嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合
基金主代码	004536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月4日
报告期末基金份额总额	121,040,270.02份
投资目标	本基金采用积极、主动的量化投资策略,以中小企业经营、发展和创新的内在活力为研究基础,通过系统的专业性研究分析,积极挖掘符合经济规律和产业发展规律的优质中小企业投资机会,在严控投资风险的条件下,追求基金资产的稳健增值。
投资策略	立足于中国资本市场独特的变化,利用综合评价对中小企业经营、发展和创新的内在活力进行由点到面的多层次量化分析,构建包含中小企业投资价值、成长性、创新力、经营质量、管理层模式以及企业文化等方面的全方位投资策略,优选增长潜力最大的中小企业股票进行投资。
业绩比较基准	中证500指数*80%+中证综合债券指数*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–6,481,450.74
2.本期利润	–9,711,204.45
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0800
4.期末基金资产净值	94,984,726.10
5.期末基金份额净值	0.785

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	–9.25%	1.11%	–6.12%	1.04%	–3.13%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图:嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2017年7月4日至2018年9月30日）

注:1: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个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

2:2018年7月13日,本基金管理人发布《关于增聘嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理的公告》,增聘张楠先生担任本基金基金经理职务,与基金经理张自力先生共同管理本基金。

3:2018年9月20日,本基金管理人发布《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置混合基金经理变更的公告》,增聘金猛先生担任本基金基金经理职务,与基金经理张楠先生共同管理本基金。张自力先生不再担任本基金基金经理职务。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张楠	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实核心优势股票基金经理	2018年7月13日	–	6年	2012年1月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作。硕士研究生,具有基金从业资格。
金猛	本基金、嘉实量化阿尔法混合基金经理	2018年9月20日	–	6年	曾任职于安信基金管理有限责任公司,从事风险控制工作。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于量化投资部。
张自力	基金经理	2017年7月4日	2018年9月20日	22年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学。曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

注:（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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、《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计5次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在多重利空因素下,三季度股票市场延续了二季度的低迷状态,同时市场成交量进一步萎缩,投资者风险偏好迅速下降,存量资金呈现出追逐短期交易性机会的趋势,导致热点难以持续,市场风格反复切换,投资获利难度显著增大。一方面,在普遍预期三季度宏观经济将逐渐下行的情况下,政策出现边际调整,稳健的货币政策和积极的财政政策纷纷出台,有利于金融风险的消除和企业盈利环境的改善,同时,在地方政府债务清理、资管新规等一系列去杠杆的政策措施下,实体部门融资环境仍然趋紧,继续制约着资本市场的流动性。而外部国际环境逐渐向不利于国内经济发展的方向演变,贸易战加剧和美联储的加息预期,投资者对资产标的的安全性及盈利确定性要求进一步提高,突发事件也成为股票短期波动的主要因素之一。

行业方面,金融、上游周期与国防军工行业的表现相对较好。消费类股票则出现显著回调,尤其是家电、纺织服装和生物医药等行业,主要受负面事件冲击以及中报业绩拖累的影响。总体而言,在投资环境整体偏弱的环境下,投资者对资产安全性的重视程度显著大于盈利性。

报告期内,本组合严格遵守基金合同的约定,基于量化模型,构建对股票Alpha的测度,并通过行业、风格、风险等维度的控制,进行组合优化。同时,组合根据国家政策、宏观经济周期以 及对市场风格、境外资金、机构投资者的监控,积极布局市场发展方向。组合后续将坚持主动股 票型的高仓位运作,坚持整体稳健的投资风格,逐步优选具有未来发展潜力的高成长企业,以及当前财报持续稳健向好的确定性优质成长企业,我们将在量化投资的框架内对模型进行相应调整和优化,进一步控制风险和波动,希望取得更好的投资效果,回馈投资者。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.785元;本报告期基金份额净值增长率为–9.25%,业绩比较基准收益率为–6.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	74,274,840.19	77.84
	其中:股票	74,274,840.19	77.84
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	5,446,484.00	5.71
	其中:债券	5,446,484.00	5.71
	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	15,537,388.23	16.28
8	其他资产	162,729.90	0.17
9	合计	95,421,442.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,456,904.00	1.53
B	采矿业	562,248.00	0.59
C	制造业	46,283,338.64	48.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	765,855.00	0.81
E	建筑业	1,162,261.00	1.22
F	批发和零售业	2,402,813.55	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,250,814.00	1.32
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,666,858.00	9.12
J	金融业	–	–
K	房地产业	5,040,107.00	5.31
L	租赁和商务服务业	2,847,263.00	3.00
M	科学研究和技术服务业	2,110,244.00	2.22
N	水利、环境和公共设施管理业	589,380.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	758,859.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	377,895.00	0.40
S	综合	–	–
	合计	74,274,840.19	78.20

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600596	新安股份	81,300	1,281,288.00	1.35
2	002299	圣农发展	73,000	1,194,280.00	1.26
3	000651	格力电器	29,300	1,177,860.00	1.24
4	600481	双良节能	339,500	1,144,115.00	1.20
5	600227	圣济堂	345,600	1,143,936.00	1.20
6	600558	大西洋	282,500	1,138,475.00	1.20
7	300081	恒信东方	127,500	1,137,300.00	1.20
8	000636	风华高科	75,600	1,137,024.00	1.20
9	600376	首开股份	158,000	1,136,020.00	1.20
10	600057	厦门象屿	221,700	1,135,104.00	1.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	5,446,484.00	5.73
	其中:政策性金融债	5,446,484.00	5.73
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	5,446,484.00	5.73

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	54,140	5,446,484.00	5.73

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

（1）2018年8月8日, 广东风华高新科技股份有限公司发布关于收到中国证监会调查通知的公告,公司因涉嫌信息披露违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。。

本基金投资于“风华高科（000636）”的决策程序说明:基于量化模型构建股票组合,本基金投资于“风华高科”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36,011.37
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	105,190.83
5	应收申购款	21,527.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	162,729.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	121,856,921.49
报告期期间基金总申购份额	3,607,094.41
减:报告期期间基金总赎回份额	4,423,745.88
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“–”填列）	–
报告期期末基金份额总额	121,040,270.02

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件;

(2)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6) 报告期内嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

(1)北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

(2)北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

8.3 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,或发电子邮件,E–mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2018年10月26日

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
报告期末基金份额总额	277,181,868.00份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–14,179,365.44
2.本期利润	–92,469,489.20
3.加权平均基金份额本期利润	–0.3877
4.期末基金资产净值	1,384,517,003.43
5.期末基金份额净值	4.9950

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	–7.42%	1.31%	–7.99%	1.30%	0.57%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

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

（2013年2月6日至2018年9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个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（二）投资范围和(七)投资限制”的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII–LOF)、嘉实黄金(QDII–FOF–LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中关村A股ETF、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	–	13年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII–LOF)、嘉实黄金(QDII–FOF–LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	–	12年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA–Clarington Investments Inc),富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计5次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差为0.37%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

本基金作为一只投资于中证500指数的被动投资管理产品,我们继续秉承指数化被动投资策略,积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,降低本基金的跟踪误差,给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为4.9950元;本报告期基金份额净值增长率为–7.42%,业绩比较基准收益率为–7.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,334,263,291.90	96.29
	其中:股票	1,334,263,291.90	96.29
2	基金投资	–	–
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	25,000,000.00	1.80
	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	16,873,919.20	1.22
8	其他资产	9,514,751.52	0.69
9	合计	1,385,651,962.62	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,604,282.27	0.91
B	采矿业	32,368,632.33	2.34
C	制造业	796,742,779.52	57.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,990,061.90	3.11
E	建筑业	21,793,468.64	1.57
F	批发和零售业	69,751,155.42	5.04
G	交通运输、仓储和邮政业	50,780,430.46	3.67
H	住宿和餐饮业	5,829,060.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,839,520.27	8.58
J	金融业	34,928,358.60	2.52
K	房地产业	67,681,355.70	4.89
L	租赁和商务服务业	22,339,869.80	1.61
M	科学研究和技术服务业	2,463,198.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	7,783,182.76	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	966,039.80	0.07
Q	卫生和社会工作	2,064,484.08	0.15
R	文化、体育和娱乐业	24,424,517.48	1.76
S	综合	19,639,270.13	1.42
	合计	1,333,989,667.16	96.35

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	185,029.00	0.01
C	制造业	90,226.74	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	275,255.74	0.02

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000661	长春高新	56,268	13,335,516.00	0.96
2	603019	中科曙光	185,800	8,710,304.00	0.63
3	600256	广汇能源	1,670,410	8,535,795.10	0.62
4	600201	生物股份	483,480	8,228,829.60	0.59
5	000703	恒逸石化	476,799	8,081,743.05	0.58
6	600426	华鲁恒升	468,834	8,068,633.14	0.58
7	000977	浪潮信息	319,200	7,686,336.00	0.56
8	000860	顺鑫农业	165,347	7,539,823.20	0.54
9	600872	中炬高新	230,616	7,518,081.60	0.54
10	300146	汤臣倍健	364,050	7,463,025.00	0.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000693	*ST华泽	55,900	185,029.00	0.01
2	002937	兴瑞科技	2,114	36,593.34	0.00
3	300749	顶固集创	1,316	30,833.88	0.00
4	300748	金力永磁	2,007	22,799.52	0.00

注:1、报告期末,本基金仅持有上述4支积极投资股票。

2、*ST华泽1只股票已被调出指数成分股,因停牌等原因暂无法卖出。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	35	33,237,400.00	–5,229,760.00	–
公允价值变动总额合计（元）					–5,229,760.00
股指期货投资本期收益（元）					–1,021,120.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					–1,321,800.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,目的在于满足基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现跟踪标的指数的投资目标。

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,670,901.87
2	应收证券清算款	2,859,154.74
3	应收股利	–
4	应收利息	–15,305.09
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,514,751.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000693	*ST华泽	185,029.00	0.01	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	209,681,868.00
报告期期间基金总申购份额	76,050,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	8,550,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“–”填列）	–
报告期期末基金份额总额	277,181,868.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	–	–	–	–	–	–	–
个人	–	–	–	–	–	–	–
联接基金	1	2018/07/01至2018/09/30	147,622,080.00	152,909,900.00	89,955,500.00	210,576,480.00	75.97
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

（2）《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

（3）《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

（4）《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照;

（6）报告期内嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

（1）北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

（2）北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

9.3 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,或发电子邮件,E–mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2018年10月26日

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	
报告期末基金份额总额	902,397,188.82份	
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。	
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。	
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。	
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	
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	902,234,251.93份	162,936.89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

2.1.2 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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
	嘉实中证500ETF联接A	嘉实中证500ETF联接C
1.本期已实现收益	–13,044,611.79	–54.91
2.本期利润	–71,668,917.54	1,422.41
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0985	0.0199
4.期末基金资产净值	1,162,690,446.39	165,772.41
5.期末基金份额净值	1.2887	1.0174

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;（3）自2018年9月13日起对本基金增加C类基金份额类别;自2018年9月13日起开放嘉实中证500ETF联接C的申赎业务;（4）嘉实中证500ETF联接A收取认（申）购费和赎回费,嘉实中证500ETF联接C不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–6.92%	1.24%	–7.58%	1.24%	0.66%	0.00%

嘉实中证500ETF联接C

阶段	净值增长率①	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	1.74%	1.05%	1.60%	1.06%	0.14%	–0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

图1:嘉实中证500ETF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

（2013年3月22日至2018年9月30日）

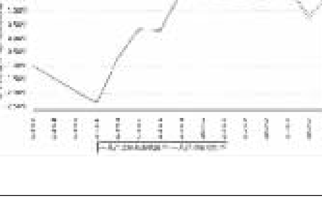

图2:嘉实中证500ETF联接C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2018年9月14日至2018年9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个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分（二）投资范围和(七)投资限制”的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII–LOF)、嘉实黄金(QDII–FOF–LOF)、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中关村A股ETF、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	–	13年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII–LOF)、嘉实黄金(QDII–FOF–LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2016年1月5日	–	12年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA–Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计5次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差为0.36%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

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。

4.5 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1.2887元,本报告期基金份额净值增长率为–6.92%,业绩比较基准收益率为–7.58%;截至本报告期末嘉实中证500ETF联接C基金份额净值为1.0174元,本报告期基金份额净值增长率为1.74%,业绩比较基准收益率为1.60%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,997,868.23	3.86
	其中:股票	44,997,868.23	3.86
2	基金投资	1,051,850,575.25	90.26
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	66,965,111.69	5.75
8	其他资产	1,557,334.96	0.13
9	合计	1,165,370,890.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	427,708.52	0.04
B	采矿业	1,096,749.19	0.09
C	制造业	26,976,940.74	2.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,460,066.00	0.13
E	建筑业	735,618.40	0.06
F	批发和零售业	2,281,641.39	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,669,658.24	0.14
H	住宿和餐饮业	197,400.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,999,452.34	0.34
J	金融业	1,197,630.30	0.10
K	房地产业	2,262,102.17	0.19
L	租赁和商务服务业	755,047.60	0.06
M	科学研究和技术服务业	82,520.04	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	248,931.10	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	32,476.40	0.00
Q	卫生和社会工作	68,856.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	838,034.00	0.07
S	综合	667,035.80	0.06
	合计	44,997,868.23	3.87

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000661	长春高新	1,900	450,300.00	0.04
2	603019	中科曙光	6,300	295,344.00	0.03
3	600256	广汇能源	56,840	290,452.40	0.02
4	600201	生物股份	16,462	280,183.24	0.02
5	600426	华鲁恒升	15,940	274,327.40	0.02
6	000703	恒逸石化	16,160	273,912.00	0.02
7	000977	浪潮信息	10,800	260,064.00	0.02
8	000860	顺鑫农业	5,600	255,360.00	0.02
9	600872	中炬高新	7,800	254,280.00	0.02
10	300146	汤臣倍健	12,400	254,200.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	嘉实中证500ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	1,051,850,575.25	90.45

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	2	1,899,280.00	–293,440.00	–
公允价值变动总额合计（元）					–293,440.00
股指期货投资本期收益（元）					–86,600.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					–48,600.00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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

5.12.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	543,411.09
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	14,565.41
5	应收申购款	999,358.46
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,557,334.96

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 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
报告期期初基金份额总额	605,246,594.59	–
报告期期间基金总申购份额	324,487,465.54	162,936.89
减:报告期期间基金总赎回份额	27,499,808.20	–
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“–”填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	902,234,251.93	162,936.89

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

（1）北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

（2）北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

8.3 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,或发电子邮件,E–mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2018年10月26日