

嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 25 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 2014 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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 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.....	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.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 期末投资目标基金明细.....	46
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.13 投资组合报告附注.....	47

§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.....	48
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的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
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.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
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.....	51
§11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§ 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	98,137,038.45 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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	931,374.56
本期利润	4,306,672.98
加权平均基金份额本期利润	0.0466
本期加权平均净值利润率	3.53%
本期基金份额净值增长率	6.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	15,352,856.71
期末可供分配基金份额利润	0.1564
期末基金资产净值	132,042,754.28
期末基金份额净值	1.3455
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	34.55%

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	4.17%	1.12%	4.36%	1.14%	-0.19%	-0.02%
过去三个月	5.04%	1.14%	5.03%	1.15%	0.01%	-0.01%
过去六个月	6.64%	1.39%	7.08%	1.40%	-0.44%	-0.01%
过去一年	32.16%	1.43%	33.65%	1.46%	-1.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	34.55%	1.39%	29.63%	1.46%	4.92%	-0.07%

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：

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

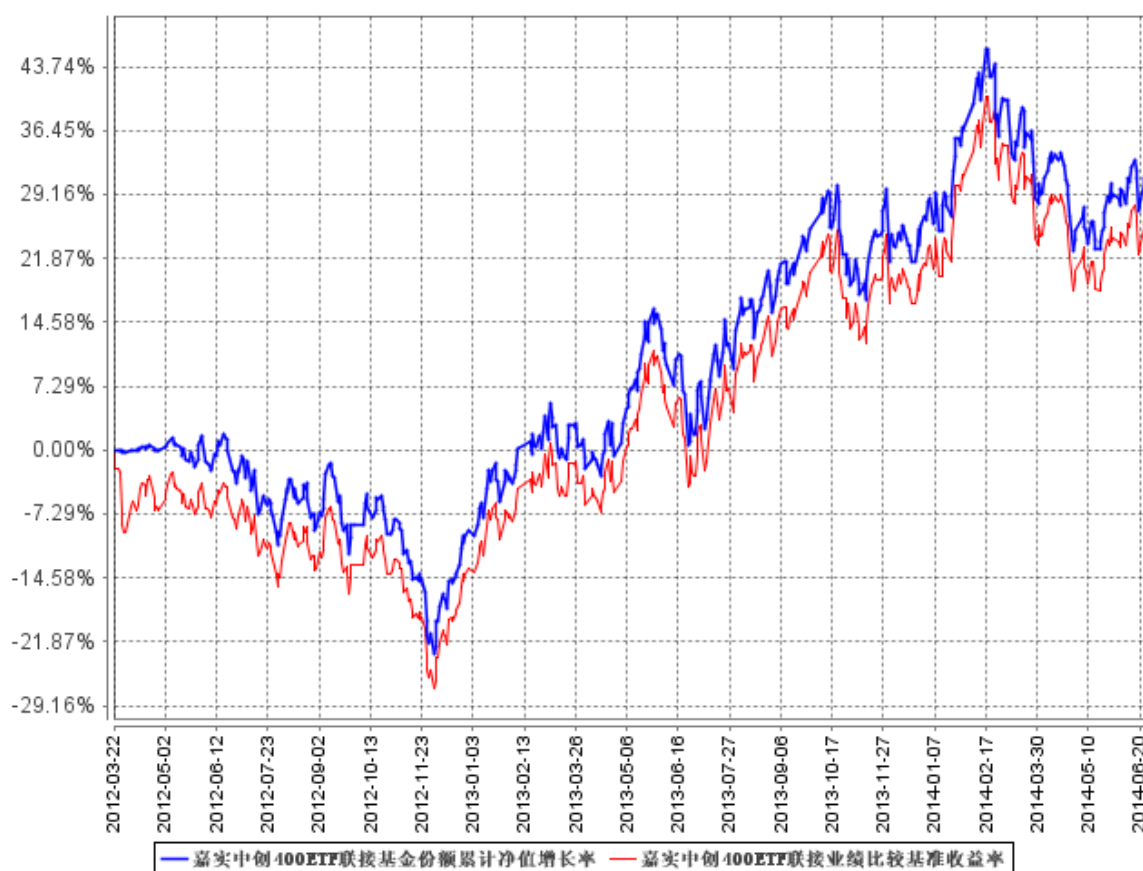
$$\text{Return}(t)=95\% \times \text{中创 400 指数收益率}(t) + 5\% \times \text{银行活期存款税后利率}$$

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

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 2014 年 6 月 30 日)

注 1：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。

注 2：2014 年 5 月 9 日，本基金管理人发布《关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理；聘请何如女士担任本基金基金经理职务。

§ 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 2014 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、62 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、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)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券等证券投资基金。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		

何如	本基金、嘉实中创 400ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 基金经理	2014 年 5 月 9 日	-	8 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任公司指数投资部基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证 500ETF 及其联接、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF) 基金经理, 公司指数投资部总监	2012 年 3 月 22 日	2014 年 5 月 9 日	16 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。南开大学经济学硕士, 具有基金从业资格, 中国国籍。

注: (1) 基金经理杨宇的任职日期是指本基金基金合同生效之日, 基金经理何如的任职日期指公司作出决定后公告之日, 离任日期指公司作出决定后公告之日; (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合规守信情况的说明

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，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 3 次，均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，但不存在利益输送行为。

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

截至报告期末，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.44%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35%的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于本基金的申购赎回、样本股分红、样本股调整的冲击以及目标 ETF 偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3455 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.64%，业绩比较基准收益率为 7.08%。

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。期望中创 400ETF 联接基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

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、监察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

报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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遵规守信、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 2014 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,354,586.74	5,177,872.00
结算备付金		6,392.92	17,902.47
存出保证金		18,724.99	14,168.89
交易性金融资产	6.4.7.2	124,998,814.91	82,464,440.50
其中：股票投资		2,505,363.56	564,370.00
基金投资		122,493,451.35	81,900,070.50
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		445,064.64	-
应收利息	6.4.7.5	1,302.01	1,060.41
应收股利		-	-
应收申购款		64,379.07	1,157,107.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	309,758.75
资产总计		132,889,265.28	89,142,310.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 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		-	1,437,458.49
应付赎回款		655,142.16	262,134.99
应付管理人报酬		4,276.54	2,822.94
应付托管费		855.30	564.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,585.56	12,206.47
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	175,651.44	350,840.26
负债合计		846,511.00	2,066,027.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	98,137,038.45	69,013,005.85
未分配利润	6.4.7.10	33,905,715.83	18,063,277.15
所有者权益合计		132,042,754.28	87,076,283.00
负债和所有者权益总计		132,889,265.28	89,142,310.73

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3455 元，基金份额总额 98,137,038.45 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		4,579,364.24	31,530,118.40
1.利息收入		27,834.32	43,193.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,834.32	43,193.50
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		1,107,466.52	9,544,491.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	696,088.57	1,085,764.76
基金投资收益	6.4.7.13	395,958.36	8,441,413.83
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	15,419.59	17,312.47
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	3,375,298.42	21,781,530.49
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	68,764.98	160,903.35
减：二、费用		272,691.26	504,651.72
1. 管理人报酬		24,699.37	35,039.95
2. 托管费		4,939.83	7,007.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	68,181.87	279,570.64
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	174,870.19	183,033.17
三、利润总额		4,306,672.98	31,025,466.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润		4,306,672.98	31,025,466.68

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	69,013,005.85	18,063,277.15	87,076,283.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,306,672.98	4,306,672.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	29,124,032.60	11,535,765.70	40,659,798.30
其中：1. 基金申购款	76,071,155.20	27,161,189.75	103,232,344.95
2. 基金赎回款	-46,947,122.60	-15,625,424.05	-62,572,546.65
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）	98,137,038.45	33,905,715.83	132,042,754.28
项目	上年度可比期间 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

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：

<u> 赵学军 </u>	<u> 李松林 </u>	<u> 王红 </u>
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》和在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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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[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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票的差价收入, 股权的股息、红利收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 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。对基金持有的上市公司限售股, 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) 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	7,354,586.74
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	7,354,586.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,408,267.60	2,505,363.56	97,095.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	103,509,753.46	122,493,451.35	18,983,697.89
其他	-	-	-
合计	105,918,021.06	124,998,814.91	19,080,793.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末 (2014 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（2014 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（2014 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 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,291.84
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	2.61
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.56
合计	1,302.01

6.4.7.6 其他资产

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,585.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,585.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,090.54
预提费用	173,560.90

应付指数使用费	-
其他	-
合计	175,651.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,013,005.85	69,013,005.85
本期申购	76,071,155.20	76,071,155.20
本期赎回	-46,947,122.60	-46,947,122.60
本期末	98,137,038.45	98,137,038.45

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	9,928,630.60	8,134,646.55	18,063,277.15
本期利润	931,374.56	3,375,298.42	4,306,672.98
本期基金份额交易产生的变动数	4,492,851.55	7,042,914.15	11,535,765.70
其中：基金申购款	11,734,412.81	15,426,776.94	27,161,189.75
基金赎回款	-7,241,561.26	-8,383,862.79	-15,625,424.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,352,856.71	18,552,859.12	33,905,715.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
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	805.68
其他	943.81
合计	27,834.32

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
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	148,321.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	547,767.57
合计	696,088.57

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,726,302.18
减：卖出股票成本总额	9,577,981.18
买卖股票差价收入	148,321.00

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	38,822,700.00
减：现金支付申购款总额	1,830,906.13
减：申购股票成本总额	36,444,026.30
申购差价收入	547,767.57

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	2,262,653.27
减：卖出/赎回基金成本总额	1,866,694.91
基金投资收益	395,958.36

6.4.7.14 债券投资收益

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 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（2014 年 1 月 1 日至 2014 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,419.59

基金投资产生的股利收益	-
合计	15,419.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	3,375,298.42
——股票投资	-121,241.55
——债券投资	-
——基金投资	3,496,539.97
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,375,298.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	27,344.40
基金转出费收入	41,420.58
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
其他	-
合计	68,764.98

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	68,181.87
银行间市场交易费用	-
合计	68,181.87

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	24,795.19

信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	909.29
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	400.00
合计	174,870.19

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

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	24,699.37	35,039.95
其中:支付销售机构的客户维护费	61,779.22	137,759.53

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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,939.83	7,007.96

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(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2013 年 1 月 1 日至 2013 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(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日),基金管理人未运用固有资金投资本产品。

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（2014 年 06 月 30 日）及上年度末（2013 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	7,354,586.74	26,084.83	7,306,106.57	42,766.85

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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 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

报告期末（2014 年 6 月 30 日），本基金持有 89,653,408.00 份目标 ETF 基金份额（2013 年 12 月 31 日：64,255,508.00 份），占其总份额的比例为 93.82%（2013 年 12 月 31 日：87.35%）。

6.4.11 利润分配情况

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2014 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002089	新海宜	2014 年 6 月 23 日	2014 年 7 月 1 日	配股未上市	3.61	9.47	330	1,191.30	3,125.10	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2014 年 6 月 30 日），本基金未持有流通受限的其他证券。

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
002551	尚荣医疗	2014年6月12日	重大事项停牌	34.01	未知	未知	600	20,843.88	20,406.00	-
300295	三五网	2014年4月11日	重大事项停牌	96.81	2014年7月8日	105.00	200	19,829.00	19,362.00	-
002263	大东南	2014年3月31日	重大事项停牌	4.66	2014年7月23日	5.13	3,190	16,688.74	14,865.40	-
002638	勤上光电	2014年6月10日	重大事项停牌	14.15	2014年7月15日	14.75	1,000	13,121.94	14,150.00	-
002306	湘鄂情	2014年6月20日	重大事项停牌	5.57	2014年7月29日	6.13	1,900	11,509.08	10,583.00	-
300137	先河环保	2014年6月16日	重大事项停牌	20.86	2014年8月15日	14.31	500	10,326.71	10,430.00	-
002565	上海绿新	2014年6月16日	重大事项停牌	8.64	2014年7月7日	9.10	1,200	10,514.85	10,368.00	-
002074	东源电器	2014年4月1日	重大事项停牌	7.28	未知	未知	1,400	9,393.52	10,192.00	-
002151	北斗星通	2014年5月19日	重大事项停牌	24.80	2014年8月15日	27.28	400	11,065.20	9,920.00	-
002131	利欧股份	2014年4月22日	重大事项停牌	19.50	2014年7月3日	21.45	500	8,997.34	9,750.00	-
002466	天齐锂业	2014年4月29日	重大事项停牌	43.16	未知	未知	200	9,331.87	8,632.00	-
300181	佐力药业	2014年6月12日	重大事项停牌	11.99	2014年7月7日	13.19	680	7,960.45	8,153.20	-
002564	张化机	2014年5月26日	重大事项	6.35	未知	未知	1,200	7,884.00	7,620.00	-

		日	停牌							
002156	通富微电	2014年6月25日	重大事项停牌	7.97	2014年7月1日	7.90	900	6,414.44	7,173.00	-
002035	华帝股份	2014年6月27日	重大事项停牌	9.89	2014年7月2日	10.58	720	7,041.85	7,120.80	-
002554	惠博普	2014年6月30日	重大事项停牌	10.76	2014年7月1日	11.84	600	6,632.79	6,456.00	-
002635	安洁科技	2014年6月30日	重大事项停牌	31.99	2014年8月5日	35.19	200	6,989.55	6,398.00	-
002100	天康生物	2014年5月27日	重大事项停牌	9.82	未知	未知	600	5,915.81	5,892.00	-
002090	金智科技	2014年6月23日	重大事项停牌	14.30	2014年7月7日	14.50	300	3,897.15	4,290.00	-
002149	西部材料	2014年5月26日	重大事项停牌	13.70	2014年7月15日	15.07	300	3,805.57	4,110.00	-
002679	福建金森	2014年5月28日	重大事项停牌	15.54	未知	未知	200	3,237.00	3,108.00	-
002319	乐通股份	2014年6月18日	重大事项停牌	8.16	2014年7月10日	7.85	300	2,223.01	2,448.00	-
002629	仁智油服	2014年1月8日	重大事项停牌	12.22	2014年7月8日	13.44	200	2,444.00	2,444.00	-

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（2014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（2014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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2013 年 12 月 31 日：同)。

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 2014 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 2014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	7,354,586.74	-	-	-	7,354,586.74
结算备付金	6,392.92	-	-	-	6,392.92
存出保证金	18,724.99	-	-	-	18,724.99
交易性金融资产	-	-	-	124,998,814.91	124,998,814.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	445,064.64	445,064.64
应收利息	-	-	-	1,302.01	1,302.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	7,782.12	-	-	56,596.95	64,379.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,387,486.77	-	-	125,501,778.51	132,889,265.28
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	-	-	-	655,142.16	655,142.16
应付管理人报酬	-	-	-	4,276.54	4,276.54
应付托管费	-	-	-	855.30	855.30

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,585.56	10,585.56
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	175,651.44	175,651.44
负债总计	-	-	-	846,511.00	846,511.00
利率敏感度缺口	7,387,486.77	-	-	124,655,267.51	132,042,754.28
上年度末 2013 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	5,177,872.00	-	-	-	5,177,872.00
结算备付金	17,902.47	-	-	-	17,902.47
存出保证金	14,168.89	-	-	-	14,168.89
交易性金融资产	-	-	-	82,464,440.50	82,464,440.50
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	-	-	-	1,060.41	1,060.41
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	7,390.47	-	-	1,149,717.24	1,157,107.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	309,758.75	309,758.75
资产总计	5,217,333.83	-	-	83,924,976.90	89,142,310.73
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	-	-	-	1,437,458.49	1,437,458.49
应付赎回款	-	-	-	262,134.99	262,134.99
应付管理人报酬	-	-	-	2,822.94	2,822.94
应付托管费	-	-	-	564.58	564.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	12,206.47	12,206.47
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	350,840.26	350,840.26
负债总计	-	-	-	2,066,027.73	2,066,027.73
利率敏感度缺口	5,217,333.83	-	-	81,858,949.17	87,076,283.00

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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2013 年 12 月 31 日：同）。

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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	2,505,363.56	1.90	564,370.00	0.65
交易性金融资产-基金投资	122,493,451.35	92.77	81,900,070.50	94.06
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	124,998,814.91	94.67	82,464,440.50	94.70

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	6,524,856.17	4,280,048.30
	业绩比较基准下降5%	-6,524,856.17	-4,280,048.30

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2014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124,794,943.51元，属于第二层级的余额为203,871.40元，无属于第三层

级的余额(2013年12月31日：第一层级 82,435,077.50 元，第二层级 29,363.00 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	2,505,363.56	1.89
	其中：股票	2,505,363.56	1.89
2	基金投资	122,493,451.35	92.18
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,360,979.66	5.54
8	其他各项资产	529,470.71	0.40
	合计	132,889,265.28	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,038.50	0.02
B	采矿业	25,308.00	0.02

C	制造业	1,883,107.68	1.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,750.00	0.01
E	建筑业	74,163.72	0.06
F	批发和零售业	49,547.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	8,188.00	0.01
H	住宿和餐饮业	17,603.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	262,564.29	0.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,863.00	0.01
L	租赁和商务服务业	14,524.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	36,694.11	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	46,479.60	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,362.66	0.01
R	文化、体育和娱乐业	23,170.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	2,505,363.56	1.90

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	300026	红日药业	700	20,510.00	0.02
2	002551	尚荣医疗	600	20,406.00	0.02
3	300295	三六五网	200	19,362.00	0.01
4	300147	香雪制药	700	18,900.00	0.01
5	300273	和佳股份	600	18,420.00	0.01
6	002266	浙富控股	2,500	17,725.00	0.01
7	002240	威华股份	700	17,367.00	0.01
8	002440	闰土股份	900	16,650.00	0.01
9	300077	国民技术	600	16,524.00	0.01
10	300257	开山股份	500	15,845.00	0.01
11	002437	誉衡药业	300	15,450.00	0.01
12	300115	长盈精密	700	15,414.00	0.01

13	002153	石基信息	300	15,390.00	0.01
14	002263	大东南	3,190	14,865.40	0.01
15	300168	万达信息	800	14,680.00	0.01
16	300212	易华录	460	14,407.20	0.01
17	002049	同方国芯	600	14,250.00	0.01
18	300020	银江股份	464	14,198.40	0.01
19	002638	勤上光电	1,000	14,150.00	0.01
20	002595	豪迈科技	300	14,145.00	0.01
21	300291	华录百纳	400	14,036.00	0.01
22	300101	振芯科技	600	13,572.00	0.01
23	002185	华天科技	1,209	13,516.62	0.01
24	002368	太极股份	400	13,396.00	0.01
25	002023	海特高新	700	13,370.00	0.01
26	300015	爱尔眼科	549	13,362.66	0.01
27	300144	宋城演艺	500	13,290.00	0.01
28	300274	阳光电源	800	13,208.00	0.01
29	002439	启明星辰	600	12,834.00	0.01
30	002271	东方雨虹	500	12,425.00	0.01
31	300122	智飞生物	500	12,110.00	0.01
32	300039	上海凯宝	960	12,038.40	0.01
33	300005	探路者	760	11,734.40	0.01
34	300157	恒泰艾普	900	11,646.00	0.01
35	002470	金正大	600	11,514.00	0.01
36	002630	华西能源	620	11,346.00	0.01
37	002665	首航节能	400	11,296.00	0.01
38	002396	星网锐捷	400	11,196.00	0.01
39	300134	大富科技	300	11,160.00	0.01
40	002268	卫士通	300	11,115.00	0.01
41	300090	盛运股份	700	11,025.00	0.01
42	002148	北纬通信	500	10,900.00	0.01
43	002067	景兴纸业	2,400	10,872.00	0.01
44	002432	九安医疗	500	10,830.00	0.01
45	002460	赣锋锂业	300	10,800.00	0.01
46	002052	同洲电子	1,200	10,788.00	0.01
47	300113	顺网科技	440	10,648.00	0.01
48	002390	信邦制药	500	10,635.00	0.01
49	002508	老板电器	375	10,601.25	0.01
50	002306	湘鄂情	1,900	10,583.00	0.01
51	002573	国电清新	600	10,548.00	0.01

52	002179	中航光电	600	10,530.00	0.01
53	300137	先河环保	500	10,430.00	0.01
53	002138	顺络电子	500	10,430.00	0.01
54	002309	中利科技	598	10,399.22	0.01
55	002565	上海绿新	1,200	10,368.00	0.01
56	300228	富瑞特装	200	10,232.00	0.01
57	002421	达实智能	400	10,192.00	0.01
57	002074	东源电器	1,400	10,192.00	0.01
58	002312	三泰电子	500	10,185.00	0.01
59	300238	冠昊生物	200	10,172.00	0.01
60	002436	兴森科技	400	10,080.00	0.01
61	300142	沃森生物	290	10,071.70	0.01
62	300347	泰格医药	300	10,050.00	0.01
63	002317	众生药业	500	9,985.00	0.01
64	002151	北斗星通	400	9,920.00	0.01
65	002424	贵州百灵	400	9,864.00	0.01
66	002131	利欧股份	500	9,750.00	0.01
67	002550	千红制药	500	9,675.00	0.01
68	002195	海隆软件	200	9,570.00	0.01
69	002501	利源精制	700	9,513.00	0.01
70	002181	粤传媒	600	9,480.00	0.01
71	002477	雏鹰农牧	1,000	9,410.00	0.01
72	300177	中海达	600	9,330.00	0.01
73	002018	华星化工	1,100	9,328.00	0.01
74	002433	太安堂	900	9,270.00	0.01
75	300205	天喻信息	600	9,240.00	0.01
76	002467	二六三	800	9,224.00	0.01
77	300068	南都电源	1,000	9,150.00	0.01
78	300055	万邦达	300	9,015.00	0.01
79	002020	京新药业	500	9,000.00	0.01
80	002497	雅化集团	900	8,910.00	0.01
81	002431	棕榈园林	500	8,900.00	0.01
82	002603	以岭药业	300	8,826.00	0.01
83	002168	深圳惠程	1,200	8,808.00	0.01
84	002089	新海宜	930	8,807.10	0.01
85	002176	江特电机	700	8,771.00	0.01
86	002393	力生制药	300	8,757.00	0.01
87	300006	莱美药业	300	8,730.00	0.01
88	002466	天齐锂业	200	8,632.00	0.01

89	002444	巨星科技	900	8,550.00	0.01
90	002313	日海通讯	690	8,549.10	0.01
91	002118	紫鑫药业	600	8,490.00	0.01
92	300054	鼎龙股份	700	8,470.00	0.01
93	002249	大洋电机	600	8,340.00	0.01
94	002334	英威腾	600	8,322.00	0.01
95	300034	钢研高纳	500	8,305.00	0.01
96	002325	洪涛股份	1,000	8,200.00	0.01
97	002672	东江环保	300	8,199.00	0.01
98	002583	海能达	300	8,178.00	0.01
99	300181	佐力药业	680	8,153.20	0.01
100	002521	齐峰新材	800	8,104.00	0.01
101	002371	七星电子	400	8,024.00	0.01
102	002408	齐翔腾达	573	7,987.62	0.01
103	002079	苏州固锝	1,100	7,964.00	0.01
104	300014	亿纬锂能	500	7,885.00	0.01
105	002341	新纶科技	400	7,856.00	0.01
106	002126	银轮股份	700	7,847.00	0.01
107	300012	华测检测	400	7,836.00	0.01
108	300004	南风股份	212	7,822.80	0.01
109	002474	榕基软件	900	7,767.00	0.01
110	300355	蒙草抗旱	300	7,746.00	0.01
111	002646	青青稞酒	500	7,745.00	0.01
112	002123	荣信股份	1,000	7,670.00	0.01
113	300074	华平股份	500	7,625.00	0.01
114	002564	张化机	1,200	7,620.00	0.01
115	002108	沧州明珠	600	7,602.00	0.01
116	002070	众和股份	1,100	7,590.00	0.01
117	002276	万马股份	1,200	7,572.00	0.01
118	002384	东山精密	742	7,501.62	0.01
119	002253	川大智胜	300	7,485.00	0.01
120	002358	森源电气	300	7,458.00	0.01
121	002013	中航机电	500	7,405.00	0.01
122	002177	御银股份	1,300	7,371.00	0.01
123	300171	东富龙	200	7,306.00	0.01
124	002454	松芝股份	580	7,302.20	0.01
125	002414	高德红外	400	7,276.00	0.01
126	300037	新宙邦	200	7,260.00	0.01
127	002216	三全食品	402	7,256.10	0.01

128	002285	世联行	900	7,209.00	0.01
129	300183	东软载波	200	7,200.00	0.01
130	002214	大立科技	400	7,192.00	0.01
131	300111	向日葵	2,100	7,182.00	0.01
132	002663	普邦园林	600	7,176.00	0.01
133	002156	通富微电	900	7,173.00	0.01
134	300303	聚飞光电	390	7,172.10	0.01
135	002130	沃尔核材	700	7,168.00	0.01
136	002229	鸿博股份	400	7,148.00	0.01
137	002407	多氟多	500	7,140.00	0.01
138	002035	华帝股份	720	7,120.80	0.01
139	002318	久立特材	400	7,084.00	0.01
140	002186	全聚德	400	7,020.00	0.01
141	002117	东港股份	400	6,920.00	0.01
142	002642	荣之联	300	6,885.00	0.01
143	002281	光迅科技	200	6,878.00	0.01
144	300156	天立环保	500	6,875.00	0.01
145	002345	潮宏基	400	6,848.00	0.01
146	002010	传化股份	800	6,824.00	0.01
147	002021	中捷股份	1,100	6,820.00	0.01
148	002192	路翔股份	300	6,798.00	0.01
149	300001	特锐德	500	6,780.00	0.01
150	002604	龙力生物	550	6,776.00	0.01
150	300053	欧比特	400	6,776.00	0.01
151	002332	仙琚制药	850	6,766.00	0.01
152	002221	东华能源	600	6,714.00	0.01
153	002566	益盛药业	500	6,705.00	0.01
154	002481	双塔食品	500	6,700.00	0.01
155	002449	国星光电	700	6,678.00	0.01
156	002288	超华科技	700	6,615.00	0.01
156	002367	康力电梯	900	6,615.00	0.01
157	002097	山河智能	800	6,600.00	0.00
157	002376	新北洋	600	6,600.00	0.00
158	002083	孚日股份	1,600	6,544.00	0.00
159	002610	爱康科技	500	6,520.00	0.00
160	002009	天奇股份	600	6,504.00	0.00
161	300083	劲胜精密	300	6,498.00	0.00
162	300316	晶盛机电	350	6,485.50	0.00
163	002480	新筑股份	900	6,471.00	0.00

164	002554	惠博普	600	6,456.00	0.00
165	002251	步步高	500	6,440.00	0.00
166	002626	金达威	320	6,419.20	0.00
167	300288	朗玛信息	100	6,413.00	0.00
168	002635	安洁科技	200	6,398.00	0.00
169	002204	大连重工	500	6,380.00	0.00
170	002085	万丰奥威	300	6,378.00	0.00
171	002700	新疆浩源	300	6,360.00	0.00
172	002369	卓翼科技	700	6,356.00	0.00
173	300150	世纪瑞尔	400	6,336.00	0.00
174	002618	丹邦科技	200	6,318.00	0.00
175	002259	升达林业	1,000	6,270.00	0.00
176	300118	东方日升	800	6,240.00	0.00
177	002339	积成电子	700	6,223.00	0.00
178	300009	安科生物	440	6,221.60	0.00
179	002526	山东矿机	1,000	6,180.00	0.00
180	002111	威海广泰	400	6,100.00	0.00
181	002215	诺普信	810	6,058.80	0.00
182	002308	威创股份	900	6,012.00	0.00
183	002218	拓日新能	600	5,994.00	0.00
184	002469	三维工程	520	5,985.20	0.00
185	300298	三诺生物	150	5,985.00	0.00
185	002482	广田股份	500	5,985.00	0.00
186	300045	华力创通	300	5,955.00	0.00
187	002416	爱施德	400	5,940.00	0.00
188	002556	辉隆股份	700	5,915.00	0.00
189	002037	久联发展	600	5,892.00	0.00
189	002100	天康生物	600	5,892.00	0.00
190	002561	徐家汇	600	5,868.00	0.00
191	300207	欣旺达	200	5,840.00	0.00
192	002055	得润电子	600	5,766.00	0.00
193	002496	辉丰股份	420	5,724.60	0.00
194	002648	卫星石化	400	5,724.00	0.00
195	002094	青岛金王	500	5,700.00	0.00
195	002121	科陆电子	600	5,700.00	0.00
196	300187	永清环保	200	5,676.00	0.00
197	002255	海陆重工	500	5,675.00	0.00
198	002461	珠江啤酒	400	5,648.00	0.00
199	300073	当升科技	300	5,640.00	0.00

200	300080	新大新材	700	5,628.00	0.00
201	002362	汉王科技	300	5,592.00	0.00
202	002298	鑫龙电器	800	5,584.00	0.00
203	300185	通裕重工	1,300	5,564.00	0.00
203	002095	生意宝	260	5,564.00	0.00
204	002601	佰利联	300	5,550.00	0.00
205	002447	壹桥苗业	450	5,530.50	0.00
206	002316	键桥通讯	649	5,522.99	0.00
207	002203	海亮股份	500	5,505.00	0.00
208	002174	游族网络	100	5,503.00	0.00
209	300032	金龙机电	300	5,490.00	0.00
209	002297	博云新材	500	5,490.00	0.00
210	002307	北新路桥	810	5,467.50	0.00
211	002563	森马服饰	200	5,430.00	0.00
212	300128	锦富新材	400	5,420.00	0.00
213	002031	巨轮股份	700	5,411.00	0.00
214	002479	富春环保	700	5,390.00	0.00
215	002165	红宝丽	1,000	5,380.00	0.00
216	300336	新文化	200	5,368.00	0.00
217	002078	太阳纸业	1,700	5,355.00	0.00
218	002588	史丹利	260	5,330.00	0.00
219	002411	九九久	700	5,306.00	0.00
220	002170	芭田股份	1,000	5,300.00	0.00
221	002378	章源钨业	300	5,274.00	0.00
222	002080	中材科技	500	5,220.00	0.00
223	002489	浙江永强	500	5,210.00	0.00
224	002017	东信和平	390	5,202.60	0.00
225	002296	辉煌科技	200	5,200.00	0.00
226	002264	新华都	700	5,166.00	0.00
227	300229	拓尔思	200	5,160.00	0.00
228	002144	宏达高科	300	5,154.00	0.00
229	002033	丽江旅游	400	5,152.00	0.00
230	002544	杰赛科技	600	5,124.00	0.00
231	002283	天润曲轴	800	5,120.00	0.00
232	002194	武汉凡谷	400	5,100.00	0.00
233	002322	理工监测	500	5,095.00	0.00
234	002628	成都路桥	1,200	5,064.00	0.00
235	002210	飞马国际	400	5,044.00	0.00
236	002463	沪电股份	1,560	5,038.80	0.00

237	300056	三维丝	320	4,992.00	0.00
238	300105	龙源技术	460	4,968.00	0.00
239	002182	云海金属	600	4,962.00	0.00
240	002232	启明信息	500	4,935.00	0.00
241	002012	凯恩股份	1,000	4,930.00	0.00
242	300215	电科院	600	4,926.00	0.00
243	002355	兴民钢圈	800	4,912.00	0.00
244	002060	粤水电	1,014	4,897.62	0.00
245	300197	铁汉生态	420	4,863.60	0.00
246	002099	海翔药业	700	4,851.00	0.00
247	002233	塔牌集团	800	4,848.00	0.00
248	002655	共达电声	550	4,845.50	0.00
249	300226	上海钢联	130	4,841.20	0.00
250	300057	万顺股份	500	4,835.00	0.00
251	002045	国光电器	800	4,832.00	0.00
252	002547	春兴精工	400	4,788.00	0.00
252	300082	奥克股份	400	4,788.00	0.00
253	300021	大禹节水	400	4,784.00	0.00
254	300102	乾照光电	400	4,768.00	0.00
255	300084	海默科技	200	4,762.00	0.00
256	002115	三维通信	700	4,718.00	0.00
257	300064	豫金刚石	800	4,680.00	0.00
258	002197	证通电子	300	4,677.00	0.00
259	002327	富安娜	420	4,674.60	0.00
260	002600	江粉磁材	400	4,668.00	0.00
261	002490	山东墨龙	549	4,666.50	0.00
262	002245	澳洋顺昌	500	4,660.00	0.00
263	002226	江南化工	435	4,615.35	0.00
264	002278	神开股份	460	4,613.80	0.00
265	300152	燃控科技	400	4,612.00	0.00
265	300224	正海磁材	200	4,612.00	0.00
266	002392	北京利尔	500	4,595.00	0.00
267	002443	金洲管道	800	4,552.00	0.00
268	300204	舒泰神	200	4,514.00	0.00
269	002386	天原集团	600	4,500.00	0.00
270	002157	正邦科技	600	4,434.00	0.00
271	002302	西部建设	400	4,424.00	0.00
272	002014	永新股份	600	4,416.00	0.00
273	002457	青龙管业	500	4,350.00	0.00

274	002372	伟星新材	360	4,316.40	0.00
275	002205	国统股份	300	4,296.00	0.00
276	002650	加加食品	500	4,295.00	0.00
277	002090	金智科技	300	4,290.00	0.00
278	002315	焦点科技	100	4,266.00	0.00
279	300022	吉峰农机	700	4,242.00	0.00
280	300307	慈星股份	400	4,240.00	0.00
281	002512	达华智能	300	4,215.00	0.00
282	300044	赛为智能	300	4,191.00	0.00
283	002567	唐人神	600	4,164.00	0.00
284	002256	彩虹精化	500	4,135.00	0.00
285	002324	普利特	300	4,134.00	0.00
286	002042	华孚色纺	1,000	4,130.00	0.00
287	002658	雪迪龙	200	4,114.00	0.00
288	002046	轴研科技	500	4,110.00	0.00
288	002149	西部材料	300	4,110.00	0.00
289	002032	苏泊尔	300	4,107.00	0.00
290	002222	福晶科技	500	4,095.00	0.00
291	002178	延华智能	420	4,061.40	0.00
292	002154	报喜鸟	700	4,053.00	0.00
293	002003	伟星股份	520	4,030.00	0.00
294	002612	朗姿股份	200	4,016.00	0.00
294	002172	澳洋科技	800	4,016.00	0.00
295	300301	长方照明	300	4,005.00	0.00
296	002086	东方海洋	500	3,990.00	0.00
297	002206	海利得	600	3,948.00	0.00
298	002227	奥特迅	200	3,930.00	0.00
299	002394	联发股份	450	3,924.00	0.00
300	002116	中国海诚	349	3,835.51	0.00
301	300103	达刚路机	300	3,816.00	0.00
302	002158	汉钟精机	220	3,803.80	0.00
303	002220	天宝股份	600	3,780.00	0.00
304	300148	天舟文化	200	3,766.00	0.00
304	002342	巨力索具	700	3,766.00	0.00
305	002238	天威视讯	300	3,759.00	0.00
306	002349	精华制药	200	3,692.00	0.00
307	300048	合康变频	400	3,680.00	0.00
308	002016	世荣兆业	600	3,648.00	0.00
309	002305	南国置业	600	3,630.00	0.00

310	300172	中电环保	220	3,614.60	0.00
311	300135	宝利沥青	600	3,612.00	0.00
312	002401	中海科技	350	3,573.50	0.00
313	002320	海峡股份	400	3,528.00	0.00
314	002586	围海股份	300	3,510.00	0.00
315	002239	金飞达	300	3,432.00	0.00
316	002430	杭氧股份	500	3,405.00	0.00
317	002135	东南网架	900	3,339.00	0.00
318	002187	广百股份	400	3,328.00	0.00
319	002231	奥维通信	400	3,220.00	0.00
320	002503	搜于特	380	3,116.00	0.00
321	002608	舜天船舶	200	3,108.00	0.00
321	002679	福建金森	200	3,108.00	0.00
322	002441	众业达	200	3,084.00	0.00
323	002096	南岭民爆	300	3,054.00	0.00
324	300239	东宝生物	300	3,027.00	0.00
325	002641	永高股份	360	3,006.00	0.00
326	002301	齐心文具	400	2,984.00	0.00
327	002338	奥普光电	100	2,878.00	0.00
328	002419	天虹商场	300	2,850.00	0.00
329	002225	濮耐股份	500	2,645.00	0.00
330	002423	中原特钢	300	2,574.00	0.00
331	002319	乐通股份	300	2,448.00	0.00
332	002629	仁智油服	200	2,444.00	0.00
333	002208	合肥城建	400	2,376.00	0.00
334	002287	奇正藏药	100	2,045.00	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	300124	汇川技术	563,100.50	0.65
2	002465	海格通信	538,239.00	0.62
3	300017	网宿科技	487,795.50	0.56
4	300315	掌趣科技	439,949.64	0.51
5	002410	广联达	430,953.53	0.49

6	002400	省广股份	412,830.57	0.47
7	300133	华策影视	395,541.67	0.45
8	300273	和佳股份	343,021.00	0.39
9	002440	闰土股份	341,587.98	0.39
10	300026	红日药业	329,275.00	0.38
11	300257	开山股份	311,669.00	0.36
12	002052	同洲电子	309,650.00	0.36
13	300077	国民技术	308,506.51	0.35
14	300157	恒泰艾普	307,808.06	0.35
15	300147	香雪制药	305,291.00	0.35
16	300212	易华录	298,331.00	0.34
17	002475	立讯精密	290,326.39	0.33
18	002266	浙富控股	287,335.00	0.33
19	002240	威华股份	274,038.50	0.31
20	002185	华天科技	272,477.68	0.31

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	002240	威华股份	430,450.13	0.49
2	002465	海格通信	162,318.40	0.19
3	300124	汇川技术	156,855.72	0.18
4	002400	省广股份	139,579.03	0.16
5	300017	网宿科技	124,931.52	0.14
6	300315	掌趣科技	117,120.59	0.13
7	002410	广联达	106,575.27	0.12
8	300133	华策影视	98,257.63	0.11
9	002475	立讯精密	97,464.70	0.11
10	002440	闰土股份	88,355.83	0.10
11	300026	红日药业	72,006.11	0.08
12	300147	香雪制药	65,583.28	0.08
13	002052	同洲电子	64,503.55	0.07
14	300077	国民技术	62,660.17	0.07
15	002185	华天科技	61,589.47	0.07
16	300039	上海凯宝	60,741.22	0.07
17	300157	恒泰艾普	57,939.85	0.07

18	300212	易华录	56,792.73	0.07
19	002701	奥瑞金	56,126.89	0.06
20	300257	开山股份	55,641.26	0.06

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	46,791,844.59
卖出股票收入（成交）总额	9,726,302.18

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序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序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 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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 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	122,493,451.35	92.77

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	18,724.99
2	应收证券清算款	445,064.64
3	应收股利	-
4	应收利息	1,302.01
5	应收申购款	64,379.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	529,470.71

7.13.4 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。

7.13.5 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	002551	尚荣医疗	20,406.00	0.02	重大事项停牌
2	300295	三六五网	19,362.00	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
3,950	24,844.82	3,624,289.86	3.69%	94,512,748.59	96.31%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	4,177.18	0.00%

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的情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

§ 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	69,013,005.85
本报告期基金总申购份额	76,071,155.20
减：本报告期基金总赎回份额	46,947,122.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	98,137,038.45

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

2014年5月9日，本基金管理人发布《关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理；聘请何如女士担任本基金基金经理职务。

（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，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授

权职责。

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

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	56,516,955.47	100.00%	51,507.63	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	1	-	-	-	-	-

有限公司						
民生证券股份 有限公司	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。

10.7.2 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	基金交易
------	------

	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,024,681.41	100.00%

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	嘉实基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金网上直销申购、赎回及最低账面份额的单笔最低要求的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014年2月26日
2	关于调整嘉实旗下部分开放式基金的日常转换费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014年4月16日
3	关于增加苏州银行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	2014年4月17日
4	关于增加和讯信息科技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	2014年4月28日
5	关于增加上海银行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	2014年5月5日
6	关于嘉实中创 400ETF 联接基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014年5月9日
7	关于增加温州龙湾农商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与温州龙湾农商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	2014年5月12日
8	关于增加吉林银行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	2014年5月22日
9	关于增加瑞丰银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与瑞丰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	2014年6月16日
10	关于增加邮储银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与邮储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	2014年6月30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
2014 年 8 月 25 日