

# 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

S 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事监事会对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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月24日复核了本报表中的财务指标、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。

本报表期自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正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

S 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

	基金名称	基金简称	基金类型	运作方式	上市地
	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	嘉实500ETF联接	股票型基金	契约型开放式	
	嘉实500ETF				
基金代码	000008				
基金合同终止日	长期开放				
基金合同生效日	2013年3月22日				
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司				
基金管理人	国泰君安证券股份有限公司				
基金募集金额	306,775,373.10元				
基金资产净值	不定				

## 2.1.1 目标基金基本情况

	基金名称	基金简称	基金类型	运作方式	上市地
	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金	嘉实500	股票型基金	契约型开放式	
	嘉实500ETF				
基金代码	160705				
基金合同终止日	长期开放				
基金合同生效日	2013年3月22日				
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司				
基金管理人	国泰君安证券股份有限公司				
基金募集金额	306,775,373.10元				
基金资产净值	不定				

## 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	性别	本基金基金经理	任本基金基金经理的日期	辞职的日期	说明
李晓捷	男	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金	2016年1月5日	-	担任前EVA量化投资管理公司基金经理，后加入嘉实基金管理有限公司，担任嘉实中证500ETF基金经理，同时担任嘉实中证500ETF联接基金经理。
王莹	女	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金	2016年1月5日	-	担任前EVA量化投资管理公司基金经理，后加入嘉实基金管理有限公司，担任嘉实中证500ETF基金经理，同时担任嘉实中证500ETF联接基金经理。
孙昊阳	男	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金	2016年3月22日	2016年1月5日	担任前EVA量化投资管理公司基金经理，后加入嘉实基金管理有限公司，担任嘉实中证500ETF基金经理，同时担任嘉实中证500ETF联接基金经理。
陈一佳	男	嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金	2016年3月22日	2016年1月5日	担任前EVA量化投资管理公司基金经理，后加入嘉实基金管理有限公司，担任嘉实中证500ETF基金经理，同时担任嘉实中证500ETF联接基金经理。

注：(1)本基金经理李晓捷的任职日期是指本基金基金经理生效之日；基金经理何陈正的任职日期是指公司作出决定公告之日，任本基金经理是指公司作出决定公告之日起公告之日；(2)证券从业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 管理人对报告期内本基金运作遵守诚信情况的专项说明

4.2.1 公平交易制度和控制方法

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方面，确保在投资管理活动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。

4.2.2 管理人对报告期内本基金运作遵守合规情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《基金管理公司公平交易行为规范》，并制定了《公平交易制度》，对旗下所有投资组合公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送。

4.2.3 管理人对报告期内本基金运作遵守审慎经营情况的说明

本基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证500指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，随着未来中国经济发展更加倚重技术创新、技术创新、政府资源、市场资源也将更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的小型企业，中证500指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比更大，因此对转型经济中的新兴产业更具代表性。报告期内，中证500指数下跌 17.78%。

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，本基金将在严守行业集中度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产生的冲击，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。

4.3 管理人对报告期内基金的业绩表现的说明

4.3.1 平均交易费用

本基金的平均交易费用为0.09%，年化交易费用率为0.16%。

4.3.2 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

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，费用计算方法详见本招募说明书“第十一部分 风险揭示”中“基金的费用”章节。

(3)期末可供分配利润为期末资产净值减去所有负债后的余额。

3.2 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 国泰君安证券股份有限公司 中国建设银行股份有限公司

住所 上海市银城中路16号 中国建设银行总行

办公地址 上海市银城中路16号 中国建设银行总行

法定代表人(或负责人) 陈行 田国立

注册资本(元) 610,652,500.00 256,650,000.00

电话 010-65215588 010-65959696

传真 010-65152696 010-66275653

4.4 信息披露方式

信息披露方式 http://www.jrfund.com

基金管理人和基金托管人共同的客户服务电话 010-65959696

§ 3 主要会计数据和财务指标

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 利润表

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，费用计算方法详见本招募说明书“第十一部分 风险揭示”中“基金的费用”章节。

(3)期末可供分配利润为期末资产净值减去所有负债后的余额。

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

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

中证 500 指数由沪深 A 股市场中经营状况良好、价格无异常波动或市值排序的 500 只股票组成，以调整股本为权重，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。

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：

Benchmark(0)=1000  
Return(t)=95%× 中证 500 指数收益率(t)+5%× 银行活期存款利率

其中 t=1,2,3,...

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金合同约定的第一次定期报告日期为2013年3月22日，2013年3月22日至2013年12月31日的期间，基金净值增长率为-5%。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

3.4 管理人对报告期内基金的管理情况的说明

4.1 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.1.1 对报告期内本基金的投资策略和运作分析

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方面，确保在投资管理活动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。

4.1.2 管理人对报告期内本基金的业绩表现的说明

本基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证500指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，随着未来中国经济

发展更加倚重技术创新、技术创新、政府资源、市场资源也将更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的小型企业，中证500指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比更大，因此对转型经济中的新兴产业更具代表性。报告期内，中证500指数下跌 17.78%。

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，本基金将在严守行业集中度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产生的冲击，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。

4.2 管理人对报告期内基金的管理情况的说明

4.2.1 公平交易制度和控制方法

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方面，确保在投资管理活动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。

4.2.2 管理人对报告期内本基金的业绩表现的说明

本基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证500指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，随着未来中国经济

发展更加倚重技术创新、技术创新、政府资源、市场资源也将更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的小型企业，中证500指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比更大，因此对转型经济中的新兴产业更具代表性。报告期内，中证500指数下跌 17.78%。

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，本基金将在严守行业集中度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产生的冲击，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。

4.3 管理人对报告期内基金的管理情况的说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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方面，确保在投资管理活动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。

4.3.2 管理人对报告期内本基金的业绩表现的说明

本基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证500指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，随着未来中国经济

发展更加倚重技术创新、技术创新、政府资源、市场资源也将更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的小型企业，中证500指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比更大，因此对转型经济中的新兴产业更具代表性。报告期内，中证500指数下跌 17.78%。

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，本基金将在严守行业集中度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产生的冲击，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。

4.4 管理人对报告期内基金的管理情况的说明

4.4.1 对报告期内本基金的投资策略和运作分析

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方面，确保在投资管理活动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。

4.4