

# 嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 基金联接基金

## 2025 年中期报告

2025 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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。

嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金额度由嘉实创业板 50 指数型证券投资基金额度而来。

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 2025 年 03 月 07 日（基金合同生效日）起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	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遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.13 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
11.1 备查文件目录 .....	54
11.2 存放地点 .....	55
11.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	嘉实创业板 50ETF 联接	
基金主代码	023429	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 7 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	267,535,507.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实创业板 50ETF 联接 A	嘉实创业板 50ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	023429	023430
报告期末下属分级基金的份额总额	75,508,729.49 份	192,026,777.78 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金	
基金主代码	159373	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 23 日	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2025 年 2 月 10 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	招商银行股份有限公司	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 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。本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金具体投资策略包括：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、融资及转

	融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	创业板 50 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为嘉实创业板 50ETF 的联接基金，主要通过投资于嘉实创业板 50ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与创业板 50 指数及嘉实创业板 50ETF 的表现密切相关。本基金预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

## 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，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 0.2%，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	创业板 50 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	张姗
	联系电话	(010) 65215588	400-61-95555
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	400-61-95555
传真		(010) 65215588	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100020	518040
法定代表人		经雷	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>

基金中期报告备置地点	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	2025 年 3 月 7 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	嘉实创业板 50ETF 联接 A	嘉实创业板 50ETF 联接 C
本期已实现收益	-10,992,690.01	-29,176,951.99
本期利润	996,563.39	2,565,468.41
加权平均基金份额本期利润	0.0116	0.0115
本期加权平均净值利润率	1.22%	1.21%
本期基金份额净值增长率	1.88%	1.79%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-9,733,175.03	-24,921,580.02
期末可供分配基金份额利润	-0.1289	-0.1298
期末基金资产净值	76,930,333.51	195,456,446.71
期末基金份额净值	1.0188	1.0179
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.88%	1.79%

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。

(4) 本基金合同生效日为 2025 年 03 月 07 日，本报告期自 2025 年 03 月 07 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

### 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

嘉实创业板 50ETF 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
过去一个月	8.97%	1.20%	8.77%	1.22%	0.20%	-0.02%
过去三个月	4.64%	1.98%	3.10%	2.04%	1.54%	-0.06%
自基金合同生效起至今	1.88%	1.75%	-2.56%	1.87%	4.44%	-0.12%

嘉实创业板 50ETF 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
过去一个月	8.96%	1.20%	8.77%	1.22%	0.19%	-0.02%
过去三个月	4.57%	1.98%	3.10%	2.04%	1.47%	-0.06%
自基金合同生效起至今	1.79%	1.75%	-2.56%	1.87%	4.35%	-0.12%

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：

$$\text{Return}(t) = (\text{创业板 } 50 \text{ 指数}(t) / \text{创业板 } 50 \text{ 指数}(t-1) - 1) \times 95\% + ((1 + \text{银行活期存款利率(税后)})^{(1/365)} - 1) \times 5\%$$

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

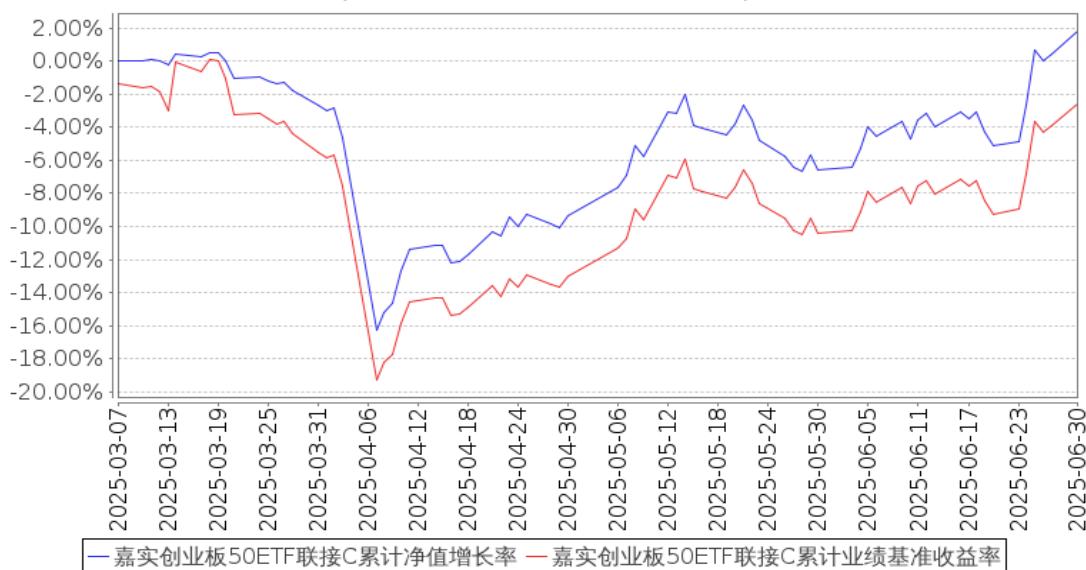
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

**嘉实创业板 50ETF 联接 A 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**  
(2025年03月07日至2025年06月30日)



**嘉实创业板 50ETF 联接 C 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**  
(2025年03月07日至2025年06月30日)



注：(1) 本基金合同生效日 2025 年 03 月 07 日至报告期末未满 1 年。

(2) 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 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

### 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2025年6月30日，基金管理人共管理366只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数组合、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。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		
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 实中证高 端装备细 分 50ETF 发 起 联 接、嘉实 中 证 A500ETF、 嘉实中证 A500ETF 联接、嘉 实创业板 50ETF 基 金经理	2025年3 月7日	-	11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、基金经理、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和指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张超梁	公募基金	9	23,926,438,395.91	2024年1月25日
	私募资产管理计划	1	573,392.22	2024年7月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	10	23,927,011,788.13	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 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，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、《嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金管理基金合同》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 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 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，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

本基金跟踪创业板 50 指数，创业板 50 指数从创业板指数的 100 只样本股中，选取考察期内流动性指标最优的 50 只股票组成样本股。创业板 50 指数侧重样本股流动性、市值集中度和资产配置效率，样本股公司集中了创业板市场内知名度高、市值规模大、流动性好的企业，为投资者提供了分享创业板市场高成长的良好工具。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。

回顾上半年，外部扰动不断，但宏观经济复苏进程仍在持续推进。一季度关税预期压制进出口贸易，但政策持续发力推动部分产业景气度修复，战略性新兴产业尤为突出。4、5 月超预期关税的落地造成了较大冲击，货币政策的进一步宽松和社融改善推动内需结构性改善，高新技术产品出口及高技术制造业增加值大幅提升。总体来看，上半年增量政策效果逐步显现，高新技术产品成为经济发展新动能。海外方面，美国经济的表现极大地影响了降息进程和市场对未来利率水平的预期。1、2 月虽然也有关税不确定性的影响，但美国经济数据总体表现较为积极，美联储对通胀表示关注，3 月并未继续降息。进入二季度，通胀仍未明显下降，同时劳动力市场较为坚挺，5 月平均周薪创历史新高，6 月非农就业超预期，美联储降息预期不断延后。

报告期内，本基金仍处于 6 个月建仓期内。作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实创业板 50ETF 联接 A 基金份额净值为 1.0188 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.88%；截至本报告期末嘉实创业板 50ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0179 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.79%；业绩比较基准收益率为 -2.56%。

## 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，积极的总量政策仍将延续，货币和社融同比增速在低基数的背景下有望保持稳健。随着货币和信贷的宽松推动经济增长、关税等国际贸易冲击逐渐消退，内外需有望相继企稳。

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，本基金未实施利润分配，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产评估并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、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：嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6. 4. 7. 1	23,119,858.18
结算备付金		16,974.13
存出保证金		128,702.94
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	258,935,491.73
其中：股票投资		—
基金投资		258,631,680.00
债券投资		303,811.73
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		10,650,050.61
应收股利		—
应收申购款		2,628,420.68
递延所得税资产		—
其他资产	6. 4. 7. 8	—
资产总计		295,479,498.27
<b>负债和净资产</b>	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
<b>负债：</b>		
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		22,751,715.37

应付管理人报酬		1,883.03
应付托管费		627.69
应付销售服务费		51,999.52
应付投资顾问费		—
应交税费		205,219.85
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.9	81,272.59
负债合计		23,092,718.05
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	267,535,507.27
未分配利润	6.4.7.12	4,851,272.95
净资产合计		272,386,780.22
负债和净资产总计		295,479,498.27

注：本基金合同生效日为 2025 年 03 月 07 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 03 月 07 日起至 2025 年 06 月 30 日止。报告截止日 2025 年 06 月 30 日，嘉实创业板 50ETF 联接 A 基金份额净值 1.0188 元，基金份额总额 75,508,729.49 份，嘉实创业板 50ETF 联接 C 基金份额净值 1.0179 元，基金份额总额 192,026,777.78 份，基金份额总额合计为 267,535,507.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 7 日(基金合同生 效日)至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		3,920,544.65
1. 利息收入		69,895.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	69,895.87
债券利息收入		—
资产支持证券投资收入		—
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）		-39,891,304.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-46,257,686.86
基金投资收益	6.4.7.15	6,299,998.34
债券投资收益	6.4.7.16	27,503.68
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	38,880.00

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	43,731,673.80
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	10,279.82
<b>减：二、营业总支出</b>		358,512.85
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	47,277.50
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	15,759.16
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	200,654.14
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		22,692.33
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	72,129.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,562,031.80
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,562,031.80
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		3,562,031.80

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	实收基金	其他综合收益	未分配利润
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	316,333,619.48		-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,798,112.21		-	4,851,272.95
(一)、综合收益总额	-	-		3,562,031.80
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以	-48,798,112.21		-	1,289,241.15
				-47,508,871.06

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	27,054,755.40	-	-1,836,631.12	25,218,124.28
2. 基金赎回款	-75,852,867.61	-	3,125,872.27	-72,726,995.34
(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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	267,535,507.27	-	4,851,272.95	272,386,780.22

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

嘉实创业板 50 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”)是根据《关于嘉实创业板 50 指数型证券投资基金变更为嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改法律文件的公告》由原嘉实创业板 50 指数型证券投资基金(以下简称“基金创业板 50”)变更而来，原基金创业板 50 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[2025]200 号《关于准予嘉实创业板 50 指数型证券投资基金注册的批复》核准，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《嘉实创业板 50 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，原基金创业板 50《嘉实创业板 50 指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 316,333,619.48 份基金份额。自 2025 年 4 月 9 日起，原基金创业板 50 正式变更为嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《嘉实创业板 50 指数型证券投资基金基金合同》自同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

## 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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

#### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且

保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，

不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

##### **(1) 利息收入**

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### **(2) 投资收益**

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持

证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

#### (3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(4) 基金管理人可每季度对本基金相对业绩比较基准的超额收益率以及本基金的可供分配利润进行评价，在符合收益分配情况下，基金管理人进行收益分配；

(5) 在上述基金收益分配条件的前提下，本基金可每季度进行一次收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值

中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推进营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

(2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳

证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	23,119,858.18
等于： 本金	23,117,798.16
加： 应计利息	2,060.02
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	23,119,858.18

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	299,994.00	3,811.73	303,811.73	6.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	299,994.00	3,811.73	303,811.73	6.00
资产支持证券	-	-	-	-	-
基金	214,900,012.20	-	258,631,680.00	43,731,667.80	
其他	-	-	-	-	-
合计	215,200,006.20	3,811.73	258,935,491.73	43,731,673.80	

### 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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,267.51
其中：交易所市场	14,267.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,005.08
合计	81,272.59

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实创业板 50ETF 联接 A

项目	本期 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	87,752,030.55	87,752,030.55
本期申购	5,651,316.15	5,651,316.15
本期赎回（以“-”号填列）	-17,894,617.21	-17,894,617.21
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	75,508,729.49	75,508,729.49

嘉实创业板 50ETF 联接 C

项目	本期 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	228,581,588.93	228,581,588.93
本期申购	21,403,439.25	21,403,439.25

本期赎回(以“-”号填列)	-57,958,250.40	-57,958,250.40
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	192,026,777.78	192,026,777.78

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2025 年 03 月 07 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 316,333,619.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 54,740.36 份基金份额。

#### 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

##### 嘉实创业板 50ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-10,992,690.01	11,989,253.40	996,563.39
本期基金份额交易产生的变动数	1,259,514.98	-834,474.35	425,040.63
其中：基金申购款	-738,172.05	321,943.97	-416,228.08
基金赎回款	1,997,687.03	-1,156,418.32	841,268.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,733,175.03	11,154,779.05	1,421,604.02

##### 嘉实创业板 50ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-29,176,951.99	31,742,420.40	2,565,468.41
本期基金份额交易产生的变动数	4,255,371.97	-3,391,171.45	864,200.52
其中：基金申购款	-2,967,706.23	1,547,303.19	-1,420,403.04
基金赎回款	7,223,078.20	-4,938,474.64	2,284,603.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,921,580.02	28,351,248.95	3,429,668.93

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,631.58

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	701.10
其他	1,563.19
合计	69,895.87

#### 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
	2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,699,948.55
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-43,557,738.31
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-46,257,686.86

##### 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
	2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	13,057,203.25
减：卖出股票成本总额	15,670,856.84
减：交易费用	86,294.96
买卖股票差价收入	-2,699,948.55

##### 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
	2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
申购基金份额总额	247,190,400.00
减：现金支付申购款总额	432,556.95
减：申购股票成本总额	290,315,581.36
减：交易费用	-
申购差价收入	-43,557,738.31

##### 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	43,059,153.50
减：卖出/赎回基金成本总额	36,566,638.52
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	189,102.38
减：交易费用	3,414.26
基金投资收益	6,299,998.34

### 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	892.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,611.40
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	27,503.68

#### 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	817,146.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	778,511.00
减：应计利息总额	12,014.85
减：交易费用	8.89
买卖债券差价收入	26,611.40

#### 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
	2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	38,880.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	38,880.00

### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	43,731,673.80
股票投资	-
债券投资	6.00
资产支持证券投资	-
基金投资	43,731,667.80
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	43,731,673.80

### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	10,243.42
基金转出费收入	36.40
合计	10,279.82

### 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	19,333.72
信息披露费	47,671.36
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,724.64
其他	400.00
合计	72,129.72

## 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金

## 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,277.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	59,869.64
应支付基金管理人的净管理费	-12,592.14

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所管理的目标 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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,759.16

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 2025年3月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实创业板 50ETF 联接 A	嘉实创业板 50ETF 联接 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	30,529.67	30,529.67
招商银行	-	157,168.39	157,168.39
合计	-	187,698.06	187,698.06

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费率 0.30%，每日计提，逐日累计至每月月末，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×0.30%/当年天数。（2）本基金 A 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 2025年3月7日(基金合同生效日)至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司_活期	23,119,858.18	67,631.58

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(2025年06月30日)，本基金持有252,570,000.00份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 68.90%。

## 6.4.11 利润分配情况

本期(2025年3月7日(基金合同生效日)至2025年6月30日),本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2025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

无。

### 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，还有董事会风险控制与内审委员会、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约责任，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	303,811.73
合计	303,811.73

注：评级取自第三方评级机构。

##### 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

无。

##### 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约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时间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 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	23,119,858.18	-	-	-	23,119,858.18
结算备付金	16,974.13	-	-	-	16,974.13
存出保证金	128,702.94	-	-	-	128,702.94
交易性金融资产	303,811.73	-	-258,631,680.00	-	258,935,491.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-10,650,050.61	-	10,650,050.61
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-2,628,420.68	-	2,628,420.68
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>23,569,346.98</b>	<b>-</b>	<b>-271,910,151.29</b>	<b>295,479,498.27</b>	
<b>负债</b>					
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	-	-	-22,751,715.37	-	22,751,715.37
应付管理人报酬	-	-	-1,883.03	-	1,883.03
应付托管费	-	-	-627.69	-	627.69
应付销售服务费	-	-	-51,999.52	-	51,999.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-205,219.85	-	205,219.85
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-81,272.59	-	81,272.59
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-23,092,718.05</b>	<b>-</b>	<b>23,092,718.05</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>23,569,346.98</b>	<b>-</b>	<b>-248,817,433.24</b>	<b>-</b>	<b>272,386,780.22</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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（2025年6月30日）	
	市场利率上升 25 个基点	-51.94
	市场利率下降 25 个基点	51.96

#### 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（2025年6月30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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	258,631,680.00	94.95
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	258,631,680.00	94.95

#### 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 (2025 年 6 月 30 日)
	业绩比较基准上升 5%	12,477,574.81
	业绩比较基准下降 5%	-12,477,574.81

#### 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 2025 年 6 月 30 日

第一层次	258,631,680.00
第二层次	303,811.73
第三层次	-
合计	258,935,491.73

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	258,631,680.00	87.53
3	固定收益投资	303,811.73	0.10
	其中：债券	303,811.73	0.10
	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	23,136,832.31	7.83
8	其他各项资产	13,407,174.23	4.54
9	合计	295,479,498.27	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

无。

### 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

无。

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	75,910,521.37	27.87
2	300059	东方财富	33,537,727.00	12.31
3	300124	汇川技术	15,312,360.00	5.62
4	300760	迈瑞医疗	14,965,596.44	5.49
5	300274	阳光电源	12,041,083.20	4.42
6	300308	中际旭创	11,311,291.00	4.15
7	300033	同花顺	8,496,686.00	3.12
8	300014	亿纬锂能	7,166,251.00	2.63
9	300502	新易盛	6,929,826.00	2.54
10	300015	爱尔眼科	6,856,549.20	2.52
11	300433	蓝思科技	5,997,190.00	2.20
12	300408	三环集团	5,687,430.00	2.09
13	300476	胜宏科技	5,414,269.00	1.99
14	300896	爱美客	5,343,694.00	1.96
15	300339	润和软件	4,927,216.00	1.81
16	301236	软通动力	4,055,440.00	1.49
17	300442	润泽科技	3,891,355.00	1.43
18	300207	欣旺达	3,569,422.00	1.31
19	300418	昆仑万维	3,484,017.00	1.28
20	300347	泰格医药	3,364,616.68	1.24

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)

1	300750	宁德时代	1,444,343.00	0.53
2	300502	新易盛	1,018,281.00	0.37
3	300760	迈瑞医疗	812,149.00	0.30
4	300124	汇川技术	811,110.00	0.30
5	301308	江波龙	804,843.00	0.30
6	300782	卓胜微	757,235.00	0.28
7	300803	指南针	682,394.25	0.25
8	300476	胜宏科技	610,455.00	0.22
9	300496	中科创达	548,591.00	0.20
10	300223	北京君正	404,727.00	0.15
11	300059	东方财富	404,288.00	0.15
12	300394	天孚通信	377,231.00	0.14
13	300413	芒果超媒	372,507.00	0.14
14	301236	软通动力	370,512.00	0.14
15	300316	晶盛机电	367,282.00	0.13
16	300735	光弘科技	330,473.00	0.12
17	300122	智飞生物	329,461.00	0.12
18	300442	润泽科技	306,301.00	0.11
19	300418	昆仑万维	256,175.00	0.09
20	302132	中航成飞	212,284.00	0.08

#### 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	305,986,438.20
卖出股票收入（成交）总额	13,057,203.25

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	303,811.73	0.11
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,811.73	0.11

## 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	019749	24 国债 15	3,000	303,811.73	0.11

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 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

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	嘉实创业板 50 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	258,631.68 0.00	94.95

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规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	128,702.94
2	应收清算款	10,650,050.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,628,420.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,407,174.23

### 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(%)
嘉实创业板 50ETF 联接 A	1,211	62,352.38	5,257,464.19	6.96	70,251,265.30	93.04
嘉实创业板 50ETF 联接 C	3,453	55,611.58	33,501,302.76	17.45	158,525,475.02	82.55
合计	4,617	57,945.75	38,758,766.95	14.49	228,776,740.32	85.51

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	嘉实创业板 50ETF 联接 A	25,080.81	0.03
	嘉实创业板 50ETF 联接 C	255,002.13	0.13
	合计	280,082.94	0.10

## 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	嘉实创业板 50ETF 联接 A	0
	嘉实创业板 50ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实创业板 50ETF 联接 A	0
	嘉实创业板 50ETF 联接 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实创业板 50ETF 联接 A	嘉实创业板 50ETF 联接 C
基金合同生效日 (2025 年 3 月 7 日) 基金份额总额	87,752,030.55	228,581,588.93
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申购份额	5,651,316.15	21,403,439.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	17,894,617.21	57,958,250.40
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	75,508,729.49	192,026,777.78

注：报告期内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

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金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

本基金管理人于 2025 年 4 月 8 日发布了《关于嘉实创业板 50 指数型证券投资基金变更为嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改法律文件的公告》，本基金管理人与基金托管人协商一致，决定于 2025 年 4 月 9 日起，将嘉实创业板 50 指数型证券投资基金变更为嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，包括但不限于基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。详情请见本基金管理人发布的相关公告。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
方正证券 股份有限 公司	2	154,069,748. 19	48.29	28,642.54	48.29	新增
中信建投 证券股份 有限公司	2	142,893,084. 26	44.79	26,565.43	44.79	新增
中信证券 股份有限 公司	2	22,080,809.0 0	6.92	4,104.20	6.92	新增
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
东海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
国联民生 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
国融证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
国盛证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	新增

国泰海通 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	新增
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	新增
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	新增
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
南京证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	新增
上海证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	新增
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	新增
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	新增
西南证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	新增
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	新增

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) 交易等服务能力较强。

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。

3. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

### 10.7.2 基金租用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 (%)
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1,105,351.14	100.00	-	-	-	-	47,335,443.30	100.00
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券股份	-	-	-	-	-	-	-	-

有限公司								
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于嘉实创业板 50 指数型证券投资 基金开展直销平台认购费率优惠活动 的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2025 年 2 月 18 日
2	嘉实创业板 50 指数型证券投资基金 基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2025 年 3 月 8 日
3	关于嘉实创业板 50 指数型证券投资 基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2025 年 4 月 2 日
4	关于嘉实创业板 50 指数型证券投资 基金变更为嘉实创业板 50 交易型开放式指 数证券投资基金联接基金并修改法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2025 年 4 月 8 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员 变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实创业板 50 指数型证券投资基金注册的批复文件。

- (2)《嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金管理基金合同》;
- (3)《嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金管理基金托管协议》;
- (4)《嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金管理基金招募说明书》;
- (5)基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6)报告期内嘉实创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金管理基金公告的各项原稿。

## 11.2 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

## 11.3 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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日