

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

# 2016年年度报告摘要

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：2017年3月29日

§ 1 重要提示  
基金管理人、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。本年度报告已经经基金独立董事签字同意，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2017年3月24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。  
本报告期末2016年1月1日起至2016年12月31日止。  
本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细信息，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

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
基金代码	000922
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

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
基金代码	150022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	356,775,373.10 份
基金合同存续期限	不定期

合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实优势动力混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优享红利混合、嘉实全房地地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意定开债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳裕纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪深港精选股票、嘉实稳健债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽正定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳宏债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增值混合、嘉实新嘉瑞混合、嘉实定期宝货币、嘉实增益货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期混合、其中嘉实成长混合、嘉实纯债混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于资产管理产品系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产管理组合。

姓名	职务	任职基本情况 (聘任日期、解聘日期)	是否从关联方推荐
杨文	基金经理	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	否
陈正宏	基金经理	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	否
陈宇	基金经理	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	否

注：(1)基金基金经理杨文的任职日期是指本基金基金合同生效之日起；基金经理何、陈正宏的任职日期是指公司作出决定后公告之日，离任日期是指公司作出决定后公告之日；(2)证券从业人员的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明  
报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规、《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约定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度和内部控制  
公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资决策过程中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个环节相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资机会，投资及时，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易，各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定严格的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合之间独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》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执行，并在获得投资机会、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交易的交易执行细则，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；对投资交易行为进行实时监控，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期专项评估并完整真实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易分析报告。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下 (日内、3 日内、5 日内) 公司管理的不同投资组合间交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。  
4.3.3 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时，同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 6 次，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，不存在利益输送情形。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析  
报告期内，基金日均跟踪误差为 0.09%，年度化拟合偏离度为 1.42%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过 0.35% 的限制。本基金跟踪误差主要来源于本基金申购赎回、样本股停牌、样本股分红、样本股调仓的冲击以及目标 ETF 偏离。  
4.4.2 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 1.7001 元；本报告期基金份额净值增长率为 -14.27%，业绩比较基准收益率为 -16.77%。  
4.5 管理人对于宏观环境、证券市场及行业走势的重要展望  
中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，随着未来中国经济发展更加倚重科技创新、技术创新、政府新策、市场资源也将较多地向新兴产业和体制机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对于其主流指数，其中市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。报告期内，中证 500 指数下跌 17.8%。

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，本基金将严格遵守基金合同及相关法律法规的前提下，继续秉承被动化投资管理策略，积极在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，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。  
4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明  
《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及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。

本基金管理人为设立估值委员会，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会和基金会计均具有专业性能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任估值委员会、估值委员会、基金估值委员会、估值委员会成员，但不介入基金日常估值业务；参与估值委员会之间不存在任何重大利益冲突，与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、中国国债登记结算公司、中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。  
4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明  
(1) 报告期内本基金未实施利润分配。  
(2) 根据本报告 3.1.1“本期利润”为 -46,082,284.30 元，以及基金合同 (十五) (三) 基金收益分配原则约定，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。  
4.8 报告期内管理人对于本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明  
无。

§ 5 托管人报告  
本报告期内，中国建设银行股份有限公司在本基金的管理过程中，严格按照了《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，完全尽到了勤勉尽责的义务，未发现管理人有任何损害基金份额持有人利益的行为。  
§ 6 审计报告  
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016 年年度报告审计报告已由普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) 审计，注册会计师张勇、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告” (普华永道中天审字 (2017) 第 2615 号)。  
投资者可通过登录于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。  
§ 7 年度财务报表

7.1 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：2016 年 12 月 31 日

7.2 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  
报告截止日：2016 年 12 月 31 日

7.3 所有者权益表  
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：2016 年 12 月 31 日

7.4 现金流量表  
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：2016 年 12 月 31 日

7.5 公允价值变动损益表  
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：2016 年 12 月 31 日

7.6 投资收益表  
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：2016 年 12 月 31 日

7.7 公允价值变动损益表  
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：2016 年 12 月 31 日

7.8 公允价值变动损益表  
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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	期初	本期	期末
银行存款	7471	36,752,219.94	23,042,768.59
结算备付金	-	991,718.04	7,696,423.23
交易保证金	-	1,331,364.59	2,089,488.22
应收利息	7472	588,114,207.71	381,236,988.66
应收股利	-	5,063,199.69	5,114,199.69
其他资产	-	962,491,203.23	373,453,421.11
负债	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收资本	-	-	-
资本公积	-	-	-
未分配利润	-	-	-
其他综合收益	-	-	-
其他权益工具	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

资产	期初	本期	期末
银行存款	7471	36,752,219.94	23,042,768.59
结算备付金	-	991,718.04	7,696,423.23
交易保证金	-	1,331,364.59	2,089,488.22
应收利息	7472	588,114,207.71	381,236,988.66
应收股利	-	5,063,199.69	5,114,199.69
其他资产	-	962,491,203.23	373,453,421.11
负债	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收资本	-	-	-
资本公积	-	-	-
未分配利润	-	-	-
其他综合收益	-	-	-
其他权益工具	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

资产	期初	本期	期末
银行存款	7471	36,752,219.94	23,042,768.59
结算备付金	-	991,718.04	7,696,423.23
交易保证金	-	1,331,364.59	2,089,488.22
应收利息	7472	588,114,207.71	381,236,988.66
应收股利	-	5,063,199.69	5,114,199.69
其他资产	-	962,491,203.23	373,453,421.11
负债	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收资本	-	-	-
资本公积	-	-	-
未分配利润	-	-	-
其他综合收益	-	-	-
其他权益工具	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

资产	期初	本期	期末
银行存款	7471	36,752,219.94	23,042,768.59
结算备付金	-	991,718.04	7,696,423.23
交易保证金	-	1,331,364.59	2,089,488.22
应收利息	7472	588,114,207.71	381,236,988.66
应收股利	-	5,063,199.69	5,114,199.69
其他资产	-	962,491,203.23	373,453,421.11
负债	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他负债	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收资本	-	-	-
资本公积	-	-	-
未分配利润	-	-	-
其他综合收益	-	-	-
其他权益工具	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

7.2 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-44,497,402.04	140,742,679.66
3.利息收入		297,459.55	632,607.92