

嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 2013 年半年度报告

2013 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 26 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	45
7.9 期末投资目标基金明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
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.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实中创 400ETF 联接
基金主代码	070030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	98,010,125.19 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 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	中国工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；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。
业绩比较基准	中创 400 指数收益率*95% + 银行活期存款税后利率*5%
风险收益特征	本基金为中创 400ETF 的联接基金，主要通过投资于中创 400ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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

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	中创 400 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

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	(010) 65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65182266	(010)66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100005	100140
法定代表人		安奎	姜建清

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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

2.5 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	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 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	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	9,243,936.19
本期利润	31,025,466.68
加权平均基金份额本期利润	0.1763
本期加权平均净值利润率	17.40%
本期基金份额净值增长率	12.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	1,772,486.55
期末可供分配基金份额利润	0.0181
期末基金资产净值	99,782,611.74
期末基金份额净值	1.0181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.81%

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) 所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。

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

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	-11.70%	1.96%	-12.16%	2.00%	0.46%	-0.04%
过去三个月	1.24%	1.63%	0.77%	1.66%	0.47%	-0.03%
过去六个月	12.05%	1.53%	12.06%	1.56%	-0.01%	-0.03%
过去一年	4.35%	1.49%	4.91%	1.51%	-0.56%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.81%	1.36%	-3.01%	1.46%	4.82%	-0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中创 400 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

中创 400 指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前 6 个月的平均流通市值的比重和平均成交金额的比重按 2:1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名在位于 101-500 名的股票。

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：

$$\text{Benchmark}(0)=1000$$

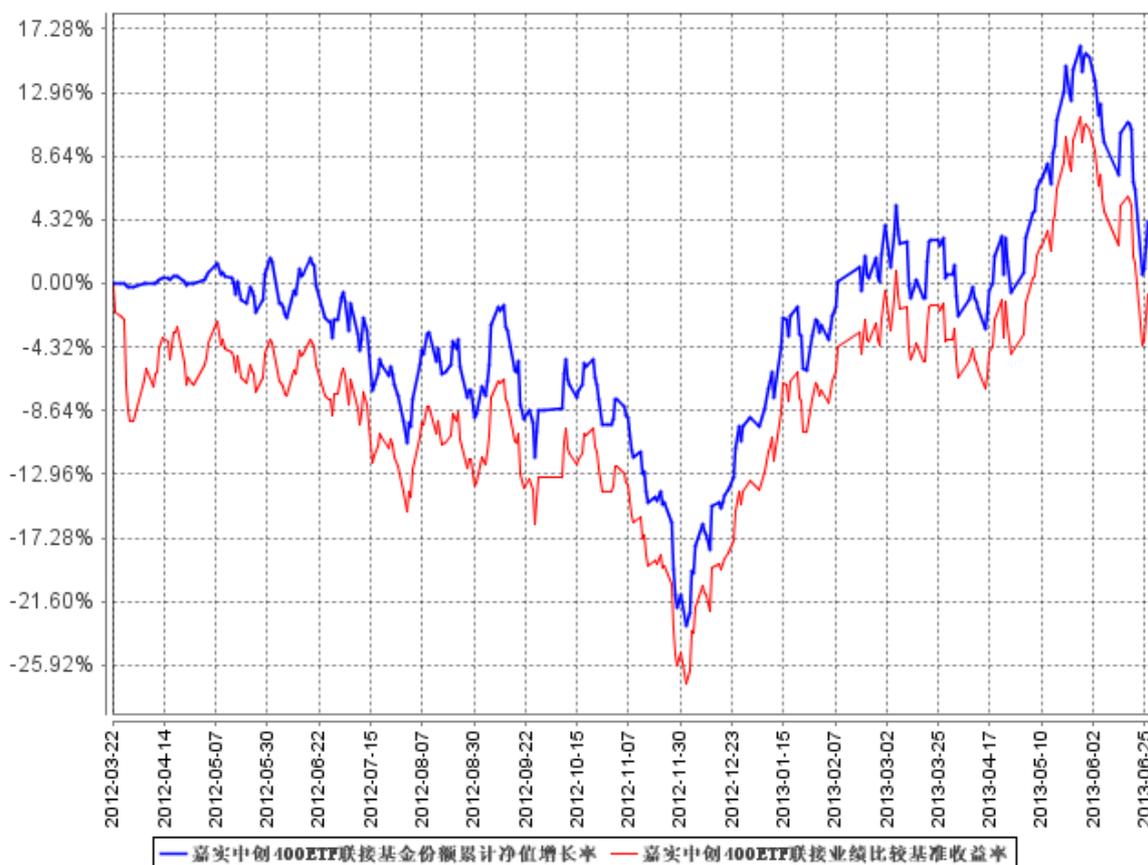
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{中创 400 指数收益率}(t)+5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实中创400ETF联接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



图：嘉实中创 400ETF 联接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
 (2012 年 3 月 22 日至 2013 年 6 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“第十一部分二、投资范围和六、投资限制（一）投资组合限制”的有关约定。

§ 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2013 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、47 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产 (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、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII) 等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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		
杨宇	本基金、嘉实中创 400ETF、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证 500ETF 及其联接	2012 年 3 月 22 日	-	15 年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家(天同) 180 指数基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金。南开大

	基金、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证中期国债 ETF 及其联接基金基金经理、公司指数投资部总监				学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。
--	--	--	--	--	-----------------------

注：(1) 任职日期是指本基金基金合同生效之日；(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 管理人对报告期内本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、《嘉实中创 400 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 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

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.0343%，年度化拟合偏离度为 0.5426%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 1.0181 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.05%，业绩比较基准收益率为 12.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《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与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。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对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) 根据基金合同第十五部分三、基金收益分配原则“1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%”，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合法律法规的规定及基金合同的相关约定。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,306,106.57	11,042,308.42
结算备付金		-	-
存出保证金		28,604.03	333,333.34
交易性金融资产	6.4.7.2	93,894,362.54	189,252,064.46
其中：股票投资		2,069,759.50	2,050,681.85
基金投资		91,824,603.04	187,201,382.61
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,692,486.01
应收利息	6.4.7.5	1,288.85	2,152.46
应收股利		-	-
应收申购款		491,841.26	45,804.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	61,733.80	-
资产总计		101,783,937.05	203,368,149.21

负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
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		-	-
应付证券清算款		1,229,052.09	-
应付赎回款		502,681.73	2,467,733.08
应付管理人报酬		3,778.84	6,308.61
应付托管费		755.77	1,261.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	85,112.68	6,446.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	179,944.20	469,300.35
负债合计		2,001,325.31	2,951,050.18
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	98,010,125.19	220,566,085.04
未分配利润	6.4.7.10	1,772,486.55	-20,148,986.01
所有者权益合计		99,782,611.74	200,417,099.03
负债和所有者权益总计		101,783,937.05	203,368,149.21

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0181 元，基金份额总额 98,010,125.19 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年3月22日(基 金合同生效日)至 2012年6月30日
一、收入		31,530,118.40	-5,060,623.37
1.利息收入		43,193.50	858,237.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,193.50	209,832.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	648,404.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益		9,544,491.06	309,763.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,085,764.76	443,726.03

基金投资收益	6.4.7.13	8,441,413.83	-400,023.01
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	17,312.47	266,060.47
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	21,781,530.49	-6,405,093.31
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	160,903.35	176,469.37
减：二、费用		504,651.72	618,500.15
1. 管理人报酬		35,039.95	260,254.48
2. 托管费		7,007.96	52,050.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	279,570.64	236,308.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	183,033.17	69,885.95
三、利润总额		31,025,466.68	-5,679,123.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润		31,025,466.68	-5,679,123.52

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 3 月 22 日，上年度可比期间为 2012 年 3 月 22 日至 2012 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	220,566,085.04	-20,148,986.01	200,417,099.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,025,466.68	31,025,466.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-122,555,959.85	-9,103,994.12	-131,659,953.97
其中：1. 基金申购款	55,583,049.90	2,772,286.43	58,355,336.33
2. 基金赎回款	-178,139,009.75	-11,876,280.55	-190,015,290.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	98,010,125.19	1,772,486.55	99,782,611.74
项目	上年度可比期间 2012年3月22日(基金合同生效日)至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	378,434,953.27	-	378,434,953.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,679,123.52	-5,679,123.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-137,483,375.72	-180,884.35	-137,664,260.07
其中：1. 基金申购款	3,504,560.10	6,441.48	3,511,001.58
2. 基金赎回款	-140,987,935.82	-187,325.83	-141,175,261.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	240,951,577.55	-5,860,007.87	235,091,569.68

注：本基金合同生效日为 2012 年 3 月 22 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2012 年 3 月 22 日至 2012 年 06 月 30 日。

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：

 赵学军 李松林 王红
 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

嘉实中创 400 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”)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[2012]13 号《关于核准嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 378,368,900.43 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 063 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接

基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 378,434,953.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,052.84 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中创 400 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本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,力争使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%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。正常情况下,本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中创 400 指数收益率 X 95% + 银行活期存款税后利率 X 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	7,306,106.57
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	7,306,106.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,079,184.64	2,069,759.50	-9,425.14
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	90,496,490.48	91,824,603.04	1,328,112.56
其他	-	-	-
合计	92,575,675.12	93,894,362.54	1,318,687.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

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

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,277.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	11.61
合计	1,288.85

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-

应收替代款	61,733.80
合计	61,733.80

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	85,112.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	85,112.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,425.71
预提费用	178,518.49
合计	179,944.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	220,566,085.04	220,566,085.04
本期申购	55,583,049.90	55,583,049.90
本期赎回	-178,139,009.75	-178,139,009.75
本期末	98,010,125.19	98,010,125.19

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,497,854.49	-18,651,131.52	-20,148,986.01
本期利润	9,243,936.19	21,781,530.49	31,025,466.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,407,201.00	-7,696,793.12	-9,103,994.12
其中：基金申购款	788,909.19	1,983,377.24	2,772,286.43
基金赎回款	-2,196,110.19	-9,680,170.36	-11,876,280.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,338,880.70	-4,566,394.15	1,772,486.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,766.85
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	90.70
其他	335.95
合计	43,193.50

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,217,974.56
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-132,209.80
合计	1,085,764.76

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	134,151,264.60
减：卖出股票成本总额	132,933,290.04
买卖股票差价收入	1,217,974.56

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	3,074,700.00
减：现金支付申购款总额	261,712.54
减：申购股票成本总额	2,945,197.26
申购差价收入	-132,209.80

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	128,720,822.35

减：卖出/赎回基金成本总额	120,279,408.52
基金投资收益	8,441,413.83

6.4.7.14 债券投资收益

本期（2013年1月1日至2013年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2013年1月1日至2013年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,312.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,312.47

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	21,781,530.49
——股票投资	-46,398.46
——债券投资	-
——基金投资	21,827,928.95
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	21,781,530.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	138,563.02
基金转出费收入	22,340.33
合计	160,903.35

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	279,570.64
银行间市场交易费用	-
合计	279,570.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	4,514.68
合计	183,033.17

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

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（中国工商银行）	基金托管人、基金代销机构
中创 400 交易型开放式指数证券投资基金（嘉实中创 400ETF）	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

本期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 3 月 22 日(基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,039.95	260,254.48
其中：支付销售机构的客户维护费	137,759.53	136,505.11

注 1：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人嘉实基金管理有限公司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 0.5% 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) × 0.5% / 当年天数。

注 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 3 月 22 日(基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,007.96	52,050.92

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国工商银行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 0.1% 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) × 0.1% / 当年天数。

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

本期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2012 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2012 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本期末（2013 年 6 月 30 日）及上年度末（2012 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,306,106.57	42,766.85	11,218,953.46	200,407.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2012 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金持有 90,218,710.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 84.66%。

6.4.11 利润分配情况

本期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2013 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

本期末（2013 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002170	芭田	2013 年	重大	5.39	2013 年	5.45	80	440.49	431.20	-

	股份	6月25日	事项停牌		7月2日					
002211	宏达新材	2013年6月3日	重大事项停牌	5.62	-	-	2,600	14,584.22	14,612.00	-
002229	鸿博股份	2013年6月17日	重大事项停牌	7.16	2013年7月9日	6.44	82	584.28	587.12	-
002240	威华股份	2013年4月16日	重大事项停牌	4.77	-	-	32,800	157,100.19	156,456.00	-
002289	宇顺电子	2013年6月18日	重大事项停牌	19.07	-	-	100	1,922.52	1,907.00	-
002312	三泰电子	2013年6月27日	重大事项停牌	15.83	2013年8月12日	7.66	100	1,411.63	1,583.00	-
002322	理工监测	2013年6月6日	重大事项停牌	14.62	2013年8月8日	13.80	100	1,464.97	1,462.00	-
002390	信邦制药	2013年5月31日	重大事项停牌	17.13	-	-	1,900	32,595.07	32,547.00	-
300020	银江股份	2013年6月3日	重大事项停牌	22.67	-	-	1,800	40,723.38	40,806.00	-
300133	华策影视	2013年5月28日	重大事项停牌	24.43	2013年7月30日	26.87	7,253	177,101.04	177,190.79	-

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

本期末（2013年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2013年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

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

本基金为 ETF 联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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，属

于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和

款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，但投资目标 ETF 基金和标的指数成份股不受此限。本基金所持大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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,306,106.57	-	-	-	7,306,106.57
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	28,604.03	-	-	-	28,604.03
交易性金融资产	-	-	-	93,894,362.54	93,894,362.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,288.85	1,288.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	17,494.04	-	-	474,347.22	491,841.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	61,733.80	61,733.80
资产总计	7,352,204.64	-	-	94,431,732.41	101,783,937.05
负债					
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,229,052.09	1,229,052.09
应付赎回款	-	-	-	502,681.73	502,681.73

应付管理人报酬	-	-	-	3,778.84	3,778.84
应付托管费	-	-	-	755.77	755.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	85,112.68	85,112.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,944.20	179,944.20
负债总计	-	-	-	2,001,325.31	2,001,325.31
利率敏感度缺口	7,352,204.64	-	-	92,430,407.10	99,782,611.74
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,042,308.42	-	-	-	11,042,308.42
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	333,333.34	333,333.34
交易性金融资产	-	-	-	189,252,064.46	189,252,064.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,692,486.01	2,692,486.01
应收利息	-	-	-	2,152.46	2,152.46
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	497.02	-	-	45,307.50	45,804.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,042,805.44	-	-	192,325,343.77	203,368,149.21
负债					
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,467,733.08	2,467,733.08
应付管理人报酬	-	-	-	6,308.61	6,308.61
应付托管费	-	-	-	1,261.71	1,261.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,446.43	6,446.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	469,300.35	469,300.35
负债总计	-	-	2,951,050.18	2,951,050.18
利率敏感度缺口	11,042,805.44	-	189,374,293.59	200,417,099.03

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

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.3 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。本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和债券，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中目标 ETF 资产比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,069,759.50	2.07	2,050,681.85	1.02
交易性金融资产-基金投资	91,824,603.04	92.02	187,201,382.61	93.41
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	93,894,362.54	94.10	189,252,064.46	94.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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（2013年6月30日）
	业绩比较基准上升 5%	4,910,661.54
	业绩比较基准下降 5%	-4,910,661.54

注：于 2012 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层级的余额为 93,466,780.43 元,属于第二层级的余额为 427,582.11 元,无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日:第一层级 189,153,302.86 元,第二层级 98,761.60 元,无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级;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级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,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	2,069,759.50	2.03
	其中:股票	2,069,759.50	2.03
2	基金投资	91,824,603.04	90.22
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,306,106.57	7.18
7	其他各项资产	583,467.94	0.57
	合计	101,783,937.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	26,933.20	0.03
B	采矿业	19,815.67	0.02
C	制造业	1,379,874.94	1.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,566.74	0.01
E	建筑业	75,976.79	0.08
F	批发和零售业	36,615.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,806.00	0.00
H	住宿和餐饮业	8,801.12	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,318.77	0.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,657.08	0.02
L	租赁和商务服务业	57,406.50	0.06
M	科学研究和技术服务业	8,756.86	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	29,489.04	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,330.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	194,411.79	0.19
S	综合	-	-
	合计	2,069,759.50	2.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300133	华策影视	7,253	177,190.79	0.18
2	002240	威华股份	32,800	156,456.00	0.16
3	300020	银江股份	1,800	40,806.00	0.04
4	002390	信邦制药	1,900	32,547.00	0.03
5	300058	蓝色光标	675	28,147.50	0.03
6	002400	省广股份	700	18,480.00	0.02
7	300088	长信科技	800	16,872.00	0.02
8	300059	东方财富	1,138	15,419.90	0.02
9	002211	宏达新材	2,600	14,612.00	0.01
10	300228	富瑞特装	178	14,240.00	0.01

11	300079	数码视讯	597	12,513.12	0.01
12	300257	开山股份	375	12,431.25	0.01
13	300273	和佳股份	578	12,380.76	0.01
14	300026	红日药业	361	12,252.34	0.01
15	300251	光线传媒	376	12,035.76	0.01
16	300029	天龙光电	1,568	11,540.48	0.01
17	300315	掌趣科技	347	11,444.06	0.01
18	300072	三聚环保	689	11,058.45	0.01
19	002317	众生药业	500	10,985.00	0.01
20	300168	万达信息	400	10,796.00	0.01
21	300055	万邦达	269	10,517.90	0.01
22	300039	上海凯宝	818	10,347.70	0.01
23	002573	国电清新	635	10,337.80	0.01
24	300002	神州泰岳	640	10,233.60	0.01
25	300090	盛运股份	326	10,066.88	0.01
26	002410	广联达	530	10,048.80	0.01
27	300124	汇川技术	275	9,622.25	0.01
28	300212	易华录	318	9,540.00	0.01
29	002325	洪涛股份	800	9,520.00	0.01
30	300157	恒泰艾普	274	9,474.92	0.01
31	002477	雏鹰农牧	600	9,474.00	0.01
32	002052	同洲电子	1,300	9,191.00	0.01
33	300147	香雪制药	543	9,111.54	0.01
34	002482	广田股份	420	8,820.00	0.01
35	002185	华天科技	1,128	8,719.44	0.01
36	002255	海陆重工	500	8,600.00	0.01
37	002653	海思科	300	8,550.00	0.01
38	002431	棕榈园林	440	8,342.40	0.01
39	002440	闰土股份	400	8,268.00	0.01
40	002266	浙富股份	800	8,096.00	0.01
41	002308	威创股份	880	8,096.00	0.01
42	002646	青青稞酒	400	8,096.00	0.01
43	300017	网宿科技	205	7,988.85	0.01
44	002429	兆驰股份	1,050	7,864.50	0.01
45	002638	勤上光电	558	7,705.98	0.01
46	002663	普邦园林	500	7,535.00	0.01
47	002176	江特电机	734	7,472.12	0.01
48	002271	东方雨虹	400	7,400.00	0.01
49	002138	顺络电子	411	7,398.00	0.01

50	002018	华星化工	1,056	7,254.72	0.01
51	002665	首航节能	300	7,185.00	0.01
52	300054	鼎龙股份	400	6,876.00	0.01
53	002309	中利科技	600	6,828.00	0.01
54	002550	千红制药	200	6,746.00	0.01
55	002436	兴森科技	400	6,740.00	0.01
56	002475	立讯精密	320	6,720.00	0.01
57	002151	北斗星通	200	6,670.00	0.01
58	002501	利源铝业	560	6,641.60	0.01
59	300006	莱美药业	300	6,609.00	0.01
60	002148	北纬通信	200	6,528.00	0.01
61	300142	沃森生物	175	6,525.75	0.01
62	002368	太极股份	340	6,524.60	0.01
63	002508	老板电器	200	6,524.00	0.01
64	002070	众和股份	800	6,344.00	0.01
65	300015	爱尔眼科	300	6,330.00	0.01
66	002393	力生制药	200	6,256.00	0.01
67	002480	新筑股份	400	6,200.00	0.01
68	002083	孚日股份	1,700	6,188.00	0.01
69	002055	得润电子	600	6,150.00	0.01
70	300077	国民技术	400	6,136.00	0.01
71	300101	国腾电子	390	6,080.10	0.01
72	002263	大东南	900	6,021.00	0.01
73	002563	森马服饰	300	6,000.00	0.01
74	002551	尚荣医疗	220	5,997.20	0.01
75	002465	海格通信	200	5,990.00	0.01
76	002221	东华能源	556	5,938.08	0.01
77	300057	万顺股份	409	5,869.15	0.01
78	002332	仙琚制药	500	5,830.00	0.01
79	300068	南都电源	902	5,817.90	0.01
80	300115	长盈精密	180	5,785.20	0.01
81	002261	拓维信息	400	5,784.00	0.01
82	002305	南国置业	700	5,775.00	0.01
83	002010	传化股份	710	5,743.90	0.01
84	002408	齐翔腾达	500	5,725.00	0.01
85	002396	星网锐捷	400	5,696.00	0.01
86	002023	海特高新	504	5,685.12	0.01
87	002701	奥瑞金	200	5,640.00	0.01
88	002367	康力电梯	500	5,595.00	0.01

89	002635	安洁科技	122	5,498.54	0.01
90	002012	凯恩股份	1,075	5,450.25	0.01
91	002049	同方国芯	200	5,428.00	0.01
92	002554	惠博普	485	5,427.15	0.01
93	300052	中青宝	166	5,424.88	0.01
94	300274	阳光电源	335	5,413.60	0.01
95	002042	华孚色纺	1,023	5,401.44	0.01
96	002603	以岭药业	235	5,348.60	0.01
97	002526	山东矿机	1,100	5,324.00	0.01
98	300005	探路者	552	5,266.08	0.01
99	300009	安科生物	362	5,241.76	0.01
100	002181	粤传媒	600	5,220.00	0.01
101	002467	二六三	300	5,214.00	0.01
102	300014	亿纬锂能	220	5,192.00	0.01
103	002444	巨星科技	400	5,172.00	0.01
104	002437	誉衡药业	200	5,114.00	0.01
105	300204	舒泰神	177	5,088.75	0.01
106	002251	步步高	230	5,087.60	0.01
107	002165	红宝丽	1,000	5,060.00	0.01
108	002521	齐峰股份	700	5,054.00	0.01
109	002067	景兴纸业	2,559	5,041.23	0.01
110	002604	龙力生物	350	5,033.00	0.01
111	002421	达实智能	300	4,992.00	0.01
112	002186	全聚德	356	4,991.12	0.01
113	002259	升达林业	1,100	4,961.00	0.00
114	002339	积成电子	600	4,872.00	0.00
115	300185	通裕重工	1,360	4,841.60	0.00
116	002341	新纶科技	300	4,818.00	0.00
117	002479	富春环保	660	4,804.80	0.00
118	002179	中航光电	400	4,800.00	0.00
119	300144	宋城股份	360	4,788.00	0.00
120	002324	普利特	300	4,686.00	0.00
121	002079	苏州固锝	1,023	4,562.58	0.00
122	300171	东富龙	181	4,553.96	0.00
123	002298	鑫龙电器	600	4,548.00	0.00
124	002118	紫鑫药业	642	4,526.10	0.00
125	002268	卫士通	300	4,524.00	0.00
126	002249	大洋电机	600	4,506.00	0.00
127	300118	东方日升	780	4,469.40	0.00

128	002060	粤水电	1,177	4,425.52	0.00
129	002648	卫星石化	200	4,394.00	0.00
130	002163	中航三鑫	1,040	4,357.60	0.00
131	002216	三全食品	300	4,347.00	0.00
132	002414	高德红外	200	4,340.00	0.00
133	002424	贵州百灵	300	4,311.00	0.00
134	002080	中材科技	300	4,308.00	0.00
135	002561	徐家汇	600	4,308.00	0.00
136	300197	铁汉生态	170	4,299.30	0.00
137	002481	双塔食品	200	4,280.00	0.00
138	002407	多氟多	400	4,276.00	0.00
139	002021	中捷股份	1,050	4,252.50	0.00
140	002133	广宇集团	1,060	4,218.80	0.00
141	300177	中海达	235	4,183.00	0.00
142	002316	键桥通讯	520	4,170.40	0.00
143	002078	太阳纸业	942	4,154.22	0.00
144	002630	华西能源	200	4,140.00	0.00
145	002470	金正大	294	4,139.52	0.00
146	002215	诺普信	627	4,113.12	0.00
147	300137	先河环保	220	4,109.60	0.00
148	002089	新海宜	751	4,107.97	0.00
149	002628	成都路桥	486	4,082.40	0.00
150	002121	科陆电子	600	4,056.00	0.00
151	002384	东山精密	300	4,053.00	0.00
152	002130	沃尔核材	700	4,046.00	0.00
153	002220	天宝股份	600	4,044.00	0.00
154	300004	南风股份	200	4,026.00	0.00
155	002288	超华科技	600	4,020.00	0.00
156	300045	华力创通	300	4,014.00	0.00
157	002153	石基信息	200	4,004.00	0.00
158	002086	东方海洋	500	4,000.00	0.00
159	002234	民和股份	475	3,990.00	0.00
160	002097	山河智能	700	3,955.00	0.00
161	002371	七星电子	200	3,940.00	0.00
162	002439	启明星辰	200	3,936.00	0.00
163	002177	御银股份	1,185	3,934.20	0.00
164	002108	沧州明珠	500	3,920.00	0.00
165	002376	新北洋	500	3,905.00	0.00
166	002583	海能达	200	3,900.00	0.00

167	002126	银轮股份	700	3,878.00	0.00
168	002014	永新股份	450	3,870.00	0.00
169	002283	天润曲轴	800	3,848.00	0.00
170	002463	沪电股份	1,200	3,840.00	0.00
171	002327	富安娜	300	3,834.00	0.00
172	300156	天立环保	354	3,833.82	0.00
173	002449	国星光电	500	3,815.00	0.00
174	002306	湘鄂情	600	3,810.00	0.00
175	300122	智飞生物	100	3,795.00	0.00
176	002496	辉丰股份	300	3,780.00	0.00
177	002285	世联地产	380	3,777.20	0.00
178	002567	唐人神	500	3,775.00	0.00
179	002556	辉隆股份	700	3,773.00	0.00
180	002039	黔源电力	318	3,761.94	0.00
181	002253	川大智胜	260	3,746.60	0.00
182	300022	吉峰农机	628	3,730.32	0.00
183	002378	章源钨业	200	3,730.00	0.00
184	002035	华帝股份	380	3,720.20	0.00
185	002009	天奇股份	410	3,702.30	0.00
186	002031	巨轮股份	653	3,656.80	0.00
187	300215	电科院	238	3,634.26	0.00
188	002045	国光电器	754	3,604.12	0.00
189	002334	英威腾	496	3,600.96	0.00
190	002020	京新药业	360	3,600.00	0.00
191	300152	燃控科技	400	3,600.00	0.00
192	002319	乐通股份	500	3,595.00	0.00
193	002411	九九久	650	3,581.50	0.00
194	002564	张化机	400	3,576.00	0.00
195	002672	东江环保	101	3,571.36	0.00
196	300291	华录百纳	100	3,571.00	0.00
197	002094	青岛金王	500	3,540.00	0.00
198	002226	江南化工	300	3,516.00	0.00
199	002447	壹桥苗业	200	3,510.00	0.00
200	002430	杭氧股份	500	3,500.00	0.00
201	002457	青龙管业	500	3,500.00	0.00
202	002099	海翔药业	632	3,476.00	0.00
203	002016	世荣兆业	480	3,456.00	0.00
204	002276	万马电缆	800	3,456.00	0.00
205	002297	博云新材	300	3,435.00	0.00

206	002318	久立特材	200	3,426.00	0.00
207	300080	新大新材	550	3,421.00	0.00
208	002342	巨力索具	600	3,414.00	0.00
209	300135	宝利沥青	560	3,410.40	0.00
210	002566	益盛药业	232	3,398.80	0.00
211	002466	天齐锂业	100	3,392.00	0.00
212	002416	爱施德	400	3,384.00	0.00
213	002182	云海金属	500	3,350.00	0.00
214	002588	史丹利	120	3,316.80	0.00
215	002033	丽江旅游	325	3,315.00	0.00
216	002115	三维通信	600	3,312.00	0.00
217	002135	东南网架	1,000	3,310.00	0.00
218	002490	山东墨龙	400	3,292.00	0.00
219	002345	潮宏基	300	3,291.00	0.00
220	300102	乾照光电	409	3,288.36	0.00
221	002203	海亮股份	464	3,248.00	0.00
222	300064	豫金刚石	768	3,225.60	0.00
223	300134	大富科技	262	3,196.40	0.00
224	300034	钢研高纳	205	3,191.85	0.00
225	002443	金洲管道	400	3,188.00	0.00
226	300105	龙源技术	120	3,180.00	0.00
227	002144	宏达高科	200	3,166.00	0.00
228	002302	西部建设	345	3,153.30	0.00
229	002313	日海通讯	190	3,133.10	0.00
230	300172	中电环保	225	3,132.00	0.00
231	002087	新野纺织	1,000	3,130.00	0.00
232	002461	珠江啤酒	400	3,124.00	0.00
233	002204	大连重工	304	3,122.08	0.00
234	002497	雅化集团	300	3,114.00	0.00
235	002218	拓日新能	500	3,060.00	0.00
236	002423	中原特钢	300	3,051.00	0.00
237	002547	春兴精工	300	3,006.00	0.00
238	002222	福晶科技	500	2,995.00	0.00
239	002503	搜于特	260	2,956.20	0.00
240	002392	北京利尔	500	2,935.00	0.00
241	002068	黑猫股份	700	2,926.00	0.00
242	002369	卓翼科技	200	2,916.00	0.00
243	002307	北新路桥	600	2,910.00	0.00
244	002157	正邦科技	500	2,895.00	0.00

245	002214	大立科技	300	2,895.00	0.00
246	002264	新华都	600	2,880.00	0.00
247	002159	三特索道	200	2,848.00	0.00
248	002278	神开股份	330	2,814.90	0.00
249	002192	路翔股份	200	2,812.00	0.00
250	002650	加加食品	200	2,810.00	0.00
251	002272	川润股份	600	2,778.00	0.00
252	002075	沙钢股份	1,100	2,772.00	0.00
253	002256	彩虹精化	450	2,736.00	0.00
254	300021	大禹节水	361	2,718.33	0.00
255	300048	合康变频	375	2,700.00	0.00
256	002136	安纳达	400	2,696.00	0.00
257	002595	豪迈科技	100	2,689.00	0.00
258	002629	仁智油服	300	2,685.00	0.00
259	002194	武汉凡谷	400	2,672.00	0.00
260	002232	启明信息	450	2,659.50	0.00
261	300355	蒙草抗旱	100	2,659.00	0.00
262	002100	天康生物	350	2,653.00	0.00
263	002156	通富微电	630	2,646.00	0.00
264	002358	森源电气	200	2,642.00	0.00
265	002454	松芝股份	300	2,634.00	0.00
266	002172	澳洋科技	700	2,632.00	0.00
267	002015	霞客环保	431	2,624.79	0.00
268	002489	浙江永强	300	2,622.00	0.00
269	002132	恒星科技	700	2,618.00	0.00
270	002043	兔宝宝	800	2,616.00	0.00
271	002225	濮耐股份	475	2,612.50	0.00
272	002187	广百股份	400	2,608.00	0.00
273	002085	万丰奥威	300	2,601.00	0.00
274	300301	长方照明	184	2,590.72	0.00
275	002386	天原集团	400	2,580.00	0.00
276	300150	世纪瑞尔	375	2,580.00	0.00
277	300175	朗源股份	720	2,570.40	0.00
278	300224	正海磁材	178	2,570.32	0.00
279	002017	东信和平	256	2,562.56	0.00
280	002131	利欧股份	305	2,562.00	0.00
281	002596	海南瑞泽	260	2,535.00	0.00
282	002003	伟星股份	309	2,533.80	0.00
283	002433	太安堂	200	2,518.00	0.00

284	002281	光迅科技	100	2,512.00	0.00
285	002109	兴化股份	526	2,509.02	0.00
286	002441	众业达	200	2,506.00	0.00
287	002512	达华智能	200	2,500.00	0.00
288	002054	德美化工	418	2,491.28	0.00
289	002474	榕基软件	300	2,490.00	0.00
290	002574	明牌珠宝	210	2,475.90	0.00
291	002320	海峡股份	300	2,475.00	0.00
292	002535	林州重机	490	2,464.70	0.00
293	002171	精诚铜业	400	2,464.00	0.00
294	002662	京威股份	400	2,444.00	0.00
295	300082	奥克股份	282	2,422.38	0.00
296	002419	天虹商场	300	2,400.00	0.00
297	002206	海利得	500	2,395.00	0.00
298	002469	三维工程	150	2,340.00	0.00
299	002245	澳洋顺昌	450	2,331.00	0.00
300	002212	南洋股份	600	2,328.00	0.00
301	300181	佐力药业	184	2,311.04	0.00
302	300316	晶盛机电	200	2,300.00	0.00
303	002046	轴研科技	400	2,288.00	0.00
304	300183	东软载波	81	2,282.58	0.00
305	002258	利尔化学	200	2,276.00	0.00
306	002493	荣盛石化	300	2,265.00	0.00
307	002586	围海股份	205	2,238.60	0.00
308	300084	海默科技	220	2,228.60	0.00
309	300298	三诺生物	50	2,217.50	0.00
310	002036	宜科科技	354	2,212.50	0.00
311	002228	合兴包装	400	2,196.00	0.00
312	300307	慈星股份	275	2,172.50	0.00
313	300044	赛为智能	300	2,166.00	0.00
314	002205	国统股份	215	2,145.70	0.00
315	002238	天威视讯	200	2,140.00	0.00
316	002349	精华制药	200	2,136.00	0.00
317	002088	鲁阳股份	300	2,106.00	0.00
318	002095	生意宝	100	2,105.00	0.00
319	300073	当升科技	235	2,091.50	0.00
320	002600	江粉磁材	230	2,056.20	0.00
321	002538	司尔特	200	2,050.00	0.00
322	002637	赞宇科技	220	2,048.20	0.00

323	002401	中海科技	200	2,042.00	0.00
324	002612	朗姿股份	100	2,036.00	0.00
325	002585	双星新材	268	2,031.44	0.00
326	002445	中南重工	300	1,986.00	0.00
327	002119	康强电子	300	1,974.00	0.00
328	002061	江山化工	372	1,971.60	0.00
329	002412	汉森制药	100	1,965.00	0.00
330	002301	齐心文具	400	1,964.00	0.00
331	002362	汉王科技	200	1,962.00	0.00
332	002160	常铝股份	530	1,961.00	0.00
333	002460	赣锋锂业	100	1,940.00	0.00
334	002074	东源电器	442	1,935.96	0.00
335	002608	舜天船舶	100	1,918.00	0.00
336	002289	宇顺电子	100	1,907.00	0.00
337	002208	合肥城建	361	1,906.08	0.00
338	300189	神农大丰	232	1,902.40	0.00
339	002062	宏润建设	453	1,898.07	0.00
340	002149	西部材料	200	1,850.00	0.00
341	002498	汉缆股份	350	1,848.00	0.00
342	002641	永高股份	200	1,824.00	0.00
343	002248	华东数控	300	1,821.00	0.00
344	002117	东港股份	240	1,819.20	0.00
345	300239	东宝生物	216	1,818.72	0.00
346	002598	山东章鼓	309	1,807.65	0.00
347	002116	中国海诚	160	1,785.60	0.00
348	002110	三钢闽光	318	1,780.80	0.00
349	002326	永太科技	200	1,734.00	0.00
350	002164	东力传动	500	1,725.00	0.00
351	002418	康盛股份	300	1,713.00	0.00
352	002338	奥普光电	100	1,692.00	0.00
353	002287	奇正藏药	100	1,680.00	0.00
354	002174	梅花伞	100	1,670.00	0.00
355	002350	北京科锐	200	1,650.00	0.00
356	002084	海鸥卫浴	390	1,641.90	0.00
357	002137	实益达	345	1,635.30	0.00
358	002610	爱康科技	300	1,620.00	0.00
359	300148	天舟文化	118	1,614.24	0.00
360	002296	辉煌科技	100	1,596.00	0.00
361	002606	大连电瓷	100	1,588.00	0.00

362	002312	三泰电子	100	1,583.00	0.00
363	002189	利达光电	244	1,576.24	0.00
364	002101	广东鸿图	200	1,568.00	0.00
365	002077	大港股份	300	1,524.00	0.00
366	002210	飞马国际	300	1,506.00	0.00
367	002231	奥维通信	300	1,497.00	0.00
368	300187	永清环保	72	1,496.88	0.00
369	002158	汉钟精机	140	1,486.80	0.00
370	300238	冠昊生物	87	1,473.78	0.00
371	002090	金智科技	200	1,468.00	0.00
372	002322	理工监测	100	1,462.00	0.00
373	002321	华英农业	300	1,461.00	0.00
374	002417	三元达	234	1,457.82	0.00
375	002568	百润股份	100	1,445.00	0.00
376	300143	星河生物	178	1,441.80	0.00
377	002243	通产丽星	250	1,432.50	0.00
378	002290	禾盛新材	200	1,420.00	0.00
379	002197	证通电子	200	1,338.00	0.00
380	002134	天津普林	275	1,331.00	0.00
381	002098	浔兴股份	169	1,196.52	0.00
382	002274	华昌化工	200	1,162.00	0.00
383	002679	福建金森	100	1,154.00	0.00
384	002413	常发股份	172	1,121.44	0.00
385	002057	中钢天源	100	1,112.00	0.00
386	300103	达刚路机	100	1,095.00	0.00
387	002438	江苏神通	100	1,086.00	0.00
388	002626	金达威	100	1,067.00	0.00
389	002542	中化岩土	100	1,061.00	0.00
390	002394	联发股份	100	1,052.00	0.00
391	002178	延华智能	100	997.00	0.00
392	002291	星期六	200	990.00	0.00
393	002239	金飞达	100	980.00	0.00
394	002691	石煤装备	100	980.00	0.00
395	002195	海隆软件	100	972.00	0.00
396	300127	银河磁体	60	965.40	0.00
397	002246	北化股份	100	813.00	0.00
398	002279	久其软件	100	756.00	0.00
399	002111	威海广泰	100	713.00	0.00
400	002193	山东如意	100	689.00	0.00

401	002229	鸿博股份	82	587.12	0.00
402	002170	芭田股份	80	431.20	0.00
403	002227	奥 特 迅	25	397.75	0.00

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002477	雏鹰农牧	54,379.35	0.03
2	300039	上海凯宝	52,947.00	0.03
3	002294	信立泰	52,511.00	0.03
4	002400	省广股份	52,464.00	0.03
5	002344	海宁皮城	52,154.00	0.03
6	300072	三聚环保	51,270.00	0.03
7	300058	蓝色光标	49,667.00	0.02
8	002431	棕榈园林	46,858.00	0.02
9	002482	广田股份	43,624.00	0.02
10	300026	红日药业	43,542.00	0.02
11	002429	兆驰股份	42,434.00	0.02
12	300088	长信科技	41,989.00	0.02
13	300059	东方财富	40,487.00	0.02
14	300257	开山股份	40,321.00	0.02
15	002273	水晶光电	40,242.00	0.02
16	002052	同洲电子	39,866.00	0.02
17	300079	数码视讯	39,522.00	0.02
18	002456	欧菲光	39,143.00	0.02
19	002325	洪涛股份	38,939.00	0.02
20	300002	神州泰岳	38,114.00	0.02

7.4.2 累计卖出金额前 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002456	欧菲光	1,489,226.85	0.74
2	300058	蓝色光标	1,387,213.84	0.69
3	002344	海宁皮城	1,277,217.99	0.64

4	002294	信立泰	1,155,613.74	0.58
5	300088	长信科技	1,076,428.38	0.54
6	002400	省广股份	1,030,011.82	0.51
7	002273	水晶光电	997,527.57	0.50
8	300072	三聚环保	940,875.54	0.47
9	300257	开山股份	931,650.01	0.46
10	300039	上海凯宝	859,433.02	0.43
11	300228	富瑞特装	814,371.20	0.41
12	002477	雏鹰农牧	791,588.14	0.39
13	300026	红日药业	769,482.97	0.38
14	300124	汇川技术	764,960.28	0.38
15	300273	和佳股份	744,598.87	0.37
16	002052	同洲电子	726,544.57	0.36
17	300079	数码视讯	725,279.74	0.36
18	300251	光线传媒	723,105.81	0.36
19	002311	海大集团	720,759.37	0.36
20	002482	广田股份	711,824.17	0.36

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	6,860,831.41
卖出股票收入（成交）总额	134,151,264.60

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（成交单价乘以成交数量）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

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.9 期末投资目标基金明细

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	嘉实中创 400ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	91,824,603.04	92.02

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	28,604.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,288.85
5	应收申购款	491,841.26
6	其他应收款	61,733.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	583,467.94

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300133	华策影视	177,190.79	0.18	重大事项停牌
2	002240	威华股份	156,456.00	0.16	重大事项停牌
3	300020	银江股份	40,806.00	0.04	重大事项停牌
4	002390	信邦制药	32,547.00	0.03	重大事项停牌

5	002211	宏达新材	14,612.00	0.01	重大事项停牌
---	--------	------	-----------	------	--------

§ 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

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
2,698	36,326.96	4,999,400.00	5.10%	93,010,725.19	94.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 3 月 22 日) 基金份额总额	378,434,953.27
本报告期期初基金份额总额	220,566,085.04
本报告期基金总申购份额	55,583,049.90
减:本报告期基金总赎回份额	178,139,009.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	98,010,125.19

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。

§ 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	141,012,101.01	100.00%	127,512.20	100.00%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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。

注 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

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。

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	关于嘉实财富管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 1 月 22 日
2	关于旗下部分基金在中国工商银行开通基金定投业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 2 月 22 日
3	关于增加交通银行为嘉实旗下开放式基金代销机构并开展定投业务及参与交通银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 18 日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 1 日
5	嘉实基金管理有限公司关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 9 日
6	关于增加包商银行作为嘉实旗下开放式基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 19 日
7	关于增加中国国际金融有限公司为嘉实旗下开放式基金代销机构	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 4 月 19 日

	的公告		
8	关于增加中信银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与中信银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 5 月 24 日
9	嘉实基金管理有限公司关于增加杭州联合农村商业银行股份有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 20 日
10	嘉实基金管理有限公司关于开通支付宝直销网上交易和电话交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 6 月 26 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中创 400 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。

11.2 存放地点

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

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2013 年 8 月 26 日