合计
嘉实基金管理有限公司	-	76,168.16	76,168.16
中国建设银行	-	-	-
嘉实财富	-	7.08	7.08
合计	-	76,175.24	76,175.24

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。

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自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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	132,581,625.14	242,224.67	126,358,859.91	215,066.40

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(2023 年 06 月 30 日)，本基金持有 352,967,008.00 份目标 ETF 基金份额(2022 年 12 月 31 日：355,502,628.00 份)，占其总份额的比例为 34.17%(2022 年 12 月 31 日：25.79%)。

6.4.11 利润分配情况

本期(2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日)，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2023 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

无。

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
000540	*ST 中天	2023 年 05 月 19 日	退市	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 risk 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他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

无。

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	132,581,625.14	-	-	-	132,581,625.14
结算备付金	3,597,256.61	-	-	-	3,597,256.61
存出保证金	168,831.15	-	-	1,997,126.40	2,165,957.55
交易性金融资产	-	-	-	-2,198,384,466.67	2,198,384,466.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,239.28	3,239.28
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,628,635.35	3,628,635.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	136,347,712.90	-	-	-2,204,013,467.70	2,340,361,180.60

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	-	-	-	4,323,590.56	4,323,590.56
应付管理人报酬	-	-	-	17,698.00	17,698.00
应付托管费	-	-	-	5,899.35	5,899.35
应付销售服务费	-	-	-	98,163.44	98,163.44
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	-	-	-	159,948.99	159,948.99
负债总计	-	-	-	4,605,300.35	4,605,300.35
利率敏感度缺口	136,347,712.90	-	-	-2,199,408,167.35	2,335,755,880.25
上年度末 2022 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	140,448,922.40	-	-	-	140,448,922.40
结算备付金	3,915,575.90	-	-	-	3,915,575.90
存出保证金	246,384.30	-	-	2,282,744.80	2,529,129.10
交易性金融资产	-	-	-	-2,139,047,397.23	2,139,047,397.23
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	-	-	-	3,213,973.99	3,213,973.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	144,610,882.60	-	-	-2,144,544,116.02	2,289,154,998.62
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	-	-	-	5,224,241.62	5,224,241.62
应付赎回款	-	-	-	7,866,110.01	7,866,110.01
应付管理人报酬	-	-	-	20,151.85	20,151.85
应付托管费	-	-	-	6,717.30	6,717.30
应付销售服务费	-	-	-	107,381.66	107,381.66
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	-	-	-	611,727.19	611,727.19
负债总计	-	-	-	13,836,329.63	13,836,329.63
利率敏感度缺口	144,610,882.60	-	-	-2,130,707,786.39	2,275,318,668.99

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	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 2023年6月30日		上年度末 2022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	5,647,522.87	0.24	9,693,306.30	0.43
交易性金融资产—基金投资	2,192,736,943.80	93.88	2,129,354,090.93	93.58
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	2,198,384,466.67	94.12	2,139,047,397.23	94.01

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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	116,092,838.94	113,375,737.82
	业绩比较基准下降5%	-116,092,838.94	-113,375,737.82

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,198,383,026.67	2,139,047,397.23
第二层次	1,440.00	-
第三层次	-	-
合计	2,198,384,466.67	2,139,047,397.23

6.4.14.2.2 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。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	5,647,522.87	0.24
	其中：股票	5,647,522.87	0.24
2	基金投资	2,192,736,943.80	93.69
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	136,178,881.75	5.82
8	其他各项资产	5,797,832.18	0.25
9	合计	2,340,361,180.60	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	37,144.00	0.00
B	采矿业	178,240.00	0.01
C	制造业	3,439,312.63	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	198,228.00	0.01
E	建筑业	56,004.00	0.00
F	批发和零售业	173,006.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	81,460.00	0.00
H	住宿和餐饮业	7,580.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	721,018.24	0.03
J	金融业	423,828.00	0.02
K	房地产业	72,806.00	0.00
L	租赁和商务服务业	60,712.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	52,122.00	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	28,890.00	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	25,352.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	63,856.00	0.00
S	综合	27,964.00	0.00
	合计	5,647,522.87	0.24

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	688256	寒武纪	1,056	198,528.00	0.01
2	603444	吉比特	200	98,222.00	0.00
3	688390	固德威	545	90,938.70	0.00
4	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.00
5	300308	中际旭创	400	58,980.00	0.00
6	603267	鸿远电子	700	45,710.00	0.00
7	688188	柏楚电子	231	43,557.36	0.00
8	688002	睿创微纳	800	35,840.00	0.00
9	688099	晶晨股份	400	33,728.00	0.00
10	688029	南微医学	398	32,460.88	0.00
11	000988	华工科技	800	30,408.00	0.00
12	688220	翱捷科技	400	30,156.00	0.00
13	688185	康希诺	363	29,584.50	0.00
14	688521	芯原股份	400	28,768.00	0.00
15	600563	法拉电子	200	27,460.00	0.00
16	000591	太阳能	4,000	27,120.00	0.00
17	688116	天奈科技	579	26,489.25	0.00
18	002850	科达利	200	26,450.00	0.00
19	688819	天能股份	717	26,414.28	0.00
20	002340	格林美	3,800	26,258.00	0.00
21	002384	东山精密	1,000	25,900.00	0.00
22	002791	坚朗五金	400	25,884.00	0.00
23	002673	西部证券	4,000	25,400.00	0.00
24	688777	中控技术	400	25,112.00	0.00
25	002195	二三四五	8,600	24,854.00	0.00
26	600372	中航电子	1,600	24,288.00	0.00
27	300418	昆仑万维	600	24,168.00	0.00
28	002422	科伦药业	800	23,744.00	0.00
29	600157	永泰能源	16,600	23,572.00	0.00

30	300012	华测检测	1,200	23,400.00	0.00
31	603688	石英股份	200	22,768.00	0.00
32	600489	中金黄金	2,200	22,726.00	0.00
33	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.00
34	600079	人福医药	800	21,552.00	0.00
35	600027	华电国际	3,200	21,408.00	0.00
36	600765	中航重机	800	21,208.00	0.00
37	002463	沪电股份	1,000	20,940.00	0.00
38	601555	东吴证券	3,000	20,820.00	0.00
39	300037	新宙邦	400	20,756.00	0.00
40	600487	亨通光电	1,400	20,524.00	0.00
41	601058	赛轮轮胎	1,800	20,502.00	0.00
42	002738	中矿资源	400	20,376.00	0.00
43	600988	赤峰黄金	1,500	20,190.00	0.00
44	688385	复旦微电	400	20,040.00	0.00
45	300395	菲利华	400	19,680.00	0.00
46	000066	中国长城	1,400	19,362.00	0.00
47	000009	中国宝安	1,600	19,312.00	0.00
48	300146	汤臣倍健	800	19,184.00	0.00
49	600885	宏发股份	600	19,110.00	0.00
50	000060	中金岭南	4,000	19,000.00	0.00
51	600482	中国动力	800	18,752.00	0.00
51	600536	中国软件	400	18,752.00	0.00
52	600352	浙江龙盛	2,000	18,700.00	0.00
53	002028	思源电气	400	18,688.00	0.00
54	300390	天华新能	520	18,616.00	0.00
55	603737	三棵树	280	18,317.60	0.00
56	002625	光启技术	1,200	18,312.00	0.00
57	002156	通富微电	800	18,080.00	0.00
58	300474	景嘉微	200	17,998.00	0.00
59	300866	安克创新	200	17,500.00	0.00
60	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.00
61	688690	纳微科技	450	17,482.50	0.00
62	300058	蓝色光标	1,800	17,406.00	0.00
63	601108	财通证券	2,400	17,376.00	0.00
64	300144	宋城演艺	1,400	17,360.00	0.00
65	600109	国金证券	2,000	17,340.00	0.00
66	300568	星源材质	1,000	17,190.00	0.00
67	600096	云天化	1,000	17,070.00	0.00
68	600415	小商品城	2,000	17,060.00	0.00
69	002966	苏州银行	2,600	17,030.00	0.00
70	002624	完美世界	1,000	16,890.00	0.00
71	300024	机器人	1,000	16,670.00	0.00

72	002185	华天科技	1,800	16,560.00	0.00
73	601077	渝农商行	4,600	16,514.00	0.00
74	002368	太极股份	400	16,468.00	0.00
75	300285	国瓷材料	600	16,440.00	0.00
76	600161	天坛生物	600	16,290.00	0.00
77	000783	长江证券	2,800	16,240.00	0.00
78	300136	信维通信	800	16,064.00	0.00
79	600038	中直股份	400	15,928.00	0.00
80	601233	桐昆股份	1,200	15,900.00	0.00
81	002407	多氟多	800	15,888.00	0.00
82	603596	伯特利	200	15,852.00	0.00
83	002385	大北农	2,400	15,840.00	0.00
84	002008	大族激光	600	15,720.00	0.00
85	000630	铜陵有色	5,400	15,606.00	0.00
86	000933	神火股份	1,200	15,600.00	0.00
87	600056	中国医药	1,200	15,576.00	0.00
88	600755	厦门国贸	2,000	15,480.00	0.00
89	300118	东方日升	600	15,378.00	0.00
90	603816	顾家家居	400	15,260.00	0.00
91	000598	兴蓉环境	2,800	15,204.00	0.00
92	600862	中航高科	600	15,186.00	0.00
93	300253	卫宁健康	1,400	15,148.00	0.00
94	688006	杭可科技	496	15,113.12	0.00
95	600418	江淮汽车	1,200	15,108.00	0.00
96	603882	金域医学	200	15,100.00	0.00
97	601162	天风证券	5,000	14,900.00	0.00
98	600060	海信视像	600	14,850.00	0.00
99	603939	益丰药房	400	14,800.00	0.00
100	600066	宇通客车	1,000	14,740.00	0.00
100	689009	九号公司	400	14,740.00	0.00
101	601168	西部矿业	1,400	14,714.00	0.00
102	605358	立昂微	400	14,692.00	0.00
103	603077	和邦生物	6,000	14,580.00	0.00
104	002409	雅克科技	200	14,576.00	0.00
105	603893	瑞芯微	200	14,570.00	0.00
106	600705	中航产融	3,800	14,554.00	0.00
107	002568	百润股份	400	14,540.00	0.00
108	600298	安琪酵母	400	14,484.00	0.00
109	002465	海格通信	1,400	14,476.00	0.00
110	002223	鱼跃医疗	400	14,396.00	0.00
111	002138	顺络电子	600	14,346.00	0.00
112	600873	梅花生物	1,600	14,288.00	0.00
113	002497	雅化集团	800	14,224.00	0.00

114	600699	均胜电子	800	14,112.00	0.00
115	000975	银泰黄金	1,200	14,040.00	0.00
116	000400	许继电气	600	13,830.00	0.00
117	002600	领益智造	2,000	13,820.00	0.00
118	600160	巨化股份	1,000	13,780.00	0.00
119	002430	杭氧股份	400	13,744.00	0.00
120	002797	第一创业	2,400	13,728.00	0.00
121	601128	常熟银行	2,000	13,640.00	0.00
122	600879	航天电子	1,600	13,584.00	0.00
123	002192	融捷股份	200	13,366.00	0.00
124	600637	东方明珠	1,708	13,356.56	0.00
125	600141	兴发集团	600	13,332.00	0.00
125	601966	玲珑轮胎	600	13,332.00	0.00
126	603786	科博达	200	13,140.00	0.00
127	600839	四川长虹	2,600	13,130.00	0.00
128	002444	巨星科技	600	13,128.00	0.00
129	601990	南京证券	1,600	13,088.00	0.00
130	000728	国元证券	2,000	13,040.00	0.00
131	300776	帝尔激光	200	12,980.00	0.00
132	688567	孚能科技	600	12,954.00	0.00
133	000683	远兴能源	1,800	12,942.00	0.00
134	600392	盛和资源	1,000	12,870.00	0.00
135	002078	太阳纸业	1,200	12,828.00	0.00
136	300017	网宿科技	1,800	12,798.00	0.00
137	601696	中银证券	1,200	12,792.00	0.00
138	002025	航天电器	200	12,760.00	0.00
139	002240	盛新锂能	400	12,748.00	0.00
140	600177	雅戈尔	2,000	12,620.00	0.00
141	603868	飞科电器	200	12,618.00	0.00
142	600642	申能股份	1,800	12,582.00	0.00
143	002739	万达电影	1,000	12,540.00	0.00
144	000629	钒钛股份	3,200	12,512.00	0.00
145	300487	蓝晓科技	200	12,484.00	0.00
146	002294	信立泰	400	12,476.00	0.00
147	000729	燕京啤酒	1,000	12,470.00	0.00
148	300001	特锐德	600	12,468.00	0.00
149	000960	锡业股份	800	12,440.00	0.00
150	600516	方大炭素	2,000	12,400.00	0.00
151	600170	上海建工	4,600	12,374.00	0.00
152	300699	光威复材	400	12,340.00	0.00
153	002372	伟星新材	600	12,324.00	0.00
154	000998	隆平高科	800	12,280.00	0.00
155	600166	福田汽车	3,600	12,240.00	0.00

155	600399	抚顺特钢	1,200	12,240.00	0.00
156	600143	金发科技	1,400	12,222.00	0.00
156	600498	烽火通信	600	12,222.00	0.00
157	688208	道通科技	400	12,124.00	0.00
158	002439	启明星辰	407	12,112.32	0.00
159	603712	七一二	400	12,084.00	0.00
160	300595	欧普康视	400	12,076.00	0.00
161	300676	华大基因	200	11,998.00	0.00
162	000021	深科技	600	11,994.00	0.00
163	002532	天山铝业	2,000	11,980.00	0.00
164	300748	金力永磁	400	11,968.00	0.00
165	002273	水晶光电	1,000	11,940.00	0.00
166	600859	王府井	600	11,874.00	0.00
167	000831	中国稀土	400	11,840.00	0.00
168	600325	华发股份	1,200	11,820.00	0.00
169	300832	新产业	200	11,800.00	0.00
170	002683	广东宏大	400	11,776.00	0.00
171	002152	广电运通	1,000	11,720.00	0.00
172	603000	人民网	400	11,680.00	0.00
173	600546	山煤国际	800	11,576.00	0.00
174	002131	利欧股份	5,000	11,500.00	0.00
175	002299	圣农发展	600	11,490.00	0.00
176	600549	厦门钨业	600	11,418.00	0.00
177	600499	科达制造	1,000	11,360.00	0.00
178	002507	涪陵榨菜	620	11,352.20	0.00
179	601997	贵阳银行	2,200	11,352.00	0.00
180	000997	新大陆	600	11,340.00	0.00
181	002065	东华软件	1,600	11,296.00	0.00
182	600118	中国卫星	400	11,284.00	0.00
182	688772	珠海冠宇	560	11,284.00	0.00
183	601198	东兴证券	1,400	11,228.00	0.00
184	603233	大参林	400	11,204.00	0.00
185	603338	浙江鼎力	200	11,202.00	0.00
186	600481	双良节能	800	11,184.00	0.00
186	601598	中国外运	2,400	11,184.00	0.00
187	002268	电科网安	400	11,148.00	0.00
188	600348	华阳股份	1,400	11,074.00	0.00
189	600521	华海药业	600	11,046.00	0.00
190	600271	航天信息	800	10,952.00	0.00
190	603456	九洲药业	400	10,952.00	0.00
191	002056	横店东磁	600	10,926.00	0.00
192	002373	千方科技	800	10,912.00	0.00
193	600153	建发股份	1,000	10,910.00	0.00

194	600529	山东药玻	400	10,888.00	0.00
195	600704	物产中大	2,200	10,868.00	0.00
196	601577	长沙银行	1,400	10,864.00	0.00
197	000519	中兵红箭	600	10,854.00	0.00
197	300088	长信科技	1,800	10,854.00	0.00
198	000703	恒逸石化	1,600	10,848.00	0.00
199	600021	上海电力	1,000	10,770.00	0.00
200	300383	光环新网	1,000	10,750.00	0.00
201	301029	怡合达	240	10,723.20	0.00
202	600739	辽宁成大	800	10,520.00	0.00
203	600867	通化东宝	1,000	10,440.00	0.00
203	688009	中国通号	1,800	10,440.00	0.00
204	600782	新钢股份	2,800	10,388.00	0.00
205	600998	九州通	1,000	10,380.00	0.00
206	603658	安图生物	200	10,346.00	0.00
207	601636	旗滨集团	1,200	10,344.00	0.00
208	002092	中泰化学	1,600	10,320.00	0.00
209	601016	节能风电	2,800	10,276.00	0.00
210	000970	中科三环	800	10,256.00	0.00
211	300244	迪安诊断	400	10,252.00	0.00
212	600970	中材国际	800	10,200.00	0.00
213	600380	健康元	800	10,168.00	0.00
214	000987	越秀资本	1,600	10,160.00	0.00
215	002508	老板电器	400	10,116.00	0.00
216	300182	捷成股份	1,600	10,096.00	0.00
217	300073	当升科技	200	10,066.00	0.00
218	002353	杰瑞股份	400	10,052.00	0.00
219	002032	苏泊尔	200	10,000.00	0.00
219	603826	坤彩科技	200	10,000.00	0.00
220	002926	华西证券	1,200	9,972.00	0.00
221	002506	协鑫集成	3,400	9,962.00	0.00
222	600863	内蒙华电	2,400	9,960.00	0.00
223	002429	兆驰股份	1,800	9,900.00	0.00
224	600528	中铁工业	1,000	9,880.00	0.00
224	603156	养元饮品	400	9,880.00	0.00
225	603589	口子窖	200	9,870.00	0.00
226	000738	航发控制	400	9,760.00	0.00
227	002939	长城证券	1,200	9,756.00	0.00
228	601179	中国西电	1,800	9,738.00	0.00
229	000039	中集集团	1,400	9,646.00	0.00
230	000623	吉林敖东	600	9,624.00	0.00
231	600820	隧道股份	1,600	9,616.00	0.00
232	002203	海亮股份	800	9,608.00	0.00

232	300438	鹏辉能源	200	9,608.00	0.00
233	300558	贝达药业	200	9,606.00	0.00
234	600655	豫园股份	1,400	9,604.00	0.00
235	600848	上海临港	800	9,560.00	0.00
236	000750	国海证券	2,800	9,380.00	0.00
236	600316	洪都航空	400	9,380.00	0.00
237	600195	中牧股份	800	9,344.00	0.00
238	600909	华安证券	2,000	9,340.00	0.00
239	002901	大博医疗	300	9,324.00	0.00
240	300682	朗新科技	400	9,312.00	0.00
241	300529	健帆生物	400	9,272.00	0.00
242	601991	大唐发电	2,800	9,268.00	0.00
243	603885	吉祥航空	600	9,258.00	0.00
244	603160	汇顶科技	200	9,250.00	0.00
245	600008	首创环保	3,200	9,216.00	0.00
245	600985	淮北矿业	800	9,216.00	0.00
246	000636	风华高科	600	9,204.00	0.00
247	000893	亚钾国际	400	9,176.00	0.00
248	300296	利亚德	1,400	9,142.00	0.00
249	002531	天顺风能	600	9,138.00	0.00
250	688779	长远锂科	800	9,016.00	0.00
251	600329	达仁堂	200	8,978.00	0.00
252	600208	新湖中宝	3,600	8,928.00	0.00
253	601958	金钼股份	800	8,920.00	0.00
254	000878	云南铜业	800	8,840.00	0.00
255	002985	北摩高科	200	8,824.00	0.00
256	002244	滨江集团	1,000	8,820.00	0.00
257	300677	英科医疗	400	8,800.00	0.00
258	600580	卧龙电驱	600	8,766.00	0.00
259	002019	亿帆医药	600	8,760.00	0.00
259	600369	西南证券	2,400	8,760.00	0.00
260	002936	郑州银行	3,800	8,740.00	0.00
261	601880	辽港股份	5,600	8,736.00	0.00
262	600535	天士力	600	8,706.00	0.00
263	002153	石基信息	620	8,680.00	0.00
264	300861	美畅股份	200	8,674.00	0.00
265	300026	红日药业	1,600	8,672.00	0.00
266	600673	东阳光	1,200	8,652.00	0.00
267	000155	川能动力	600	8,640.00	0.00
268	600390	五矿资本	1,600	8,608.00	0.00
269	300070	碧水源	1,600	8,576.00	0.00
270	003035	南网能源	1,200	8,544.00	0.00
271	000830	鲁西化工	800	8,448.00	0.00

272	600895	张江高科	600	8,352.00	0.00
273	300888	稳健医疗	200	8,334.00	0.00
274	002557	洽洽食品	200	8,310.00	0.00
275	002266	浙富控股	2,000	8,260.00	0.00
276	600398	海澜之家	1,200	8,256.00	0.00
277	603858	步长制药	400	8,236.00	0.00
278	002080	中材科技	400	8,208.00	0.00
279	603127	昭衍新药	200	8,180.00	0.00
280	300373	扬杰科技	200	8,114.00	0.00
281	600131	国网信通	400	8,076.00	0.00
282	600827	百联股份	600	8,022.00	0.00
283	002518	科士达	200	8,002.00	0.00
284	300009	安科生物	800	8,000.00	0.00
285	600598	北大荒	600	7,998.00	0.00
286	002030	达安基因	800	7,976.00	0.00
287	002128	电投能源	600	7,932.00	0.00
288	000887	中鼎股份	600	7,854.00	0.00
289	000513	丽珠集团	200	7,782.00	0.00
290	600511	国药股份	200	7,770.00	0.00
291	601000	唐山港	2,200	7,766.00	0.00
292	603927	中科软	200	7,712.00	0.00
293	002408	齐翔腾达	1,200	7,644.00	0.00
294	600416	湘电股份	400	7,636.00	0.00
295	688538	和辉光电	3,000	7,620.00	0.00
296	002958	青农商行	2,800	7,616.00	0.00
297	603218	日月股份	400	7,596.00	0.00
298	600258	首旅酒店	400	7,580.00	0.00
299	601666	平煤股份	1,000	7,540.00	0.00
300	600378	昊华科技	200	7,528.00	0.00
301	300850	新强联	200	7,476.00	0.00
302	601717	郑煤机	600	7,470.00	0.00
303	600959	江苏有线	2,200	7,436.00	0.00
304	603517	绝味食品	200	7,430.00	0.00
305	002281	光迅科技	200	7,418.00	0.00
306	600282	南钢股份	2,200	7,414.00	0.00
307	601869	长飞光纤	200	7,402.00	0.00
308	000050	深天马 A	800	7,344.00	0.00
308	000778	新兴铸管	1,800	7,344.00	0.00
309	002155	湖南黄金	600	7,320.00	0.00
310	600171	上海贝岭	400	7,300.00	0.00
311	601456	国联证券	800	7,280.00	0.00
312	600667	太极实业	1,000	7,260.00	0.00
313	600259	广晟有色	200	7,228.00	0.00

314	600906	财达证券	1,000	7,200.00	0.00
315	300115	长盈精密	600	7,146.00	0.00
316	002183	怡亚通	1,400	7,140.00	0.00
317	002867	周大生	400	7,112.00	0.00
318	000739	普洛药业	400	7,096.00	0.00
319	002432	九安医疗	200	7,042.00	0.00
320	002595	豪迈科技	200	7,026.00	0.00
321	002670	国盛金控	800	7,024.00	0.00
322	603568	伟明环保	400	7,004.00	0.00
323	601005	重庆钢铁	5,000	7,000.00	0.00
324	600582	天地科技	1,200	6,996.00	0.00
325	002572	索菲亚	400	6,968.00	0.00
325	600062	华润双鹤	400	6,968.00	0.00
326	002221	东华能源	800	6,920.00	0.00
327	601778	晶科科技	1,400	6,916.00	0.00
327	601866	中远海发	2,800	6,916.00	0.00
328	001872	招商港口	400	6,908.00	0.00
329	002249	大洋电机	1,200	6,840.00	0.00
329	601928	凤凰传媒	600	6,840.00	0.00
330	000709	河钢股份	3,000	6,780.00	0.00
331	688289	圣湘生物	400	6,736.00	0.00
332	300357	我武生物	200	6,726.00	0.00
333	601106	中国一重	2,000	6,720.00	0.00
334	002511	中顺洁柔	600	6,690.00	0.00
335	300212	易华录	200	6,646.00	0.00
336	603225	新凤鸣	600	6,630.00	0.00
337	000027	深圳能源	1,000	6,590.00	0.00
338	603650	彤程新材	200	6,560.00	0.00
339	601992	金隅集团	3,000	6,540.00	0.00
340	002468	申通快递	600	6,492.00	0.00
341	300618	寒锐钴业	200	6,482.00	0.00
342	300251	光线传媒	800	6,472.00	0.00
343	603529	爱玛科技	200	6,444.00	0.00
344	600737	中粮糖业	800	6,440.00	0.00
345	600718	东软集团	600	6,396.00	0.00
346	000883	湖北能源	1,400	6,384.00	0.00
347	002250	联化科技	600	6,276.00	0.00
348	601665	齐鲁银行	1,600	6,272.00	0.00
349	600297	广汇汽车	3,000	6,240.00	0.00
349	600597	光明乳业	600	6,240.00	0.00
350	600155	华创云信	1,000	6,220.00	0.00
351	000825	太钢不锈	1,600	6,192.00	0.00
352	002487	大金重工	200	6,168.00	0.00

353	300442	润泽科技	200	6,152.00	0.00
354	000869	张裕 A	200	6,132.00	0.00
355	002326	永太科技	400	6,116.00	0.00
356	002761	浙江建投	400	6,072.00	0.00
356	603866	桃李面包	600	6,072.00	0.00
357	600967	内蒙一机	600	6,060.00	0.00
358	001914	招商积余	400	6,020.00	0.00
359	601231	环旭电子	400	5,984.00	0.00
360	603883	老百姓	200	5,970.00	0.00
361	000012	南玻 A	1,000	5,960.00	0.00
362	600871	石化油服	3,000	5,940.00	0.00
363	600663	陆家嘴	600	5,922.00	0.00
364	300363	博腾股份	200	5,918.00	0.00
365	000401	冀东水泥	800	5,896.00	0.00
366	600566	济川药业	200	5,808.00	0.00
367	600315	上海家化	200	5,802.00	0.00
368	001227	兰州银行	2,000	5,720.00	0.00
369	600022	山东钢铁	4,000	5,680.00	0.00
370	600556	天下秀	800	5,672.00	0.00
371	000089	深圳机场	800	5,560.00	0.00
371	600500	中化国际	1,000	5,560.00	0.00
372	002745	木林森	600	5,520.00	0.00
373	000559	万向钱潮	1,000	5,450.00	0.00
373	600409	三友化工	1,000	5,450.00	0.00
374	600764	中国海防	200	5,444.00	0.00
375	002081	金螳螂	1,200	5,412.00	0.00
376	603707	健友股份	400	5,400.00	0.00
377	601118	海南橡胶	1,200	5,376.00	0.00
378	000785	居然之家	1,400	5,334.00	0.00
379	600373	中文传媒	400	5,328.00	0.00
380	300482	万孚生物	200	5,326.00	0.00
381	002010	传化智联	1,000	5,320.00	0.00
382	002505	鹏都农牧	2,800	5,292.00	0.00
383	000156	华数传媒	600	5,220.00	0.00
384	601156	东航物流	400	5,200.00	0.00
385	000958	电投产融	1,200	5,196.00	0.00
386	002690	美亚光电	200	5,150.00	0.00
387	603228	景旺电子	200	5,130.00	0.00
388	603355	莱克电气	200	5,082.00	0.00
389	601611	中国核建	600	5,070.00	0.00
390	601608	中信重工	1,200	5,052.00	0.00
391	000967	盈峰环境	1,000	5,050.00	0.00
392	601187	厦门银行	1,000	5,020.00	0.00

393	000898	鞍钢股份	1,800	5,004.00	0.00
394	600901	江苏金租	1,200	4,956.00	0.00
395	600801	华新水泥	400	4,940.00	0.00
396	600339	中油工程	1,200	4,884.00	0.00
397	000563	陕国投 A	1,600	4,880.00	0.00
398	002831	裕同科技	200	4,878.00	0.00
399	000930	中粮科技	600	4,860.00	0.00
400	002423	中粮资本	600	4,800.00	0.00
401	600707	彩虹股份	1,000	4,760.00	0.00
402	601718	际华集团	1,600	4,752.00	0.00
403	002653	海思科	200	4,720.00	0.00
404	603379	三美股份	200	4,702.00	0.00
405	600095	湘财股份	600	4,680.00	0.00
406	000537	广宇发展	400	4,668.00	0.00
407	600507	方大特钢	1,000	4,630.00	0.00
408	600808	马钢股份	1,800	4,626.00	0.00
409	000415	渤海租赁	2,200	4,620.00	0.00
410	002608	江苏国信	600	4,542.00	0.00
411	001203	大中矿业	400	4,444.00	0.00
412	600126	杭钢股份	1,000	4,340.00	0.00
413	600968	海油发展	1,400	4,298.00	0.00
414	300741	华宝股份	200	4,284.00	0.00
415	601568	北元集团	800	4,216.00	0.00
416	000959	首钢股份	1,200	4,200.00	0.00
417	600167	联美控股	600	4,182.00	0.00
418	603638	艾迪精密	200	4,104.00	0.00
419	600377	宁沪高速	400	3,932.00	0.00
420	002925	盈趣科技	200	3,880.00	0.00
421	601228	广州港	1,200	3,876.00	0.00
422	601828	美凯龙	800	3,832.00	0.00
423	600623	华谊集团	600	3,738.00	0.00
424	002563	森马服饰	600	3,732.00	0.00
425	000031	大悦城	1,000	3,660.00	0.00
426	000402	金融街	800	3,616.00	0.00
427	002705	新宝股份	200	3,606.00	0.00
428	600928	西安银行	1,000	3,520.00	0.00
429	000553	安道麦 A	400	3,376.00	0.00
429	002110	三钢闽光	800	3,376.00	0.00
430	600927	永安期货	200	3,252.00	0.00
431	603056	德邦股份	200	3,084.00	0.00
432	300257	开山股份	200	3,034.00	0.00
433	603317	天味食品	200	2,922.00	0.00
434	601139	深圳燃气	400	2,916.00	0.00

435	601136	首创证券	200	2,834.00	0.00
436	002945	华林证券	200	2,736.00	0.00
437	601969	海南矿业	400	2,632.00	0.00
438	600350	山东高速	400	2,548.00	0.00
439	600032	浙江新能	200	2,512.00	0.00
440	002399	海普瑞	200	2,294.00	0.00
441	601158	重庆水务	400	2,224.00	0.00
442	600995	南网储能	200	2,202.00	0.00
443	600956	新天绿能	200	1,744.00	0.00
444	600299	安迪苏	200	1,594.00	0.00
445	000540	*ST 中天	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(%)
1	688777	中控技术	2,071,019.72	0.09
2	688122	西部超导	1,905,093.10	0.08
3	600563	法拉电子	1,831,520.00	0.08
4	688099	晶晨股份	1,776,348.77	0.08
5	603605	珀莱雅	1,757,822.00	0.08
6	603345	安井食品	1,747,974.00	0.08
7	002340	格林美	1,727,316.00	0.08
8	002850	科达利	1,687,097.00	0.07
9	300012	华测检测	1,673,151.00	0.07
10	002384	东山精密	1,653,839.00	0.07
11	603688	石英股份	1,465,448.00	0.06
12	600157	永泰能源	1,448,925.00	0.06
13	300073	当升科技	1,446,842.50	0.06
14	300003	乐普医疗	1,420,208.00	0.06
15	002422	科伦药业	1,413,172.00	0.06
16	300724	捷佳伟创	1,393,144.44	0.06
17	300418	昆仑万维	1,379,429.00	0.06
18	300308	中际旭创	1,374,924.00	0.06
19	603737	三棵树	1,329,077.00	0.06
20	000807	云铝股份	1,296,980.00	0.06

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	688063	派能科技	92,699.73	0.00
2	603281	江瀚新材	57,268.41	0.00

3	688088	虹软科技	50,241.27	0.00
4	603173	福斯达	18,712.16	0.00
5	000990	诚志股份	3,111.00	0.00

注：报告期内，本基金累计卖出金额前 20 名的股票明细仅包括上述 5 只股票。

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	294,371,231.10
卖出股票收入（成交）总额	222,032.57

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

无。

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

无。

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 500ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	嘉实基金管理有限公司	2,192,736,943.80	93.88

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	2,165,957.55
2	应收清算款	3,239.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,628,635.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,797,832.18

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	133,357	8,840.48	381,832,420.20	32.39	797,106,990.07	67.61
嘉实中证 500ETF 联接 C	27,997	8,200.20	95,647,872.03	41.66	133,933,109.76	58.34
合计	159,020	8,857.50	477,480,292.23	33.90	931,040,099.83	66.10

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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	607,844.35	0.05
	嘉实中证 500ETF 联接 C	21,530.72	0.01
	合计	629,375.07	0.04

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	0~10
	嘉实中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实中证 500ETF 联接 A	0~10
	嘉实中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0~10

§ 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
基金合同生效日 (2013 年 3 月 22 日)	292,915,388.83	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	1,166,059,366.03	260,030,458.78
本报告期基金总申购份额	130,190,005.01	241,953,448.58
减:本报告期基金总赎回份额	117,309,960.77	272,402,925.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,178,939,410.27	229,580,981.79

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。

§ 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

2023 年 4 月 29 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》,张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》,程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日,本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》,姚志鹏先生任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内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

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	1	150,094,999.58	50.96	105,068.72	53.53	-
开源证券股份有限公司	1	144,456,583.72	49.04	91,212.14	46.47	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
广发证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

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. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。
4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国盛证券有限责任公司退租交易单元 1 个。
5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：银泰证券有限责任公司新增交易单元 1 个，中航证券有限公司新增交易单元 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 (%)
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	335,479,953.71	100.00
开源证券股份有限公司	20,097.70	100.00	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

高盛 (中国) 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 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	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	2023 年 3 月 21 日
2	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	2023 年 4 月 29 日
3	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	2023 年 6 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023-01-01 至 2023-06-30	316,524,736.45	-	-	316,524,736.45	22.47
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 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

- 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

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

2023 年 8 月 29 日