

嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2026 年中期报告

2026 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	10
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 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	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
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	56

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	56
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	56
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	57
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.13 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 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 A500ETF 联接		
基金主代码	022453		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	1, 299, 504, 456. 60 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 A500ETF 联接 A	嘉实中证 A500ETF 联接 C	嘉实中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交 易代码	022453	022454	022905
报告期末下属分级 基金的份额总额	429, 732, 896. 52 份	831, 963, 433. 54 份	37, 808, 126. 54 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159351
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 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	兴业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，力争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 实现对标的指数的紧密跟踪。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投资目标所述范围，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。具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为嘉实中证 A500ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实中证 A500ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 A500 指数及嘉实中证 A500ETF 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，力争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%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，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。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	冯萌
	联系电话	(010)65215588	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95561
传真		(010)65215588	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		100020	200120
法定代表人		经雷	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	嘉实中证 A500ETF 联接 A	嘉实中证 A500ETF 联接 C	嘉实中证 A500ETF 联接 Y
本期已实现收益	41,878,456.99	82,740,142.48	3,037,677.25
本期利润	63,689,097.40	143,718,564.00	4,902,757.03
加权平均基金份额本期利润	0.1280	0.1440	0.1407
本期加权平均净值利润率	10.31%	11.62%	11.32%
本期基金份额净值增长率	11.69%	11.58%	11.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	60,563,745.91	116,003,743.55	5,305,850.88
期末可供分配基金份额利润	0.1409	0.1394	0.1403
期末基金资产净值	568,215,408.35	1,098,612,780.41	49,968,634.80

期末基金份额净值	1.3223	1.3205	1.3216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	34.43%	33.99%	36.86%

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 A500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.97%	1.33%	13.54%	1.34%	0.43%	-0.01%
过去六个月	11.69%	1.22%	11.34%	1.22%	0.35%	0.00%
过去一年	35.89%	1.09%	34.41%	1.09%	1.48%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.43%	1.06%	27.10%	1.07%	7.33%	-0.01%

嘉实中证 A500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.91%	1.33%	13.54%	1.34%	0.37%	-0.01%
过去六个月	11.58%	1.22%	11.34%	1.22%	0.24%	0.00%
过去一年	35.62%	1.09%	34.41%	1.09%	1.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	33.99%	1.06%	27.10%	1.07%	6.89%	-0.01%

嘉实中证 A500ETF 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
过去三个月	13.97%	1.33%	13.54%	1.34%	0.43%	-0.01%
过去六个月	11.69%	1.22%	11.34%	1.22%	0.35%	0.00%
过去一年	35.88%	1.09%	34.41%	1.09%	1.47%	0.00%
自基金合同生效起至今	36.86%	1.06%	33.93%	1.06%	2.93%	0.00%

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：

$$\text{Return}(t)=(\text{中证 A500 指数}(t)/\text{中证 A500 指数}(t-1)-1)\times 95\%+((1+\text{银行活期存款利率(税后)})^{1/365}-1)\times 5\%$$

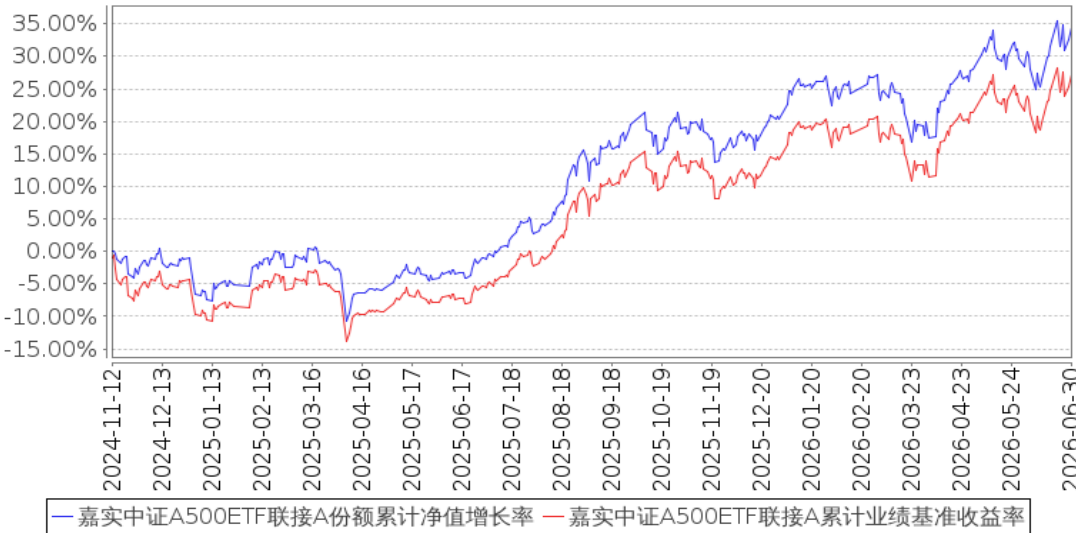
$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t))\times (1+\text{Benchmark}(t-1))-1$$

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

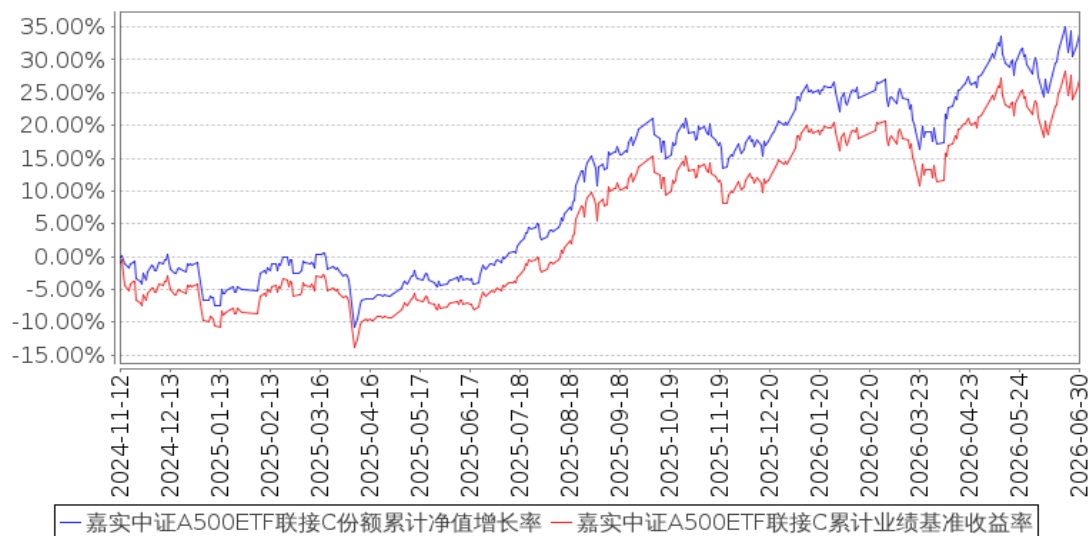
嘉实中证A500ETF联接A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024年11月12日至2026年06月30日)



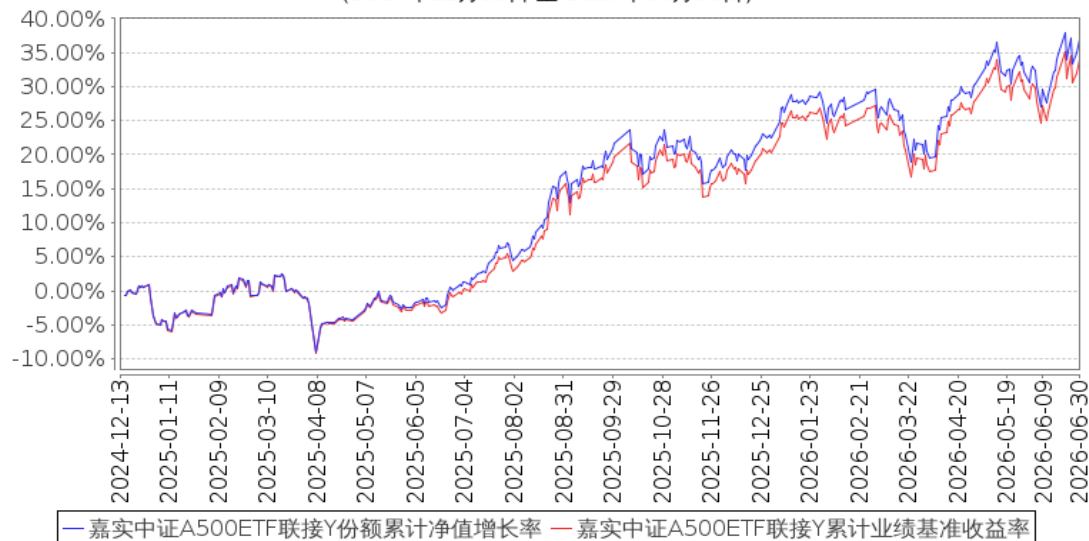
嘉实中证A500ETF联接C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024年11月12日至2026年06月30日)



嘉实中证A500ETF联接Y份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024年12月13日至2026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 6 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金字[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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 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、不动产基金等不同类别。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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF 发起联接、嘉实中证国新央企现代能源 ETF、嘉实中证国新央企现代能源 ETF	2024 年 11 月 12 日	-	17 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	联接、嘉 实 中 证 A500ETF 基金经理				
张超 梁	本基金、 嘉实中创 400ETF、 嘉实中创 400ETF 联 接、嘉实 中证信息 安全主题 ETF、嘉实 中证高端 装备细分 50ETF、嘉 实中证细 分化工产 业 主 题 ETF 发起 联接、嘉 实中证高 端装备细 分 50ETF 发 起 联 接、嘉实 中 证 A500ETF、 嘉实创业 板 50ETF、 嘉实创业 板 50ETF 联接、嘉 实中证港 股通创新 药 ETF、嘉 实恒生港 股通科技 主题 ETF、 嘉实中证 港股通创 新药 ETF 发 起 联 接、嘉实 恒指港股	2024 年 11 月 12 日	-	12 年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任 SmartBeta 和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	通 ETF、嘉 实恒生港 股通科技 主题 ETF 联接、嘉 实中证细 分化工产 业主题 ETF 基金 经理				
--	--	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 A500 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 3 次，其中 2 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，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，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

本基金跟踪中证 A500 指数，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。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。

2026 年上半年，中国经济延续“稳中向新”态势。生产端工业保持韧性，高技术产业与装备制造业表现亮眼，AI 产业链带动效应持续，新质生产力加快培育。需求端投资结构持续优化，基建托底发力，消费稳步释放，出口发挥稳定锚作用。价格端积极变化增多，物价温和回升，企业盈利预期修复。服务业贡献提升，制造业高端化智能化升级明确。政策协同精准有力，总体运行在合理区间。美国上半年经济呈现“前高后低”格局。通胀粘性取代回落预期成为核心矛盾，核心物价持续处于高位。美联储新任主席释放鹰派信号，市场对政策路径的预期在降息、观望与加息之间反复摇摆；中东地缘冲突推升能源价格，进一步加剧通胀压力。欧元区上半年受能源冲击叠加内需疲软，制造业景气持续低迷，通胀快速反弹，欧洲央行在压力下近三年首次加息，成为本轮全球紧缩周期中率先行动的主要央行，利率与增长的两难困境进一步加剧。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.32%，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 A500ETF 联接 A 基金份额净值为 1.3223 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.69%；截至本报告期末嘉实中证 A500ETF 联接 C 基金份额净值为 1.3205 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.58%；截至本报告期末嘉实中证 A500ETF 联接 Y 基金份额净值为 1.3216 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.69%；业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望在“结构分化”中走向“盈利修复”。外需与高技术制造保持韧性的同时，下半年财政支出有望加快落地，货币政策维持适度宽松，为内需回暖提供支撑。产业层面，AI 算力、半导体、高端装备等硬科技赛道受益全球产业周期上行和自主可控，业绩可见度持续提升。权益市场或将从“估值扩张”驱动切换至“业绩验证”驱动。风险上仍需关注海外加息预期扰动与贸易摩擦升温对外需和风险偏好的阶段性冲击。

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，本基金实施了利润分配，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	91,987,933.75	112,320,024.27
结算备付金		79,863.53	208,474.06
存出保证金		330,553.22	1,327,340.43
交易性金融资产	6.4.7.2	1,630,587,016.53	1,828,364,688.00
其中：股票投资		21,398,012.40	—
基金投资		1,609,188,004.12	1,828,364,688.00
债券投资		1,000.01	—
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		2,666,193.32	—
应收股利		—	—
应收申购款		2,625,715.16	6,207,398.67
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		1,728,277,275.51	1,948,427,925.43
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		10,374,332.15	19,972,060.53
应付管理人报酬		12,717.02	12,574.37
应付托管费		4,238.99	4,191.43
应付销售服务费		179,398.91	235,372.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		819,446.79	499,563.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	90,318.09	53,147.29
负债合计		11,480,451.95	20,776,909.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,299,504,456.60	1,623,082,321.77
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	417,292,366.96	304,568,694.41
净资产合计		1,716,796,823.56	1,927,651,016.18
负债和净资产总计		1,728,277,275.51	1,948,427,925.43

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实中证 A500ETF 联接 A 基金份额净值 1.3223 元，基金份额总额 429,732,896.52 份，嘉实中证 A500ETF 联接 C 基金份额净值 1.3205 元，基金份额总额 831,963,433.54 份，嘉实中证 A500ETF 联接 Y 基金份额净值 1.3216 元，基金份额总额 37,808,126.54 份，基金份额总额合计为 1,299,504,456.60 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		214,151,654.37	80,117,754.12
1. 利息收入		198,435.86	431,494.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	198,435.86	431,494.38
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）		129,200,457.31	-6,781,803.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	550,757.73	480,458.41

基金投资收益	6.4.7.15	116,127,726.74	-16,072,888.76
债券投资收益	6.4.7.16	3,793.71	3,209.28
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	12,518,179.13	8,807,417.44
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	84,654,141.71	86,332,752.09
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	98,619.49	135,311.28
减：二、营业总支出		1,841,235.94	3,639,608.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	74,123.88	166,634.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,708.02	55,544.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,228,043.73	3,313,242.83
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		412,094.32	-
8. 其他费用	6.4.7.24	102,265.99	104,186.19
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		212,310,418.43	76,478,146.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		212,310,418.43	76,478,146.01
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		212,310,418.43	76,478,146.01

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1,623,082,321.	-	304,568,694.41	1,927,651,016.1

	77			8
二、本期期初净资产	1,623,082,321.77	-	304,568,694.41	1,927,651,016.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-323,577,865.17	-	112,723,672.55	-210,854,192.62
(一)、综合收益总额	-	-	212,310,418.43	212,310,418.43
(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)	-323,577,865.17	-	-92,708,393.77	-416,286,258.94
其中：1. 基金申购款	740,497,540.60	-	170,022,382.12	910,519,922.72
2. 基金赎回款	-1,064,075,405.77	-	-262,730,775.89	-1,326,806,181.66
(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)	-	-	-6,878,352.11	-6,878,352.11
四、本期期末净资产	1,299,504,456.60	-	417,292,366.96	1,716,796,823.56
项目	上年度可比期间 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	5,049,174,028.11	-	-131,827,077.48	4,917,346,950.63
二、本期期初净资产	5,049,174,028.11	-	-131,827,077.48	4,917,346,950.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,006,715,100.19	-	83,581,451.21	-923,133,648.98
(一)、综合收益总额	-	-	76,478,146.01	76,478,146.01
(二)、本期基金份额交易产生的	-1,006,715,100	-	8,367,764.39	-998,347,335.80

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	. 19			
其中：1. 基金申 购款	1, 139, 598, 256. 76	-	-42, 618, 740. 12	1, 096, 979, 516. 6 4
2. 基金赎 回款	-2, 146, 313, 356 . 95	-	50, 986, 504. 51	-2, 095, 326, 852. 44
(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)	-	-	-1, 264, 459. 19	-1, 264, 459. 19
四、本期期末净 资产	4, 042, 458, 927. 92	-	-48, 245, 626. 27	3, 994, 213, 301. 6 5

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

梁凯

李袁

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 A500 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[2024]1431 号《关于准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》注册，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 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2024 年 11 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,002,382,690.07 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027年12月31日前,资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为,可以选择适用简易计税方法,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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	91,987,933.75
等于：本金	91,978,576.04
加：应计利息	9,357.71
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	91,987,933.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,381,755.30	-	21,398,012.40	1,016,257.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.01	1,000.01	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.01	1,000.01	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,236,819,958.70	-	1,609,188,004.12	372,368,045.42
其他		-	-	-	-
合计		1,257,202,714.00	0.01	1,630,587,016.53	373,384,302.52

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	65.85
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,941.56
其中：交易所市场	6,941.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,310.68
合计	90,318.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 A500ETF 联接 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	433,542,192.60	433,542,192.60
本期申购	254,920,313.21	254,920,313.21
本期赎回（以“-”号填列）	-258,729,609.29	-258,729,609.29
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	429,732,896.52	429,732,896.52

嘉实中证 A500ETF 联接 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,164,160,937.43	1,164,160,937.43
本期申购	464,016,080.28	464,016,080.28
本期赎回（以“-”号填列）	-796,213,584.17	-796,213,584.17
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	831,963,433.54	831,963,433.54

嘉实中证 A500ETF 联接 Y

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,379,191.74	25,379,191.74
本期申购	21,561,147.11	21,561,147.11
本期赎回（以“-”号填列）	-9,132,212.31	-9,132,212.31
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	37,808,126.54	37,808,126.54

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 A500ETF 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	25,792,448.10	55,975,426.13	81,767,874.23
本期期初	25,792,448.10	55,975,426.13	81,767,874.23
本期利润	41,878,456.99	21,810,640.41	63,689,097.40
本期基金份额交易产生的变动数	-4,560,977.81	132,699.38	-4,428,278.43
其中：基金申购款	20,330,828.18	39,964,459.59	60,295,287.77
基金赎回款	-24,891,805.99	-39,831,760.21	-64,723,566.20
本期已分配利润	-2,546,181.37	-	-2,546,181.37
本期末	60,563,745.91	77,918,765.92	138,482,511.83

嘉实中证 A500ETF 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	67,926,592.07	150,099,361.88	218,025,953.95
本期期初	67,926,592.07	150,099,361.88	218,025,953.95
本期利润	82,740,142.48	60,978,421.52	143,718,564.00
本期基金份额交易产生的变动数	-30,502,295.32	-60,432,180.08	-90,934,475.40
其中：基金申购款	38,190,218.18	66,521,349.95	104,711,568.13
基金赎回款	-68,692,513.50	-126,953,530.03	-195,646,043.53
本期已分配利润	-4,160,695.68	-	-4,160,695.68
本期末	116,003,743.55	150,645,603.32	266,649,346.87

嘉实中证 A500ETF 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	1,497,980.31	3,276,885.92	4,774,866.23
本期期初	1,497,980.31	3,276,885.92	4,774,866.23
本期利润	3,037,677.25	1,865,079.78	4,902,757.03
本期基金份额交易产生的变动数	941,668.38	1,712,691.68	2,654,360.06
其中：基金申购款	1,828,326.26	3,187,199.96	5,015,526.22
基金赎回款	-886,657.88	-1,474,508.28	-2,361,166.16
本期已分配利润	-171,475.06	-	-171,475.06
本期末	5,305,850.88	6,854,657.38	12,160,508.26

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	190,289.69
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	461.65

其他	7,684.52
合计	198,435.86

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-29,305.57
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	580,063.30
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	550,757.73

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	1,072,726.99
减：卖出股票成本总额	1,081,585.56
减：交易费用	20,447.00
买卖股票差价收入	-29,305.57

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 2026年1月1日至2026年6月30日
申购基金份额总额	132,174,000.00
减：现金支付申购款总额	70,505,068.70
减：申购股票成本总额	61,088,868.00
减：交易费用	-
申购差价收入	580,063.30

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	619,821,727.27

减：卖出/赎回基金成本总额	500,232,200.36
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	3,434,119.38
减：交易费用	27,680.79
基金投资收益	116,127,726.74

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4,053.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-260.00
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	3,793.71

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,838,360.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,800,260.00
减：应计利息总额	38,360.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-260.00

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

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	90,718.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	12,427,461.00
合计	12,518,179.13

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	84,654,141.71
股票投资	1,016,257.10
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	83,637,884.61
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
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	84,654,141.71

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	95,499.43
基金转出费收入	3,120.06
合计	98,619.49

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,955.31
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	102,265.99

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、关联关系

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 A500 交易型开放式指数证券投	本基金是该基金的联接基金

资基金(“目标 ETF”)	
---------------	--

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	74,123.88	166,634.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	578,842.03	1,445,215.87
应支付基金管理人的净管理费	-504,718.15	-1,278,581.53

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,708.02	55,544.75

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 A500ETF 联接 A	嘉实中证 A500ETF 联接 C	嘉实中证 A500ETF 联接 Y	合计
嘉实基金管理有限公司	-	50,337.08	-	50,337.08
兴业银行	-	664,143.35	-	664,143.35
嘉实财富	-	5,013.05	-	5,013.05
合计	-	719,493.48	-	719,493.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 A500ETF 联接 A	嘉实中证 A500ETF 联接 C	嘉实中证 A500ETF 联接 Y	合计
嘉实基金管理有限公司	-	136,404.09	-	136,404.09
兴业银行	-	2,428,776.44	-	2,428,776.44
嘉实财富	-	7,261.20	-	7,261.20
合计	-	2,572,441.73	-	2,572,441.73

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，每日计提，逐日累计至每月月底，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×0.20%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
兴业银行股份有限公司_活期	91,987,933.75	190,289.69	240,060,197.08	414,137.56

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(2026 年 06 月 30 日)，本基金持有 1,194,557,200.00 份目标 ETF 基金份额(2025 年 12 月 31 日:1,519,080,000.00 份)，占其总份额的比例为 20.16%(2025 年 12 月 31 日:17.27%)。

报告期末(2026 年 06 月 30 日)，本基金持有 11,200 股兴业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 185,472.00 元，占基金资产净值的比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：0 股，估值总额为人民币 0.00 元，占基金资产净值的比例为 0.00%）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实中证 A500ETF 联接 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2 月 13 日	-	2026 年 2 月 13 日	0.0390	1,505,356 .76	533,843.09	2,039,199 .85	-
2	2026 年 5 月 19 日	-	2026 年 5 月 19 日	0.0110	373,200.5 5	133,780.97	506,981.5 2	-
合计	-	-	-	0.0500	1,878,557 .31	667,624.06	2,546,181 .37	-
嘉实中证 A500ETF 联接 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2 月 13 日	-	2026 年 2 月 13 日	0.0380	3,537,248 .60	446,871.76	3,984,120 .36	-
2	2026 年 5 月 19 日	-	2026 年 5 月 19 日	0.0020	154,030.1 5	22,545.17	176,575.3 2	-
合计	-	-	-	0.0400	3,691,278 .75	469,416.93	4,160,695 .68	-
嘉实中证 A500ETF 联接 Y								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2 月 13 日	-	2026 年 2 月 13 日	0.0380	3,252.68	120,292.51	123,545.1 9	-
2	2026 年 5 月 19 日	-	2026 年 5 月 19 日	0.0130	1,280.23	46,649.64	47,929.87	-
合计	-	-	-	0.0510	4,532.91	166,942.15	171,475.0 6	-

6.4.12 期末（2026 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

111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.01	-
--------	------	-----------------	-----------	-------	--------	--------	----	----------	----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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，还有董事会合规与风险控制委员会、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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,000.01	-
未评级	-	-
合计	1,000.01	-

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同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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 2026 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	91,987,933.75	-	-	-	91,987,933.75
结算备付金	79,863.53	-	-	-	79,863.53
存出保证金	330,553.22	-	-	-	330,553.22
交易性金融资产	-	-	1,000.01	1,630,586,016.52	1,630,587,016.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,666,193.32	2,666,193.32
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,625,715.16	2,625,715.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,398,350.50	-	1,000.01	1,635,877,925.00	1,728,277,275.51
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,374,332.15	10,374,332.15
应付管理人报酬	-	-	-	12,717.02	12,717.02
应付托管费	-	-	-	4,238.99	4,238.99
应付销售服务费	-	-	-	179,398.91	179,398.91
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	819,446.79	819,446.79
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,318.09	90,318.09
负债总计	-	-	-	11,480,451.95	11,480,451.95
利率敏感度缺口	92,398,350.50	-	1,000.01	1,624,397,473.05	1,716,796,823.56
上年度末 2025 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	112,320,024.27	-	-	-	112,320,024.27

结算备付金	208,474.06	-	-	-	208,474.06
存出保证金	1,327,340.43	-	-	-	1,327,340.43
交易性金融资产	-	-	-	1,828,364,688.00	1,828,364,688.00
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	-	-	-	6,207,398.67	6,207,398.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	113,855,838.76	-	-	1,834,572,086.67	1,948,427,925.43
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	19,972,060.53	19,972,060.53
应付管理人报酬	-	-	-	12,574.37	12,574.37
应付托管费	-	-	-	4,191.43	4,191.43
应付销售服务费	-	-	-	235,372.28	235,372.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	499,563.35	499,563.35
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	53,147.29	53,147.29
负债总计	-	-	-	20,776,909.25	20,776,909.25
利率敏感度缺口	113,855,838.76	-	-	1,813,795,177.42	1,927,651,016.18

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	14.67	-
	市场利率上升 25 个基点	-14.42	-

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	21,398,012.40	1.25	—	—
交易性金融资产—基金投资	1,609,188,004.12	93.73	1,828,364,688.00	94.85
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	1,630,586,016.52	94.98	1,828,364,688.00	94.85

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	85,480,418.17	96,308,602.36
	业绩比较基准下降5%	-85,480,418.17	-96,308,602.36

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
---------------	-------------------	---------------------

第一层次	1,630,586,016.52	1,828,364,688.00
第二层次	1,000.01	—
第三层次	—	—
合计	1,630,587,016.53	1,828,364,688.00

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	21,398,012.40	1.24
	其中：股票	21,398,012.40	1.24
2	基金投资	1,609,188,004.12	93.11
3	固定收益投资	1,000.01	0.00
	其中：债券	1,000.01	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	—	—

7	银行存款和结算备付金合计	92,067,797.28	5.33
8	其他各项资产	5,622,461.70	0.33
9	合计	1,728,277,275.51	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	69,014.00	0.00
B	采矿业	906,163.00	0.05
C	制造业	14,985,695.37	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	474,519.00	0.03
E	建筑业	270,036.00	0.02
F	批发和零售业	151,726.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	490,688.00	0.03
H	住宿和餐饮业	9,765.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,216,237.03	0.07
J	金融业	2,127,574.00	0.12
K	房地产业	121,178.00	0.01
L	租赁和商务服务业	163,419.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	269,962.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	36,146.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,200.00	0.00
Q	卫生和社会工作	42,945.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	17,481.00	0.00
S	综合	38,264.00	0.00
	合计	21,398,012.40	1.25

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	300308	中际旭创	800	1,016,000.00	0.06
2	300750	宁德时代	1,800	707,418.00	0.04
3	300502	新易盛	940	570,580.00	0.03
4	600519	贵州茅台	400	474,196.00	0.03
5	688256	寒武纪	215	343,043.25	0.02

6	601318	中国平安	7,100	338,954.00	0.02
7	603986	兆易创新	400	326,000.00	0.02
8	600036	招商银行	8,200	291,100.00	0.02
9	601899	紫金矿业	10,900	274,026.00	0.02
10	002371	北方华创	300	265,368.00	0.02
11	688008	澜起科技	783	242,651.70	0.01
12	000333	美的集团	3,200	241,696.00	0.01
13	002475	立讯精密	3,400	239,360.00	0.01
14	002384	东山精密	900	236,115.00	0.01
15	688041	海光信息	636	235,510.80	0.01
16	688981	中芯国际	1,368	217,265.76	0.01
17	600900	长江电力	8,100	214,407.00	0.01
18	603259	药明康德	1,700	211,667.00	0.01
19	688012	中微公司	447	209,419.50	0.01
20	000725	京东方 A	24,000	208,320.00	0.01
21	600030	中信证券	6,500	186,745.00	0.01
22	601166	兴业银行	11,200	185,472.00	0.01
23	300059	东方财富	8,400	171,192.00	0.01
24	300274	阳光电源	1,000	159,020.00	0.01
25	600276	恒瑞医药	3,000	156,120.00	0.01
26	600183	生益科技	900	156,060.00	0.01
27	601398	工商银行	21,300	150,591.00	0.01
28	300408	三环集团	900	150,210.00	0.01
29	002594	比亚迪	1,800	143,460.00	0.01
30	600487	亨通光电	1,300	142,142.00	0.01
31	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.01
32	002463	沪电股份	900	137,520.00	0.01
33	601211	国泰海通	7,500	136,500.00	0.01
34	000988	华工科技	700	129,227.00	0.01
35	300394	天孚通信	420	127,125.60	0.01
36	688525	佰维存储	248	122,693.04	0.01
37	600176	中国巨石	1,600	116,608.00	0.01
38	601288	农业银行	19,000	115,330.00	0.01
39	601328	交通银行	17,600	113,168.00	0.01
40	000651	格力电器	3,000	112,500.00	0.01
41	600522	中天科技	1,800	109,224.00	0.01
42	603019	中科曙光	1,000	107,230.00	0.01
43	600584	长电科技	1,000	103,550.00	0.01
44	300604	长川科技	300	102,426.00	0.01
45	603993	洛阳钼业	5,800	101,790.00	0.01
46	600150	中国船舶	3,000	101,370.00	0.01
47	600887	伊利股份	4,200	100,632.00	0.01
48	000338	潍柴动力	3,600	98,100.00	0.01

49	000858	五 粮 液	1,300	96,200.00	0.01
50	688521	芯原股份	252	93,527.28	0.01
51	688120	华海清科	280	90,210.40	0.01
52	688347	华虹宏力	268	90,128.40	0.01
53	600309	万华化学	1,300	88,933.00	0.01
54	601816	京沪高铁	19,400	87,882.00	0.01
55	300124	汇川技术	1,300	86,229.00	0.01
56	002415	海康威视	2,500	85,500.00	0.00
57	600111	北方稀土	1,700	81,685.00	0.00
58	000100	TCL 科技	13,700	79,734.00	0.00
59	000063	中兴通讯	2,200	79,618.00	0.00
60	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.00
61	600089	特变电工	3,400	76,500.00	0.00
62	600000	浦发银行	8,800	75,768.00	0.00
63	300433	蓝思科技	1,400	75,124.00	0.00
64	002008	大族激光	500	75,055.00	0.00
65	601088	中国神华	1,900	74,176.00	0.00
66	601857	中国石油	8,500	73,780.00	0.00
67	300136	信维通信	600	71,550.00	0.00
68	301308	江波龙	100	70,380.00	0.00
69	002028	思源电气	400	69,200.00	0.00
70	600031	三一重工	4,000	69,120.00	0.00
71	600549	厦门钨业	800	68,160.00	0.00
72	300857	协创数据	200	67,980.00	0.00
73	002050	三花智控	1,500	65,745.00	0.00
74	601601	中国太保	2,300	65,596.00	0.00
75	300014	亿纬锂能	1,000	65,030.00	0.00
76	000001	平安银行	6,400	64,320.00	0.00
77	000792	盐湖股份	2,100	63,399.00	0.00
78	002714	牧原股份	1,800	62,982.00	0.00
79	600406	国电南瑞	2,700	61,695.00	0.00
80	002436	兴森科技	1,200	61,140.00	0.00
81	002353	杰瑞股份	400	61,000.00	0.00
82	002156	通富微电	800	60,696.00	0.00
83	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.00
84	601668	中国建筑	13,600	59,024.00	0.00
85	000657	中钨高新	600	57,432.00	0.00
86	603501	豪威集团	600	56,910.00	0.00
87	601919	中远海控	4,200	55,692.00	0.00
88	600660	福耀玻璃	1,100	55,484.00	0.00
89	601988	中国银行	9,500	54,340.00	0.00
90	300760	迈瑞医疗	400	54,332.00	0.00
91	002602	世纪华通	3,800	53,580.00	0.00

92	601728	中国电信	10,300	53,457.00	0.00
93	002230	科大讯飞	1,300	53,092.00	0.00
94	300054	鼎龙股份	500	52,985.00	0.00
95	601225	陕西煤业	2,600	52,910.00	0.00
96	002938	鹏鼎控股	500	52,690.00	0.00
97	601012	隆基绿能	4,000	52,480.00	0.00
98	002460	赣锋锂业	800	52,320.00	0.00
99	600941	中国移动	600	51,678.00	0.00
100	002709	天赐材料	1,000	51,430.00	0.00
101	600690	海尔智家	2,500	51,025.00	0.00
102	688777	中控技术	433	50,877.50	0.00
103	002352	顺丰控股	1,600	50,016.00	0.00
104	300223	北京君正	200	49,780.00	0.00
105	601985	中国核电	5,500	49,665.00	0.00
106	000977	浪潮信息	700	49,000.00	0.00
107	603799	华友钴业	1,000	48,260.00	0.00
108	300033	同花顺	200	48,200.00	0.00
109	600160	巨化股份	900	47,709.00	0.00
110	002916	深南电路	100	45,790.00	0.00
111	600460	士兰微	800	43,728.00	0.00
112	000425	徐工机械	5,400	43,686.00	0.00
113	601600	中国铝业	5,300	43,566.00	0.00
114	600938	中国海油	1,600	43,440.00	0.00
115	688126	沪硅产业	1,088	43,400.32	0.00
116	000938	紫光股份	1,500	43,290.00	0.00
117	300661	圣邦股份	300	43,044.00	0.00
118	002202	金风科技	1,800	43,020.00	0.00
119	002466	天齐锂业	700	42,924.00	0.00
120	600028	中国石化	9,600	42,816.00	0.00
121	688111	金山办公	200	42,610.00	0.00
122	601766	中国中车	8,100	42,120.00	0.00
123	002600	领益智造	2,400	41,616.00	0.00
124	002179	中航光电	900	41,580.00	0.00
125	300442	润泽科技	500	41,535.00	0.00
126	600050	中国联通	10,300	41,200.00	0.00
127	688271	联影医疗	400	40,492.00	0.00
128	002407	多氟多	800	40,184.00	0.00
129	002185	华天科技	1,800	40,158.00	0.00
130	300395	菲利华	300	40,119.00	0.00
131	688396	华润微	400	39,020.00	0.00
132	688002	睿创微纳	252	38,981.88	0.00
133	601628	中国人寿	1,100	38,885.00	0.00
134	000568	泸州老窖	500	38,760.00	0.00

135	601872	招商轮船	2,200	38,654.00	0.00
136	600879	航天电子	1,800	38,322.00	0.00
137	002241	歌尔股份	1,700	38,301.00	0.00
138	601888	中国中免	700	37,597.00	0.00
139	300390	天华新能	400	37,404.00	0.00
140	300346	南大光电	400	37,060.00	0.00
141	002837	英维克	460	36,597.60	0.00
142	002138	顺络电子	500	36,550.00	0.00
143	603288	海天味业	1,100	36,476.00	0.00
144	601006	大秦铁路	7,900	36,419.00	0.00
145	600489	中金黄金	2,000	36,100.00	0.00
146	002080	中材科技	400	36,000.00	0.00
147	601658	邮储银行	7,300	35,989.00	0.00
148	002049	紫光国微	400	35,500.00	0.00
149	002273	水晶光电	1,000	35,480.00	0.00
150	600905	三峡能源	9,500	35,245.00	0.00
151	688469	芯联集成	3,310	35,119.10	0.00
152	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.00
153	600893	航发动力	900	34,506.00	0.00
154	601689	拓普集团	600	33,852.00	0.00
155	000630	铜陵有色	5,300	33,708.00	0.00
156	600673	东阳光	1,000	33,580.00	0.00
157	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.00
158	002625	光启技术	1,100	33,352.00	0.00
159	600010	包钢股份	14,900	33,227.00	0.00
160	300058	蓝色光标	2,400	33,024.00	0.00
161	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.00
162	600118	中国卫星	400	32,820.00	0.00
163	002027	分众传媒	6,700	32,428.00	0.00
164	601100	恒立液压	300	32,268.00	0.00
165	605117	德业股份	300	31,854.00	0.00
166	300567	精测电子	100	31,760.00	0.00
167	600019	宝钢股份	5,800	31,494.00	0.00
168	002001	新 和 成	1,100	31,262.00	0.00
169	000807	云铝股份	1,400	30,996.00	0.00
170	002422	科伦药业	800	30,816.00	0.00
171	601127	赛力斯	500	30,625.00	0.00
172	600989	宝丰能源	1,500	30,495.00	0.00
173	600362	江西铜业	700	30,310.00	0.00
174	600104	上汽集团	3,100	30,256.00	0.00
175	000960	锡业股份	700	29,883.00	0.00
176	601168	西部矿业	1,100	29,854.00	0.00
177	600392	盛和资源	1,000	29,770.00	0.00

178	002738	中矿资源	500	29,495.00	0.00
179	601727	上海电气	4,200	29,400.00	0.00
180	600667	太极实业	1,000	29,180.00	0.00
181	600988	赤峰黄金	1,100	28,952.00	0.00
182	600760	中航沈飞	700	28,770.00	0.00
182	600875	东方电气	1,000	28,770.00	0.00
183	300450	先导智能	700	28,504.00	0.00
184	000538	云南白药	600	28,422.00	0.00
185	600418	江淮汽车	1,100	28,413.00	0.00
186	601390	中国中铁	6,800	28,356.00	0.00
187	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.00
188	002648	卫星化学	1,200	28,188.00	0.00
189	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.00
190	000831	中国稀土	500	27,745.00	0.00
191	600547	山东黄金	1,200	27,708.00	0.00
192	600885	宏发股份	800	27,592.00	0.00
193	600795	国电电力	5,900	27,553.00	0.00
194	600096	云天化	900	27,360.00	0.00
195	600585	海螺水泥	1,600	27,120.00	0.00
196	601669	中国电建	5,700	26,790.00	0.00
197	002812	恩捷股份	400	26,764.00	0.00
198	002129	TCL 中环	2,200	26,444.00	0.00
199	600482	中国动力	800	26,240.00	0.00
200	300015	爱尔眼科	3,100	25,606.00	0.00
201	605589	圣泉集团	400	25,428.00	0.00
202	601179	中国西电	1,700	25,364.00	0.00
203	688122	西部超导	400	25,124.00	0.00
204	002126	银轮股份	500	24,900.00	0.00
205	002195	岩山科技	3,800	24,852.00	0.00
206	601868	中国能建	9,300	24,831.00	0.00
207	002558	巨人网络	900	24,804.00	0.00
208	600346	恒力石化	1,400	24,794.00	0.00
209	000066	中国长城	1,300	24,765.00	0.00
210	600497	驰宏锌锗	2,000	24,220.00	0.00
211	300418	昆仑万维	600	24,216.00	0.00
212	688036	传音控股	410	24,169.50	0.00
213	300316	晶盛机电	400	24,160.00	0.00
214	600066	宇通客车	900	24,129.00	0.00
215	600426	华鲁恒升	1,000	23,920.00	0.00
216	688099	晶晨股份	230	23,667.00	0.00
217	000625	长安汽车	3,300	23,661.00	0.00
218	600141	兴发集团	500	23,485.00	0.00
219	000933	神火股份	1,100	23,320.00	0.00

220	600157	永泰能源	14,400	23,184.00	0.00
221	600143	金发科技	1,500	23,175.00	0.00
222	600580	卧龙电驱	700	23,170.00	0.00
223	000157	中联重科	3,300	23,001.00	0.00
224	600221	海航控股	16,900	22,815.00	0.00
225	301358	湖南裕能	300	22,761.00	0.00
226	002532	天山铝业	2,100	22,533.00	0.00
227	002340	格林美	3,400	22,474.00	0.00
228	600895	张江高科	600	22,350.00	0.00
229	600048	保利发展	4,800	22,224.00	0.00
230	300017	网宿科技	1,700	22,117.00	0.00
231	600011	华能国际	2,900	22,011.00	0.00
232	600711	盛屯矿业	2,000	21,940.00	0.00
233	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.00
234	600436	片仔癀	200	21,856.00	0.00
235	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.00
236	600352	浙江龙盛	1,800	21,798.00	0.00
236	600438	通威股份	1,800	21,798.00	0.00
237	002456	欧菲光	2,300	21,758.00	0.00
238	600115	中国东航	5,700	21,717.00	0.00
239	601233	桐昆股份	1,000	21,650.00	0.00
240	002493	荣盛石化	2,000	21,500.00	0.00
241	002236	大华股份	1,300	21,437.00	0.00
242	688213	思特威	200	21,414.00	0.00
243	002131	利欧股份	4,500	21,375.00	0.00
244	600886	国投电力	1,600	21,296.00	0.00
245	600570	恒生电子	1,000	21,190.00	0.00
246	601360	三六零	2,400	20,856.00	0.00
247	002555	三七互娱	1,100	20,757.00	0.00
248	601058	赛轮轮胎	1,800	20,754.00	0.00
249	000301	东方盛虹	1,800	20,610.00	0.00
250	000768	中航西飞	1,000	20,480.00	0.00
251	003816	中国广核	5,200	20,332.00	0.00
252	300759	康龙化成	700	20,251.00	0.00
252	603659	璞泰来	700	20,251.00	0.00
253	600196	复星医药	900	20,223.00	0.00
254	600026	中远海能	1,100	19,734.00	0.00
255	300458	全志科技	500	19,730.00	0.00
256	002517	恺英网络	1,200	19,500.00	0.00
257	600415	小商品城	1,900	19,304.00	0.00
258	002074	国轩高科	700	19,257.00	0.00
259	300339	润和软件	500	19,255.00	0.00
260	688169	石头科技	200	18,994.00	0.00

261	300207	欣旺达	1,000	18,990.00	0.00
262	300001	特锐德	500	18,915.00	0.00
263	600233	圆通速递	1,200	18,900.00	0.00
264	000975	山金国际	1,100	18,700.00	0.00
265	600029	南方航空	3,600	18,648.00	0.00
266	002595	豪迈科技	400	18,640.00	0.00
267	002128	电投能源	800	18,496.00	0.00
268	600009	上海机场	800	18,480.00	0.00
269	601186	中国铁建	3,100	18,445.00	0.00
270	600674	川投能源	1,300	18,421.00	0.00
271	601117	中国化学	2,500	18,375.00	0.00
272	600219	南山铝业	4,600	18,354.00	0.00
273	300803	指南针	200	18,334.00	0.00
274	601111	中国国航	3,000	18,150.00	0.00
275	002601	龙佰集团	1,100	18,128.00	0.00
276	002465	海格通信	1,400	17,878.00	0.00
277	601877	正泰电器	700	17,549.00	0.00
278	600839	四川长虹	2,500	17,450.00	0.00
279	300024	机器人	900	17,397.00	0.00
280	600372	中航机载	1,600	17,360.00	0.00
281	000547	航天发展	900	17,235.00	0.00
282	600741	华域汽车	1,100	17,072.00	0.00
283	002130	沃尔核材	900	17,064.00	0.00
284	301236	软通动力	400	16,980.00	0.00
285	000963	华东医药	600	16,872.00	0.00
286	300568	星源材质	900	16,848.00	0.00
287	300115	长盈精密	600	16,764.00	0.00
288	002155	湖南黄金	700	16,709.00	0.00
289	300012	华测检测	1,200	16,632.00	0.00
290	002472	双环传动	400	16,604.00	0.00
291	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.00
292	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.00
293	002497	雅化集团	800	16,296.00	0.00
294	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.00
295	002414	高德红外	1,200	15,912.00	0.00
296	000878	云南铜业	1,000	15,880.00	0.00
297	002444	巨星科技	500	15,550.00	0.00
298	001979	招商蛇口	2,400	15,432.00	0.00
299	002271	东方雨虹	1,300	15,431.00	0.00
300	600699	均胜电子	700	15,127.00	0.00
301	002078	太阳纸业	1,200	14,988.00	0.00
302	300083	创世纪	1,100	14,982.00	0.00
303	601319	中国人保	2,200	14,872.00	0.00

304	300073	当升科技	300	14,412.00	0.00
305	300347	泰格医药	300	14,400.00	0.00
306	300142	沃森生物	1,100	14,289.00	0.00
307	002432	九安医疗	200	14,136.00	0.00
308	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.00
309	600039	四川路桥	1,800	14,076.00	0.00
310	601615	明阳智能	1,200	13,884.00	0.00
311	000034	神州数码	500	13,875.00	0.00
312	601800	中国交建	2,400	13,704.00	0.00
313	601021	春秋航空	300	13,674.00	0.00
314	000423	东阿阿胶	300	13,608.00	0.00
315	601633	长城汽车	900	13,581.00	0.00
316	688599	天合光能	961	13,569.32	0.00
317	688180	君实生物	400	13,528.00	0.00
318	002252	上海莱士	3,100	13,454.00	0.00
319	000002	万 科 A	4,500	13,320.00	0.00
319	000661	长春高新	200	13,320.00	0.00
320	002064	华峰化学	1,400	13,286.00	0.00
321	601677	明泰铝业	800	13,280.00	0.00
322	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.00
323	600588	用友网络	1,400	12,852.00	0.00
324	688223	晶科能源	2,703	12,839.25	0.00
325	001965	招商公路	1,400	12,824.00	0.00
326	002294	信立泰	400	12,756.00	0.00
327	000786	北新建材	700	12,663.00	0.00
328	000519	中兵红箭	600	12,642.00	0.00
329	600226	亨通股份	1,300	12,467.00	0.00
330	603606	东方电缆	300	12,453.00	0.00
331	300496	中科创达	200	12,358.00	0.00
332	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.00
333	300748	金力永磁	400	12,340.00	0.00
334	601607	上海医药	800	12,320.00	0.00
335	688005	容百科技	400	12,240.00	0.00
336	300474	景嘉微	200	12,096.00	0.00
337	300432	富临精工	600	12,054.00	0.00
338	600177	雅戈尔	1,600	12,048.00	0.00
339	002176	江特电机	1,200	12,012.00	0.00
340	688065	凯赛生物	247	11,818.95	0.00
341	603979	金诚信	200	11,806.00	0.00
342	603806	福斯特	700	11,753.00	0.00
343	300677	英科医疗	300	11,751.00	0.00
344	600516	方大炭素	1,900	11,723.00	0.00
345	302132	中航成飞	200	11,664.00	0.00

346	601618	中国中冶	4,700	11,468.00	0.00
347	300699	光威复材	400	11,460.00	0.00
348	603087	甘李药业	200	11,352.00	0.00
349	002459	晶澳科技	1,400	11,340.00	0.00
350	000733	振华科技	200	11,328.00	0.00
350	002756	永兴材料	200	11,328.00	0.00
351	000617	中油资本	1,700	11,203.00	0.00
352	002085	万丰奥威	1,000	11,090.00	0.00
352	300251	光线传媒	1,000	11,090.00	0.00
353	600499	科达制造	800	11,040.00	0.00
354	688472	阿特斯	1,009	10,917.38	0.00
355	000400	许继电气	500	10,850.00	0.00
356	600862	中航高科	600	10,818.00	0.00
357	002065	东华软件	1,500	10,710.00	0.00
358	002831	裕同科技	300	10,668.00	0.00
359	300003	乐普医疗	900	10,665.00	0.00
360	000623	吉林敖东	600	10,638.00	0.00
361	002044	美年健康	2,100	10,563.00	0.00
362	000039	中集集团	1,300	10,543.00	0.00
363	300866	安克创新	100	10,450.00	0.00
364	600515	海南机场	3,800	10,412.00	0.00
365	000683	博源化工	1,800	10,368.00	0.00
366	002405	四维图新	1,600	10,352.00	0.00
367	002223	鱼跃医疗	400	10,264.00	0.00
368	601216	君正集团	2,300	10,258.00	0.00
369	688114	华大智造	200	10,216.00	0.00
370	000415	渤海租赁	2,500	10,175.00	0.00
371	002266	浙富控股	2,000	10,120.00	0.00
372	600521	华海药业	700	10,080.00	0.00
373	600332	白云山	500	10,020.00	0.00
374	000032	深桑达 A	400	9,980.00	0.00
375	300409	道氏技术	500	9,965.00	0.00
376	603596	伯特利	400	9,936.00	0.00
377	600704	物产中大	2,100	9,912.00	0.00
378	603650	彤程新材	100	9,798.00	0.00
379	603260	合盛硅业	200	9,652.00	0.00
380	300454	深信服	100	9,620.00	0.00
381	000830	鲁西化工	800	9,600.00	0.00
382	002318	久立特材	400	9,560.00	0.00
383	603766	隆鑫通用	800	9,544.00	0.00
384	600153	建发股份	1,200	9,516.00	0.00
385	600803	新奥股份	600	9,480.00	0.00
386	000967	盈峰环境	900	9,477.00	0.00

387	600018	上港集团	2,000	9,440.00	0.00
388	300342	天银机电	200	9,400.00	0.00
389	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.00
390	600166	福田汽车	3,200	9,312.00	0.00
391	600085	同仁堂	400	9,244.00	0.00
392	000738	航发控制	500	9,145.00	0.00
393	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.00
394	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.00
395	600765	中航重机	700	9,044.00	0.00
396	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.00
397	002603	以岭药业	600	9,000.00	0.00
398	000999	华润三九	400	8,996.00	0.00
399	002410	广联达	1,100	8,976.00	0.00
400	000887	中鼎股份	500	8,945.00	0.00
401	600312	平高电气	500	8,830.00	0.00
402	300896	爱美客	100	8,720.00	0.00
403	002007	华兰生物	700	8,533.00	0.00
404	688009	中国通号	1,769	8,420.44	0.00
405	300832	新产业	200	8,400.00	0.00
406	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.00
407	600398	海澜之家	1,600	8,368.00	0.00
408	601000	唐山港	2,000	8,300.00	0.00
409	600323	瀚蓝环境	300	8,238.00	0.00
410	601018	宁波港	2,600	8,190.00	0.00
411	600161	天坛生物	700	8,106.00	0.00
412	600170	上海建工	3,600	7,992.00	0.00
413	000932	华菱钢铁	2,300	7,981.00	0.00
414	600998	九州通	1,700	7,973.00	0.00
415	600208	衢州发展	2,800	7,924.00	0.00
416	600008	首创环保	2,900	7,888.00	0.00
417	600820	隧道股份	1,500	7,815.00	0.00
418	603568	伟明环保	500	7,690.00	0.00
419	688116	天奈科技	201	7,678.20	0.00
420	688303	大全能源	440	7,669.20	0.00
421	002025	航天电器	100	7,622.00	0.00
422	601238	广汽集团	1,500	7,620.00	0.00
423	300118	东方日升	600	7,470.00	0.00
423	601567	三星电气	500	7,470.00	0.00
424	605090	九丰能源	200	7,434.00	0.00
425	600529	山东药玻	400	7,380.00	0.00
426	603885	吉祥航空	700	7,203.00	0.00
427	002607	中公教育	4,000	7,200.00	0.00
428	603939	益丰药房	400	7,192.00	0.00

429	002389	航天彩虹	400	7,108.00	0.00
430	688166	博瑞医药	203	7,107.03	0.00
431	300676	华大基因	200	7,012.00	0.00
432	600763	通策医疗	200	6,776.00	0.00
433	601880	辽港股份	4,900	6,762.00	0.00
434	603816	顾家家居	300	6,708.00	0.00
435	600535	天士力	500	6,615.00	0.00
436	300558	贝达药业	100	6,507.00	0.00
437	300144	宋城演艺	1,100	6,391.00	0.00
438	002120	韵达股份	1,000	6,360.00	0.00
439	600816	建元信托	2,600	6,344.00	0.00
440	601155	新城控股	600	6,156.00	0.00
441	002244	滨江集团	800	6,080.00	0.00
442	000998	隆平高科	800	6,032.00	0.00
443	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
444	601866	中远海发	2,600	5,746.00	0.00
445	300100	双林股份	200	5,556.00	0.00
446	002544	普天科技	300	5,466.00	0.00
447	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.00
448	603392	万泰生物	200	5,394.00	0.00
449	600655	豫园股份	1,300	5,343.00	0.00
450	000035	中国天楹	1,100	5,313.00	0.00
451	600511	国药股份	200	5,208.00	0.00
452	600635	大众公用	1,200	5,136.00	0.00
453	600004	白云机场	700	5,082.00	0.00
454	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.00
455	600486	扬农化工	100	5,070.00	0.00
456	002091	江苏国泰	700	5,061.00	0.00
457	600038	中直股份	200	5,058.00	0.00
458	600064	南京高科	700	4,991.00	0.00
459	300070	碧水源	1,500	4,785.00	0.00
460	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.00
461	600864	哈投股份	900	4,671.00	0.00
462	600859	王府井	500	4,590.00	0.00
463	300601	康泰生物	400	4,536.00	0.00
464	000069	华侨城 A	2,700	4,428.00	0.00
465	600663	陆家嘴	700	4,396.00	0.00
466	600258	首旅酒店	400	4,368.00	0.00
467	300457	赢合科技	200	4,216.00	0.00
468	603899	晨光股份	200	4,126.00	0.00
469	300573	兴齐眼药	100	4,076.00	0.00
470	002292	奥飞娱乐	600	3,936.00	0.00
471	300049	福瑞医科	100	3,888.00	0.00

472	600325	华发股份	1,500	3,465.00	0.00
473	301078	孩子王	500	3,380.00	0.00
474	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.00
475	002572	索菲亚	400	2,920.00	0.00
476	002891	中宠股份	100	2,672.00	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	300750	宁德时代	4,556,775.00	0.24
2	300308	中际旭创	2,982,146.00	0.15
3	300502	新易盛	1,973,413.00	0.10
4	000333	美的集团	1,891,225.00	0.10
5	002371	北方华创	1,739,376.00	0.09
6	300059	东方财富	1,393,452.00	0.07
7	002475	立讯精密	1,374,385.00	0.07
8	300274	阳光电源	1,230,520.00	0.06
9	000858	五粮液	1,198,491.00	0.06
10	002594	比亚迪	1,183,837.00	0.06
11	300476	胜宏科技	1,098,195.00	0.06
12	000651	格力电器	930,461.00	0.05
13	300394	天孚通信	923,704.00	0.05
14	002384	东山精密	809,909.00	0.04
15	000725	京东方 A	800,674.00	0.04
16	002714	牧原股份	728,869.00	0.04
17	300760	迈瑞医疗	683,686.00	0.04
18	002028	思源电气	650,582.00	0.03
19	002463	沪电股份	619,069.00	0.03
20	002050	三花智控	598,145.00	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	300750	宁德时代	39,010.00	0.00
2	601318	中国平安	32,154.00	0.00
3	600498	烽火通信	31,990.00	0.00
4	300285	国瓷材料	28,705.00	0.00
5	601899	紫金矿业	28,390.00	0.00
6	601088	中国神华	27,720.00	0.00
7	002409	雅克科技	27,442.00	0.00
8	600036	招商银行	27,258.00	0.00
9	000333	美的集团	24,900.00	0.00
10	002245	蔚蓝锂芯	23,618.00	0.00

11	600256	广汇能源	20,480.00	0.00
12	600900	长江电力	19,551.00	0.00
13	601166	兴业银行	18,470.00	0.00
14	601398	工商银行	15,360.00	0.00
15	000725	京东方 A	14,325.00	0.00
16	300088	长信科技	13,734.00	0.00
17	002475	立讯精密	13,241.00	0.00
18	600030	中信证券	12,945.00	0.00
19	300059	东方财富	12,327.00	0.00
20	300383	光环新网	12,220.00	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	78,562,505.86
卖出股票收入（成交）总额	1,072,726.99

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）	1,000.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.01	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	111025	圣泉转债	10	1,000.01	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 A500 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	1,609,188, 004.12	93.73

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
无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前
一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	330,553.22

2	应收清算款	2,666,193.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,625,715.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,622,461.70

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 A500ETF 联接 A	70,235	6,118.50	97,582,112.59	22.71	332,150,783.93	77.29
嘉实中证 A500ETF 联接 C	30,052	27,684.13	92,962,818.21	11.17	739,000,615.33	88.83
嘉实中证 A500ETF 联接 Y	4,705	8,035.73	-	-	37,808,126.54	100.00
合计	103,946	12,501.73	190,544,930.80	14.66	1,108,959,525.80	85.34

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实中证 A500ETF 联接 A	2,107,700.03	0.49
	嘉实中证 A500ETF 联接 C	478,119.27	0.06
	嘉实中证 A500ETF 联接 Y	365,104.86	0.97
	合计	2,950,924.16	0.23

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 A500ETF 联接 A	>100
	嘉实中证 A500ETF 联接 C	10~50
	嘉实中证 A500ETF 联接 Y	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实中证 A500ETF 联接 A	0
	嘉实中证 A500ETF 联接 C	0
	嘉实中证 A500ETF 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 A500ETF 联接 A	嘉实中证 A500ETF 联接 C	嘉实中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 12 日）基金份额总额	889,597,662.75	4,112,785,027.32	—
本报告期期初基金份额总额	433,542,192.60	1,164,160,937.43	25,379,191.74
本报告期基金总申购份额	254,920,313.21	464,016,080.28	21,561,147.11
减：本报告期基金总赎回份额	258,729,609.29	796,213,584.17	9,132,212.31
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	429,732,896.52	831,963,433.54	37,808,126.54

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

2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内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

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，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	—

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员

受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	3	61,088,868.00	76.71	11,357.35	76.71	-
中信建投证券股份有限公司	3	11,557,868.85	14.51	2,148.21	14.51	-
国泰海通证券股份有限公司	2	6,988,496.00	8.78	1,299.65	8.78	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-	260,811,785.60	38.49
中信建投证券股份有限公司	2,800,260.00	100.00	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	416,716,365.50	61.51
广发证券股份	-	-	-	-	-	-	-	-

有限公司								
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停机构投资者大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 6 日
2	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年第一次收益分配公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 11 日
3	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 13 日
4	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停机构投资者大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 12 日
5	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年第二次收益分配公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 15 日
6	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 19 日
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实中证 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

(4) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；

(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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日