

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：2019年4月20日

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第一季度报告

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及基金经理保证本基金的报告不存在虚假记载、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。

基金托管人中银建设银行股份有限公司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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期间为2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年5月22日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

§ 3 主要财务指标

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期2019年1月1日至2019年3月31日 报告期2019年1月1日至2019年3月31日

基金份额净值 -0.476,-363.313 362.897/3

2.本期利润 363,307,-497.72 6,011,-67.715

基金运作方式 申购型开放式

本币利润 0.263/4

4.期末基金资产净值 1,561,287,194.51 88,553,169.04

5.期末基金份额净值 1.0000000000000000 1.0723

注：(1)本公司已实现收益指基金本期利息收入、股息收入、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相

关费用后的余额，本报告期实现收益为-0.08%，年化收益率并不超过4%。

4.如因指数的编制规则调整等因素导致指数偏离幅度

大于±0.5%，基金管理人将采取相应措施避免偏离度

进一步扩大。

业绩比较基准 中证500指数*95%+银行定期存款利率*5%

本基金为交易型开放式基金，主要通过投资于嘉实

中证500ETF来实现对标的指数的紧密跟踪，因此，本基金

的收益表现与该指数的涨跌基本一致。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金，低于股票型基金。

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

嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金简称 嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金代码 000008

报告期末下属分级基金的份额总额 1,054,676,797/56份

75,530,591.54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

基金代码 160922

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5日

基金管理人 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 目标产品的说明

投资目标 本基金将进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，力求跟踪误差

度和跟踪收益率尽可能地最小化。

本基金将完全复制嘉实沪深300指数基金的全部股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进

行相应的比例调整及定期的现金分红派息。

投资策略 采用完全复制法，通过严格的投资者纪律和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的

跟踪误差的最小化，从而达到与标的指数表现相似的收益。

风险收益特征 本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金，低于股票型基金。

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

嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金简称 嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金代码 000008

报告期末下属分级基金的份额总额 4,306,080.00份

1.1.1 基金的基本情况

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2009年1月12日

基金存续期 1,307,641,485.00份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过投资于嘉实沪深300指数基金，力争在风险调整后

收益上超越业绩比较基准。

投资策略 采用完全复制法，通过严格的投资者纪律和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的

跟踪误差的最小化，从而达到与标的指数表现相似的收益。

风险收益特征 本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金，低于股票型基金。

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

嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金简称 嘉实中证500ETF联接C

下级分级基金的基金代码 000008

报告期末下属分级基金的份额总额 1,381,203,377.76份

1.1.2 报告期内基金资产净值

1.1.2.1 基金的基本情况

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 14,255,296.40份

1.1.2.2 基金的管理费

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.3 基金的托管费

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.4 基金的申购、赎回费用

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.5 基金的销售服务费

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.6 基金的估值方法

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.7 基金的财产清算

基金名称 嘉实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.8 基金的会计政策

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.9 基金的审计

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.10 基金的年度报告

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.11 基金的半年度报告

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.12 基金的季度报告

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日

报告期末基金份额总额 1,130,213,389.09份

1.1.2.13 基金的月度报告

基金名称 嘬实中证500ETF联接C

基金代码 000008

基金运作方式 上市交易型开放式

基金合同生效日 2013年2月6日